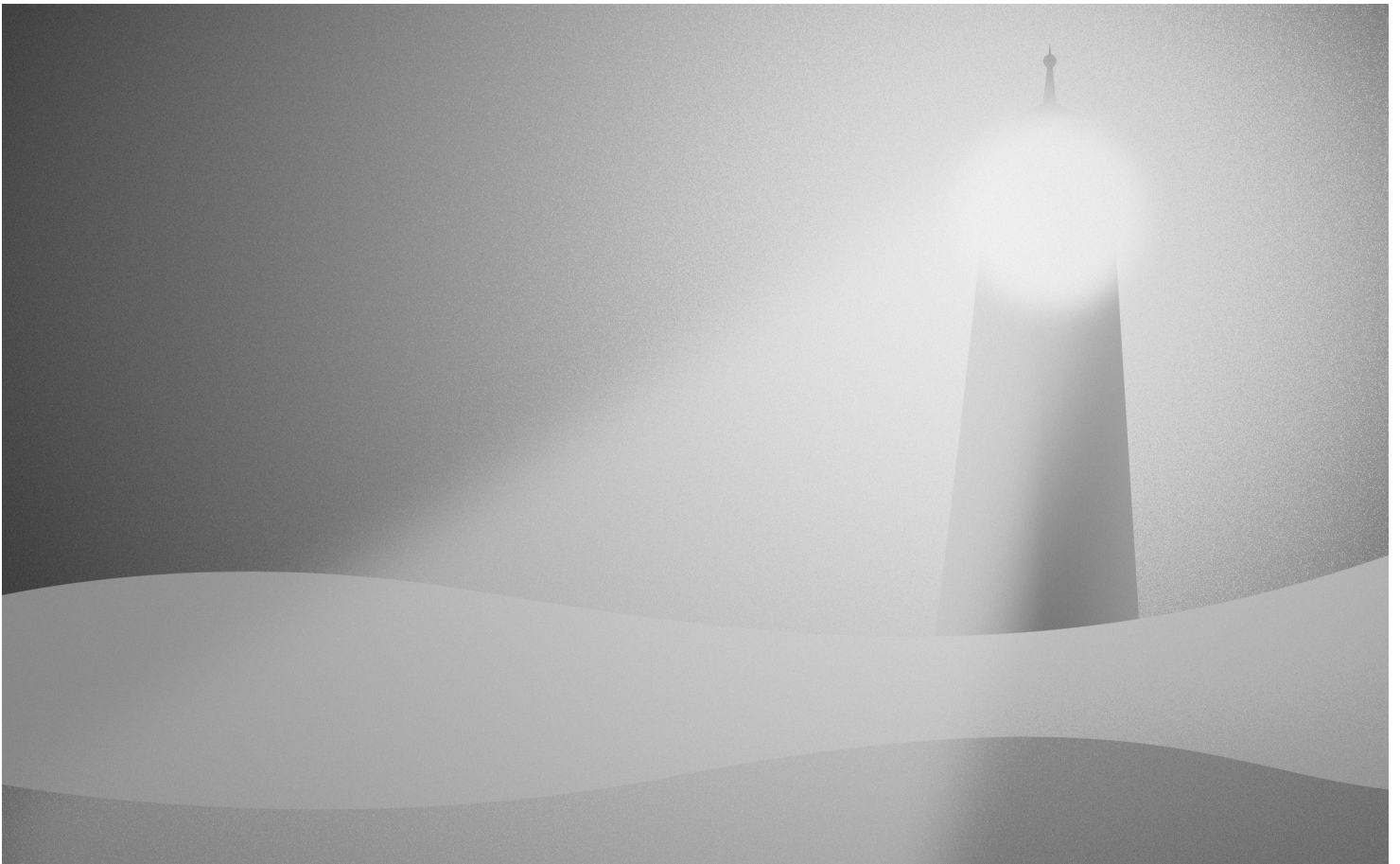




Jahresbericht | 31. Dezember 2017

Vanguard Investment Series plc



Vanguards Prinzipien für eine erfolgreiche Anlage

Wir möchten Sie nach Kräften bei einer erfolgreichen Anlage unterstützen. Die folgenden Prinzipien, die auf Vanguards Analyse und Erfahrung basieren, können Ihnen dabei den Weg weisen.

Ziele. Setzen Sie sich klare, zweckdienliche Anlageziele.

Ausgewogenheit. Entwickeln Sie eine geeignete Portfoliostrukturierung auf der Grundlage breit diversifizierter Fonds.

Kosten. Minimieren Sie Kosten.

Disziplin. Erhalten Sie Ihre Perspektive und Ihre langfristige Disziplin aufrecht.

Diese Prinzipien lassen sich in einem Motto zusammenfassen: Konzentrieren Sie sich auf die Dinge, die Sie kontrollieren können.

Wir sind überzeugt, dass es keinen weiseren Kurs für einen Anleger gibt.

Inhalt

Brief des Vorsitzenden	1	Vanguard Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund	296
Tracking Error	4	Vanguard Global Bond Index Fund	302
Unternehmensjahresabschluss der Vanguard Investment Series plc	6	Vanguard Global Corporate Bond Index Fund	472
Aktienfonds Jahresabschluss:		Vanguard Global Credit Bond Fund	520
Vanguard Emerging Markets Stock Index Fund	9	Vanguard Global Short-Term Bond Index Fund	535
Vanguard European Stock Index Fund	27	Vanguard Global Short-Term Corporate Bond Index Fund	594
Vanguard Eurozone Stock Index Fund	39	Vanguard Japan Government Bond Index Fund	617
Vanguard Global Enhanced Equity Fund	49	Vanguard SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund	633
Vanguard Global Small-Cap Index Fund	57	Vanguard U.K. Government Bond Index Fund	656
Vanguard Global Stock Index Fund	101	Vanguard U.K. Investment Grade Bond Index Fund	665
Vanguard Japan Stock Index Fund	129	Vanguard U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund	688
Vanguard Pacific ex-Japan Stock Index Fund	142	Vanguard U.S. Government Bond Index Fund	700
Vanguard SRI European Stock Fund	154	Vanguard U.S. Investment Grade Credit Index Fund	714
Vanguard SRI Global Stock Fund	167	Vanguard U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund	830
Vanguard U.S. 500 Stock Index Fund	190	Vanguard U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund	843
Vanguard U.S. Discoveries Fund	204	Erläuterungen zum Abschluss	850
Vanguard U.S. Fundamental Value Fund	207	Bericht des Verwaltungsrats	885
Vanguard U.S. Opportunities Fund	214	Zusätzliche Informationen vom Verwaltungsrat (ungeprüft)	888
Rentenfonds Jahresabschluss:		Bericht der Verwahrstelle an die Anteilinhaber	894
Vanguard 20+ Year Euro Treasury Index Fund	224	Bestätigungsvermerk der unabhängigen Rechnungsprüfer an die Mitglieder von Vanguard Investment Series plc	895
Vanguard Euro Government Bond Index Fund	230	Glossar der Anlagebegriffe	900
Vanguard Euro Investment Grade Bond Index Fund	250	Zusätzliche Informationen für Anleger in der Schweiz	901

Die Definitionen der in diesem Bericht verwendeten Anlagebegriffe finden Sie im Glossar.

Informationen zum Deckblatt: Maritime Bilder gehören seit der Firmengründung im Jahr 1975 zum reichen Erbe von Vanguard. Für ein einlaufendes Schiff bietet ein Leuchtturm einen Lichtstrahl und einen sicheren Weg zum Ufer. Ebenso können Sie darauf vertrauen, dass sich Vanguard optimal auf Sie einstellt— und Ihnen den Weg weist—, damit Sie Ihre finanziellen Ziele erreichen. Durch unsere Kundenorientierung und die niedrigen Kosten, die auf unserer einzigartigen Eigentümerstruktur basieren, ist sichergestellt, dass Ihre Interessen von zentraler Bedeutung sind.

Brief des Vorsitzenden



Sehr geehrte Anteilhaberinnen und -haber,

Es gab viele Sorgen, die die globalen Finanzmärkte im Jahr 2017 hätten belasten können, darunter die grossen Zentralbanken, die ihre geldpolitische Unterstützung reduzierten, eine Eskalation der Spannungen im internationalen Handel, politische Risiken in Europa und die steigende Verschuldung in China. Anleger zogen es jedoch vor, das Glas als halbvoll anzusehen, und konzentrierten sich auf den soliden makroökonomischen Hintergrund eines stärkeren und synchroneren weltweiten Wachstums, sinkender Arbeitslosigkeit und gedämpfter Inflation.

Dieser Optimismus spiegelte sich 2017 in einer robusten Rendite von über 22 % für weltweite Aktien. (Soweit nichts anderes angegeben ist, sind alle in diesem Schreiben angegebenen Erträge in US-Dollar ausgewiesen. Erträge aus Aktien basieren auf MSCI-Indizes und Ergebnisse aus Anleihen basieren auf Bloomberg Barclays-Indizes.) Mehrere US-Aktienindizes erreichten neue Höchstwerte, der Standard & Poor's 500 Index konnte jedoch nicht mit den Gewinnen in anderen Regionen mithalten und erzielte für das Jahr eine Rendite von 21 %. Die Aktien der entwickelten Länder im Pazifikraum stiegen um etwa 24 %, ihre Pendanten in Europa kletterten ein wenig höher, etwa 26 %. Die Schwellenmärkte setzten sich mit einem Sprung von über 37 % an die Spitze.

Das Umfeld war generell auch für die Rentenmärkte positiv. Trotz eines Anziehens des Wachstums und einer Verengung auf den Arbeitsmärkten in einem Grossteil der Industrieländer blieben die Inflationserwartungen verhalten, und eine Reihe wichtiger Zentralbanken versicherte den Märkten, dass eine Straffung nur langsam und schrittweise erfolgen würde. Globale Anleihen beendeten das Jahr mit einer Rendite von mehr als 7 %. US-Anleihen rentierten mit etwa 4 %. Obwohl einige Anleihemärkte in Lokalwährungen hinter jenen der Vereinigten Staaten zurückblieben, lag die Rendite von US-amerikanischen Nicht-US-Anleihen, ausgedrückt in US-Dollar, insgesamt bei über 10 %, was hauptsächlich auf die Schwäche des US-Dollar zurückzuführen war.

Die Renditen der Vanguard Investment Series plc Indexfonds auf Aktien und Anleihen entsprachen unter Berücksichtigung ihrer laufenden Kosten allgemein den Renditen ihrer Benchmarks. Vanguard Investment Series plc umfasst drei aktiv verwaltete Aktienfonds. Vanguard U.S. Fundamental Value Fund, Vanguard U.S. Opportunities Fund und Vanguard Global Enhanced Equity Fund. Alle drei übertrafen 2017 ihre Benchmarks, wobei der Vanguard U.S. Opportunities Fund dabei die grösste Gewinnspanne erzielte.

Marktbarometer

Index	Durchschnittliche jährliche Gesamtgewinne (in US-Dollar) für die Berichtszeiträume zum 31. Dezember 2017		
	Ein Jahr	Drei Jahre	Fünf Jahre
S&P 500 ¹ (US-Aktien mit grosser Marktkapitalisierung)	21,10 %	10,71 %	15,07 %
MSCI World	22,40	9,26	11,64
MSCI Europe	25,51	6,69	7,37
MSCI Pacific	24,64	10,16	9,00
MSCI Emerging Markets	37,28	9,10	4,35
Bloomberg Barclays Global Aggregate (World bonds)	7,49	1,74	0,12

Währungsbedingte Auswirkungen

Index	Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017		
	Renditen in Lokalwährung	Währungs- effekt	Renditen in US-Dollar
S&P 500 ¹ (US-Aktien mit grosser Marktkapitalisierung)	21,10 %	0,00 %	21,10 %
MSCI World	18,48	3,92	22,40
MSCI Europe	13,06	12,45	25,51
MSCI Pacific	19,69	4,95	24,64
MSCI Emerging Markets	30,55	6,73	37,28
Bloomberg Barclays Global Aggregate	1,22	6,27	7,49

1 Die Rendite des S&P 500 Index wurde um eine Quellensteuer von 30 % auf Dividenden bereinigt, die auf US-Wertpapiere gezahlt werden.

Zahlreiche Fonds der Vanguard Investment Series plc werden in mehreren Währungen angeboten. Aufgrund von Wechselkursschwankungen kann die Gesamrendite eines Fonds – mitunter erheblich – variieren. Dies hängt davon ab, in welcher Währung sie ausgedrückt wird. Die Schwäche des US-Dollar im Jahr 2017 gegenüber einer Reihe von wichtigen Währungen – insbesondere dem Euro – bedeutete, dass in diesen Währungen ausgedrückte Renditen höher waren. Wie in der Tabelle zum Marktbarometer auf Seite 1 dargestellt, lag die Rendite des MSCI Pacific Index in US-Dollar etwa 5 Prozentpunkte über der Rendite in Lokalwährungen und jene des MSCI Emerging Markets Index lag knapp 7 Prozentpunkte höher. Die Differenz beim MSCI Europe Index war mit über 12 Prozentpunkten sogar noch grösser.

Schnelleres Wachstum in den entwickelten Märkten trug zu einer Erholung der globalen Aktienmärkte bei

Das Wirtschaftswachstum in einigen schnell wachsenden Schwellenmärkten kühlte sich leicht ab, während es in vielen entwickelten Märkten an Fahrt aufnahm. Das sich daraus ergebende moderate, aber breit gestützte Wachstumstempo in weiten Teilen der Welt sowie die schwache Inflation und die sehr entgegenkommende Geldpolitik führten zu einem Anstieg der Aktienmärkte um mehr als 20 % in allen Regionen.

Nach einem stagnierenden Winter beschleunigte sich die US-Wirtschaft und das BIP-Wachstum stieg auf 2,3 % für das Jahr. Die Beschäftigungszuwächse blieben relativ hoch. Etwa zwei Millionen Arbeitsplätze wurden während des Jahres geschaffen. Das ist ein kleiner Rückgang gegenüber den 2,2 Millionen im Jahr 2016. Diese Zuwächse trugen dazu bei, dass die Arbeitslosigkeit weiter zurückging. Sie lag Ende des Jahres bei einem 17-Jahres-Tief von 4,1 %. Auch der Wohnungsbau und das verarbeitende Gewerbe waren starke Bereiche. Gleichzeitig blieb die Inflation gedämpft, wobei sich der lang erwartete Lohndruck erst gegen Ende des Jahres bemerkbar machte.

Vor dem Hintergrund des positiven makroökonomischen Umfelds und robuster Unternehmensgewinne schlossen die US-Aktien das Jahr mit einem Plus von rund 21 % ab. Diese Entwicklung wurde vor allem vom Technologiesektor und in geringerem Masse von den Bereichen Finanzen, Industrie und Gesundheitswesen angetrieben. Im Laufe des Jahres übertrafen Titel mit hoher Marktkapitalisierung (Large-Cap), von denen viele einen erheblichen Teil ihrer Umsätze und Gewinne im Ausland in Währungen erzielen, die gegenüber dem Dollar an Wert gewannen, ihre Mid- und Small-Cap-Pendants. Angesichts eines gestiegenen Optimismus hinsichtlich der Weltwirtschaft übertrafen die Wachstumswerte die Wertaktien.

Die Eurozone hatte ein gutes Jahr. Die politischen Risiken liessen im Frühjahr nach dem Wahlsieg der gemässigten, EU-freundlichen Parteien in Frankreich und den Niederlanden nach. Zudem beschleunigte sich die Wirtschaftstätigkeit auf 2,5 % und damit auf das höchste Jahrestempo seit zehn Jahren. Dies trug dazu bei, die gesamte Arbeitslosenquote im Euroraum bis zum Jahresende auf 8,7 % zu senken, wobei selbst in Ländern, in denen die Arbeitslosigkeit bereits niedrig war, z. B. in Deutschland, Verbesserungen zu verzeichnen waren. Auch das Verbrauchervertrauen und das

Geschäftsklima sind dadurch gestiegen. Unter den grösseren Aktienmärkten in der Eurozone rentierten Frankreich, Deutschland, Italien und Spanien alle mit über 27 %.

Im Vereinigten Königreich dürften die Verhandlungen über den Austritt aus der Europäischen Union, eine sich abschwächende Konjunktur und eine Inflation von über 2 % die Nachfrage nach Aktien gedämpft haben. Die britischen Aktien blieben mit einer Rendite von rund 22 % hinter den Werten des Euroraums zurück.

Beachten Sie, dass die regionalen Renditen insbesondere für Europa in lokaler Währung niedriger ausfielen als in US-Dollar.

In der Pazifikregion gewann Japans Wirtschaft wieder etwas an Dynamik, grösstenteils wegen der Erholung der Exporte und des verarbeitenden Gewerbes. Die Aktienmarktrendite entsprach mit rund 24 % in etwa der Rendite der entwickelten asiatischen Märkte insgesamt.

In den Schwellenländern stach der Technologiesektor mit über 50 % heraus. Verbraucherdienstleistungen erzielten mehr als 40 %, und die Renditen aus Konsumgütern, Grundstoffen und Finanzwerten lagen alle über 30 %. Nach Ländern erzielte China, der grösste Bestandteil des Emerging Markets Index, trotz der Bemühungen der Regierung, die Investitionen in Immobilien und Infrastruktur zu drosseln, eine Rendite von mehr als 50 %.

Zentralbanken werden weniger entgegenkommend

Die US-Notenbank hat im Laufe des Jahres weitere Schritte zur Normalisierung der Geldpolitik unternommen. Im März, Juni und Dezember erhöhte die Fed den Leitzins auf 1,25 % bis 1,5 %. Ausserdem startete sie im Oktober ein Programm, um die 4,5 Billionen US-Dollar an Vermögenswerten in ihrer Bilanz langsam zu reduzieren. Während die Massnahmen der Fed kurzfristige Anleiherenditen in die Höhe trieben, gaben die längerfristigen Renditen bei etwas moderateren längerfristigen Wachstums- und Inflationserwartungen leicht nach. Die Rendite der 10-jährigen US-Treasuries fiel um 4 Basispunkte und lag zum Jahresende bei 2,41 %. (Ein Basispunkt ist ein Hundertstel eines Prozentpunkts.)

Einige andere grosse Zentralbanken haben ihre entgegenkommende Politik ebenfalls etwas zurückgefahren. Die Bank of England hat ihr Ziel für den Rückkaufsatz erstmals seit mehr als einem Jahrzehnt wieder erhöht. Sie betonte jedoch, dass weitere Erhöhungen begrenzt und nur schrittweise erfolgen würden, während ihr Programm zum Ankauf von Vermögenswerten unverändert bliebe. Die Europäische Zentralbank hielt die Zinsen stabil, kündigte aber an, die Käufe von Vermögenswerten ab Januar 2018 von 60 Milliarden Euro pro Monat auf 30 Milliarden Euro zu reduzieren. Insgesamt führten diese eher bescheidenen geldpolitischen Veränderungen zu ähnlich bescheidenen Renditeveränderungen.

Japan hingegen belies sowohl die Zinssätze als auch das Programm zum Ankauf von Vermögenswerten unverändert.

Investment-Grade-Unternehmensanleihen waren ein Bereich der Stärke in den Vereinigten Staaten. Sie rentierten aufgrund der Aussicht einer schneller expandierenden Wirtschaft mit

mehr als 6 %. US-Staatsanleihen erzielten eine Rendite von über 2 %. Obwohl einige der anderen grossen Anleihemärkte der Welt, darunter Frankreich, Deutschland, Italien und Japan, Renditen zwischen leicht negativ bis 1 % in Lokalwährungen erzielten, waren die Renditen in US-Dollar angesichts der Schwäche dieser Währung deutlich höher. Frankreich, Deutschland und Italien erwirtschafteten in Dollar mehr als 13 %, Japan knapp 4 %.

Unsere nicht auf US-Dollar lautenden Anteilklassen

Vanguard Investment Series plc umfasst Anteilklassen für seine Aktien- und Rentenindexfonds in Pfund Sterling, Euro, Japanischen Yen und Schweizer Franken. Nach Berichtigung um Betriebs- und Transaktionskosten entsprachen die Renditen dieser Fonds im Allgemeinen ihren Benchmarks.

Sie bietet ausserdem Anteilklassen in drei aktiv verwalteten Fonds an, die nicht auf US-Dollar lauten. (Sofern nicht anders angegeben gelten die nachstehenden Renditen für Anlegeranteile.)

Der Vanguard U.S. Fundamental Value Fund, der in unterbewertet erscheinende Titel mit hoher Marktkapitalisierung investiert, erzielte in Pfund Sterling eine Rendite von 6,87 %, womit er die Rendite seiner Benchmark um fast 4 Prozentpunkte übertraf. Die Anlagen des Beraters in Maschinenwerte im Industriesektor erzielten deutliche Zuwächse. Auch die Titelauswahl im Gesundheitswesen und bei den nicht-zyklischen Konsumgütern unterstützte die Performance. Nur Grundstoffe und Finanztitel erzielten suboptimale Renditen.

Der Vanguard U.S. Opportunities Fund, der sich auf Wachstumstitel aller Grössen konzentriert, lieferte eine Rendite von 19,92 % in Pfund Sterling bzw. 15,32 % in Euro. Er lag in beiden Währungen um fast 10 Prozentpunkte über seiner breit gefächerten Benchmark. Die Positionen des Fonds in Pharmazeutik-Unternehmen und in geringerem Umfang auch in Herstellern von Medizinprodukten im Gesundheitswesen trugen einen grossen Teil zur Outperformance bei. Auch die Informationstechnologie half, ebenso wie die weitgehende Vermeidung des Energiesektors.

Für den kurzen Zeitraum vom 14. September 2017 bis zum 31. Dezember 2017 erzielte der Vanguard Global Credit Bond Fund eine Rendite von 0,92 % in Pfund Sterling. Für seine institutionellen Anteile erzielte er 0,63 % in Euro. Diese Ergebnisse waren ein wenig besser als die der Benchmark.

Unsere auf US-Dollar lautenden Anteilklassen

Wie unsere Fonds in anderen Währungen entwickelten sich auch unsere Indexfonds im Einklang mit ihren Benchmarks. Aufgrund von Währungsschwankungen waren die Renditen der Aktienindexfonds in Dollar tendenziell niedriger als in anderen Währungen. Die meisten unserer Anleihenfonds, die in ausländische Positionen investieren, setzen Währungsabsicherungen ein, um die Auswirkungen von Währungsschwankungen auf ihre Renditen zu verringern. Auch die dollarbasierten Anteilklassen der drei oben genannten aktiv verwalteten Fonds übertrafen ihre Benchmarks.

Vanguard Investment Series plc umfasst einen nur in Dollar verfügbaren, aktiv verwalteten Fonds, den Global Enhanced Equity Fund. Er setzt auf einen eigenen quantitativen Ansatz zum Aufbau eines Portfolios, von dem erwartet wird, dass es die Outperformance seiner Benchmark übersteigt, ohne ein deutlich höheres Risiko einzugehen. Im Geschäftsjahr erfüllte er sein Mandat mit einer Rendite der institutionellen Anteile von 25,23 %, verglichen mit 22,40 % seiner Benchmark. Die Titelauswahl in Deutschland, Japan und Australien trug wesentlich zur Outperformance bei. Nach Sektor waren die Industrietitel in Bezug auf die relative Performance führend.

Änderungen an unserem Fondsangebot

Im vergangenen Herbst haben wir drei neue Rentenfonds hinzugefügt. Der Vanguard Global Corporate Bond Index Fund und der Vanguard Global Short-Term Corporate Bond Index Fund werden passiv verwaltet. Es handelt sich um auf US-Dollar lautende Fonds, die bestrebt sind, in Investment-Grade-Anleihen von Unternehmen aus aller Welt zu investieren.

Den dritten neuen Fonds im Bunde habe ich bereits erwähnt: Vanguard Global Credit Bond Fund. Hierbei handelt es sich um einen aktiv verwalteten, auf US-Dollar lautenden Fonds, der die weltweite Anlage in Investment-Grade-Unternehmens- und Nicht-Unternehmensanleihen anstrebt.

Der SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund, den wir in unserem vorherigen Schreiben beschrieben haben, wurde im Juli aufgelegt.

Wir sind bereit für das, was als Nächstes kommt.

Abschliessend möchte ich noch einmal sagen, wie erfreut ich darüber bin, dass unser Verwaltungsrat Tim Buckley zu meinem Nachfolger als Chief Executive Officer von Vanguard gewählt hat.

Ich bin zuversichtlich, dass Tim und die talentierten und erfahrenen Mitarbeiter von Vanguard gut darauf vorbereitet sind, alles in Angriff zu nehmen, was ihnen bevorsteht. Und noch etwas, wovon ich überzeugt bin: Es gibt grosse Bereiche der Welt, die von unserer Art zu investieren gut bedient würden. Es verlangt Demut, über die Auswirkungen nachzudenken, die unsere Arbeit bei Vanguard auf Kunden hat, die versuchen, eine Familie zu gründen, ein erstes Heim zu kaufen, für die Universität zu sparen oder sich auf den Ruhestand vorzubereiten. Ich habe stets versucht, Entscheidungen im besten Interesse der Anleger zu treffen. Es war ein Privileg, mit Menschen zusammenzuarbeiten, die diesem Ideal ebenfalls verhaftet sind.

Wie immer danke ich Ihnen, dass Sie Ihr Vermögen Vanguard anvertrauen.

Mit freundlichen Grüssen



F. William McNabb III
Chairman
The Vanguard Group, Inc.
23. April 2018

Tracking Error

Im Rahmen der Nachbildung der Wertentwicklung des Index versuchen einige der Fonds, den Index nachzubilden, indem sie all ihre – oder fast all ihre – Vermögenswerte in die Wertpapiere investieren, aus denen der Index besteht, und alle Aktien in etwa dem Mengenverhältnis halten, das ihrer Gewichtung im Index entspricht. Andere streben die repräsentative Auswahl jener Wertpapiere an, welche die Performance des Index so genau wie möglich nachbilden. Zur Zusammenstellung der Auswahl werden entweder Optimierungs- und/oder geschichtete Stichprobentechniken eingesetzt. Der Tracking Error misst die Volatilität der Renditendifferenz zwischen dem Fonds und dem Index. Er wird berechnet als Standardabweichung des Tracking-Unterschieds zwischen dem Fonds und dem Index (inklusive Gebühren für den vergangenen 36-monatigen Zeitraum, bzw. seit der Auflegung des Fonds, wenn er keine 36-monatige Wertentwicklung hat). Der realisierte (Ex-post-)Tracking Error kann vom erwarteten Tracking Error abweichen, was von einer Reihe von Umständen abhängt. Dazu gehören Transaktionskosten, Erträge aus Wertpapierleihgeschäften und Quellensteuerunterschiede. Der erwartete Tracking Error und der Ex-post-Tracking Error variieren unter normalen Umständen in der Regel nicht sehr.

Fonds	Zum 31. Dezember 2017		Erklärung für Divergenz
	Erwarteter Tracking Error	Ex-Post Tracking Error	
Aktien			
Emerging Markets Stock Index ¹	0,185	0,193	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
European Stock Index ²	0,134	0,224	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Eurozone Stock Index ²	0,247	0,246	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Global Small-Cap Index ¹	0,096	0,072	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Global Stock Index ²	0,044	0,066	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Global Stock Index abgesichert in EUR ²	0,062	0,077	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Japan Stock Index ²	0,108	0,103	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Pacific ex-Japan Stock Index ²	0,097	0,119	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
SRI European Stock ¹	0,624	0,620	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
SRI Global Stock ¹	0,299	0,310	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
U.S. 500 Stock Index ²	0,015	0,023	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
U.S. 500 Stock Index abgesichert in EUR ²	0,051	0,052	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Anleihen			
20+ Year Euro Treasury Index ¹	0,185	0,269	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Euro Government Bond Index ¹	0,134	0,107	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Euro Government Bond Index abgesichert in GBP ¹	0,247	0,124	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Euro Investment Grade Bond Index ¹	0,205	0,222	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Euro Investment Grade Bond Index abgesichert in GBP ¹	0,044	0,233	Die Differenz beim Tracking Error ist vornehmlich auf die Portfolio-Optimierung zurückzuführen.
Eurozone Inflation-Linked Bond Index ¹	0,062	0,161	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Global Bond Index abgesichert in USD ¹	0,108	0,177	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Global Bond Index abgesichert in CHF ¹	0,125	0,172	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Global Bond Index abgesichert in EUR ¹	0,109	0,172	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Global Bond Index abgesichert in GBP ¹	0,128	0,180	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Global Bond Index abgesichert in JPY ¹	0,015	0,233	Die Differenz beim Tracking Error ist vornehmlich auf die Portfolio-Optimierung zurückzuführen.

Fonds	Zum 31. Dezember 2017		Erklärung für Divergenz
	Erwarteter Tracking Error	Ex-Post Tracking Error	
Global Short-Term Bond Index abgesichert in USD ¹	0,051	0,102	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Global Short-Term Bond Index abgesichert in EUR ¹	0,060	0,097	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Global Short-Term Bond Index abgesichert in CHF ¹	0,064	0,102	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Global Short-Term Bond Index abgesichert in GBP ¹	0,079	0,102	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Global Short Term Bond Index abgesichert in japanischen Yen ¹	0,028	0,137	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Japan Government Bond Index ¹	0,118	0,148	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
Japan Government Bond Index abgesichert in GBP ¹	0,217	0,236	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
SRI Euro Investment Grade Bond Index abgesichert in EUR ¹	0,200	0,516	Die Differenz beim Tracking Error ist vornehmlich auf die Portfolio-Optimierung zurückzuführen.
U.K. Government Bond Index ¹	0,121	0,191	Die Differenz beim Tracking Error ist vornehmlich auf die Portfolio-Optimierung zurückzuführen.
U.K. Investment Grade Bond Index ¹	0,276	0,191	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index ¹	0,111	0,223	Die Differenz beim Tracking Error ist vornehmlich auf die Portfolio-Optimierung zurückzuführen.
U.S. Government Bond Index ¹	0,274	0,249	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
U.S. Government Bond Index abgesichert in GBP ¹	0,257	0,252	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
U.S. Investment Grade Credit Index ¹	0,323	0,426	Die Differenz beim Tracking Error ist vornehmlich auf den Wertzuwachs durch Neuemissionen und die Anleihenauswahl zurückzuführen.
U.S. Investment Grade Credit Index abgesichert in GBP ¹	0,291	0,428	Die Differenz beim Tracking Error ist vornehmlich auf die Portfolio-Optimierung zurückzuführen.
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index ¹	0,024	0,099	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index In CHF abgesichert ¹	0,061	0,124	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index In EUR abgesichert ¹	0,043	0,119	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index In GBP abgesichert ¹	0,026	0,112	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index In SGD abgesichert ¹	0,049	0,098	Der Fonds hat seine Benchmark innerhalb akzeptabler Toleranzniveaus seines erwarteten Tracking Error nachgebildet.

1. Der Fonds strebt die repräsentative Auswahl jener Wertpapiere an, welche die Performance des Index so genau wie möglich nachbilden.

2. Der Fonds versucht, den Index nachzubilden, indem er all seine – oder fast all seine – Vermögenswerte in die Wertpapiere investiert, aus denen der Index besteht, und alle Aktien in etwa dem Mengenverhältnis hält, das ihrer Gewichtung im Index entspricht.

Unternehmensjahresabschluss der Vanguard Investment Series plc

Vermögensaufstellung der Gesellschaft

	Summe US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	Summe US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	85.885.453.333	65.304.055.141
Derivative Finanzinstrumente	68.834.182	60.333.404
Barmittel	891.938.411	642.180.948
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenkassageschäften	54.117	158.422
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	399.214.040	326.858.896
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	292.676.243	349.568.672
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	152.316.481	102.953.738
Barmittel aus Marge	14.707.494	10.462.171
Barsicherheiten	2.693.000	—
Sonstige Forderungen	80.476	234.668
Summe Umlaufvermögen	87.707.967.777	66.796.806.060
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	70.400.866	88.066.461
Überziehungskredit	16.497.957	6.832.949
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	525.738	538.582
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	527.317.266	531.467.346
Zahlbare Dividenden	30.453.987	36.435.622
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	99.717.715	253.213.524
An Broker zu zahlende Bareinschüsse	127.701	219.717
Zahlbare Verwaltungsgebühren	16.590.645	12.910.788
Sonstige Verbindlichkeiten	2.080	—
Summe kurzfristige Passiva	761.633.955	929.684.989
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	86.946.333.822	65.867.121.071

Im Namen des Verwaltungsrats

Axel Lomholt
Peter Blessing
23. April 2018

Betriebsergebnisrechnung der Gesellschaft

	Summe US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Summe US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	591.417.558	463.633.237
Dividenden	1.154.918.034	1.018.383.720
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	8.070.738	13.321.590
Verschiedene Erträge	5.743.644	1.316.473
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	9.263.834.443	1.323.134.375
Summe Anlageerträge/(-verluste)	11.023.984.417	2.819.789.395
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	177.666.246	144.584.236
Transaktionsgebühren und Provisionen	10.290.406	7.820.056
Sonstige Aufwendungen	356.792	1.028.637
Summe Aufwendungen	188.313.444	153.432.929
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	874.348	430.883
Ausgezahlte Ausschüttungen	82.432.404	85.599.749
Ertragsausgleich	8.752.994	(5.133.366)
Summe Finanzierungskosten	92.059.746	80.897.266
Nettoanlageerträge/(-verluste)	10.743.611.227	2.585.459.200
Ausländische Quellensteuer	(155.974.831)	(143.221.867)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)	10.587.636.396	2.442.237.333

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Mit Erreichen der Ergebnisse für das Geschäftsjahr beziehen sich alle Beträge auf die laufende Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Aufstellung der Gesellschaft der Veränderungen des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens

	Summe US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Summe US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	10.587.636.396	2.442.237.333
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	34.266.768.138	35.404.090.990
Rücknahmen	(26.889.881.237)	(27.214.088.186)
Reinvestitionen	20.363.689	6.695.519
Summe Kapitalgeschäfte	7.397.250.590	8.196.698.323
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr ¹	17.984.886.986	10.638.935.656
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	65.867.121.071	56.743.324.136
Berichtigung für Währungsumrechnung ²	3.094.325.765	(1.515.138.721)
Zum Jahresende	86.946.333.822	65.867.121.071

1 Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung aufgeführt.

2 Die Abschlüsse der einzelnen Teilfonds werden in der Basiswährung jedes Teilfonds ausgewiesen. Zur Berechnung der konsolidierten Summe der Gesellschaft, wurden die auf Euro lautenden Teilfonds, die auf JPY lautenden Teilfonds und die auf GBP lautenden Teilfonds zu den folgenden Wechselkursen in US-Dollar umgerechnet:

	Täglicher Wechsel- kurs zum 31. Dezember 2017	Täglicher Wechsel- kurs zum 31. Dezember 2016	Durchschnittssatz für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	Durchschnittssatz für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	Durchschnittssatz für den Zeitraum vom 18. Juli 2017 bis 31. Dezember 2017
Auf EUR lautende Teilfonds	0,8328	0,9480	0,8850	0,9034	0,8475
Auf JPY lautender Teilfonds	112,6500	116,2791	112,1328	108,4716	N/A
Auf GBP lautende Teilfonds	0,7392	0,8093	0,7759	0,7378	N/A

Die sich hieraus ergebende Wechselkursberichtigung stellt die Differenz der Wechselkurse dar, die zu Beginn des Jahres auf das Nettovermögen angewendet wurden, und ein Wechselkursdifferenzial bei der Zusammenfassung der Betriebsergebnisrechnung zum Durchschnittssatz für den Jahreszeitraum.

Diese Berichtigung dient einzig und allein dem Ausweis der Gesamtbeträge der Gesellschaft in US-Dollar und hat keine Auswirkungen auf individuelle Teilfonds.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Emerging Markets Stock Index Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Asset Management, Limited.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Anlageziel

Der Fonds strebt die Nachbildung der Performance des MSCI Emerging Markets Index an, eines nach Marktkapitalisierung gewichteten Index aus Unternehmen in Schwellenmärkten.

Portfoliomerkmale

	Fonds	MSCI Emerging Markets Index
Anzahl der Aktien	862	846
Mittlere Marktkapitalisierung		
US-Dollar	\$ 24,9 Mrd.	\$ 24,8 Mrd.
Euro	€ 20,7 Mrd.	€ 20,6 Mrd.
Britisches Pfund	£ 18,4 Mrd.	£ 18,3 Mrd.
Schweizer Franken	CHF 24,2 Mrd.	CHF 24,1 Mrd.
Kurs/Gewinn-Verhältnis	14,8x	14,8x
Kurs/Buch-Verhältnis	1,8x	1,8x
Rendite	2,2 %	2,2 %
Eigenkapitalrendite	16,6 %	16,6 %
Ertragszuwachsrate	12,0 %	12,0 %
Portfolioumschlag ¹	-32 %	—
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,27 %	
Anlegeranteile	0,40 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,22 %	
Thesaurierende Anteile	0,27 %	
Ausschüttende Anteile	0,27 %	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,22 %	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,22 %	
Kurzfristige Reserven	0,0 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	MSCI Emerging Markets Index
R ²	1,00	1,00
Beta	1,00	1,00

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI Emerging Markets Index
Luxusgüter	10,2 %	10,2 %
Grundbedarfsgüter	6,6	6,6
Energie	6,8	6,8
Finanzwerte	23,4	23,4
Gesundheitswesen	2,7	2,7
Industriegüter	5,2	5,3
Informationstechnologie	27,7	27,6
Grundstoffe	7,4	7,4
Immobilien	2,8	2,8
Telekommunikationsdienste	4,8	4,8
Versorger	2,4	2,4

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI Emerging Markets Index
China	29,7 %	29,7 %
Südkorea	15,4	15,4
Taiwan	11,3	11,3
Indien	8,7	8,8
Südafrika	7,1	7,1
Brasilien	6,8	6,8
Russland	3,3	3,3
Mexiko	2,9	2,9
Malaysia	2,4	2,4
Indonesien	2,3	2,2
Thailand	2,3	2,3
Chile	1,3	1,3
Polen	1,3	1,3
Philippinen	1,1	1,1
Türkei	1,1	1,1
Sonstige	3,0	3,0

Die 10 grössten Positionen² (% des Gesamtvermögens)

Unternehmen	Sektor	Anteil
Tencent Holdings Ltd.	Internetsoftware und -dienste	5,4 %
Samsung Electronics Co. Ltd.	Halbleiter	4,8
Alibaba Group Holding Ltd.	Internetsoftware und -dienste	3,6
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	Halbleiter	3,4
Naspers Ltd.	Kabel und Satellit	2,2
China Construction Bank Corp.	Diversifizierte Banken	1,4
Baidu Inc.	Internet-Medien	1,2
China Mobile Ltd.	Mobilfunkdienste	1,1
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	Diversifizierte Banken	1,1
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd.	Lebensversicherung	1,0
Zehn grösste Positionen		25,2 %

Anlagefokus

Stil	Wert	Mischung	Wachstum
Marktkapitalisierung	Gross		
	Mittel		
	Klein		

1 Ein negativer Portfolioumschlag deutet darauf hin, dass der Gesamtwert der Zeichnungen und Rückkäufe über dem Wert der Wertpapiertransaktionen gelegen hat.

2 Die aufgeführten Positionen schliessen etwaige vorübergehende Baranlagen und Aktienindexprodukte aus.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

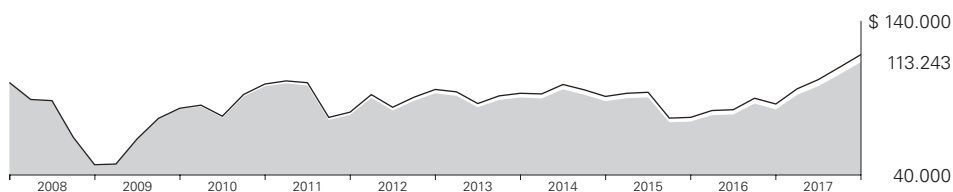
Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

Emerging Markets Stock Index Fund
Benchmark: MSCI Emerging Markets Index

In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. \$ 100.000



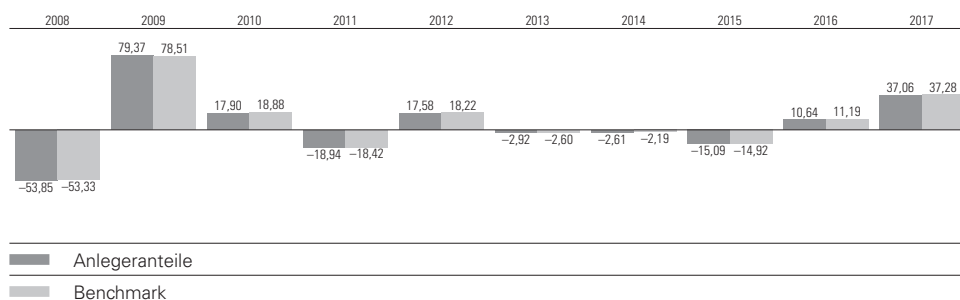
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
— Anlegeranteile	37,06 %	4,01 %	1,25 %	\$ 113.243
— Benchmark	37,28	4,35	1,68	118.166

	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
Institutionelle Anteile	37,24 %	7,31 %	\$ 6.556.560
Benchmark	37,28	7,48	6.596.629

	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von \$ 200.000.000
Institutionelle Plus-Anteile	37,31 %	5,96 %	\$ 253.153.800
Benchmark	37,28	6,09	254.372.748

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,22 Prozentpunkte für Anlegeranteile, 0,04 Prozentpunkte für institutionelle Anteile und 0,03 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



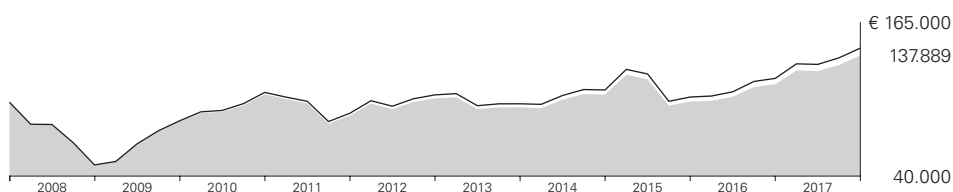
¹ Für institutionelle Anteile: 27. Februar 2014; für institutionelle Plus-Anteile: 6. Dezember 2013.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Emerging Markets Stock Index Fund
 Benchmark: MSCI Emerging Markets Index

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. € 100.000



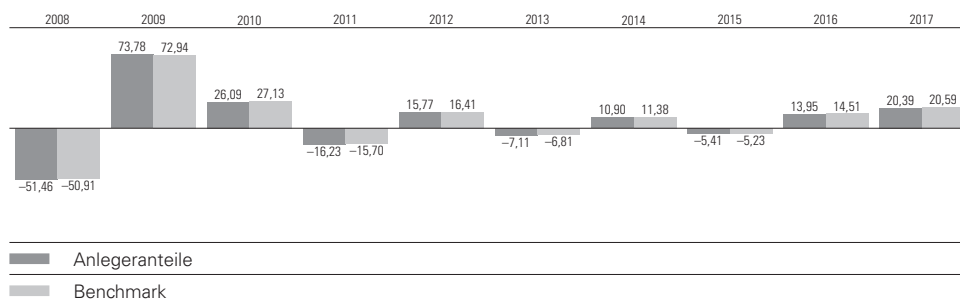
	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
■ Anlegeranteile	20,39 %	5,98 %	3,26 %	€ 137.889
— Benchmark	20,59	6,32	3,70	143.874

		Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von € 5.000.000
Benchmark	20,59	11,19	7.515.971	

		Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von € 200.000.000
Benchmark	20,59	9,55	289.876.472	

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,20 Prozentpunkte für Anlegeranteile, 0,04 Prozentpunkte für institutionelle Anteile und 0,02 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



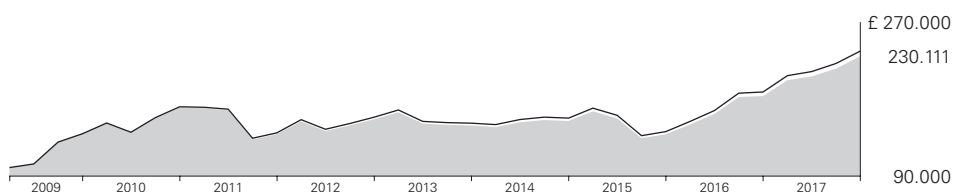
1 Für institutionelle Anteile: 27. Februar 2014; für institutionelle Plus-Anteile: 6. Dezember 2013.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Emerging Markets Stock Index Fund
 Benchmark: MSCI Emerging Markets Index

In GBP

Kumulative Wertentwicklung: 23. Juni 2009–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile	25,36 %	8,02 %	10,27 %	£ 230.111
Benchmark	25,40	8,25	10,61	236.178

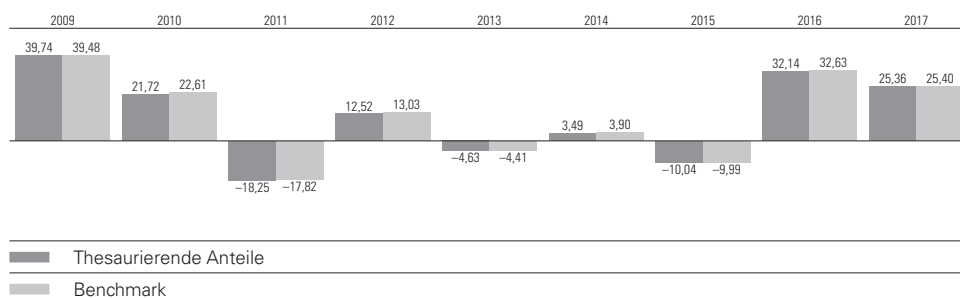
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Ausschüttende Anteile	25,36 %	8,02 %	10,27 %	£ 230.052
Benchmark	25,40	8,25	10,61	236.178

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	25,42 %	8,02 %	10,59 %	£ 279.593.800
Benchmark	25,40	8,25	10,70	280.520.037

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	25,42 %	8,02 %	10,59 %	£ 279.595.731
Benchmark	25,40	8,25	10,70	280.520.037

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,04 Prozentpunkte für Thesaurierungsanteile und Ertragsanteile und 0,02 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile und institutionelle Plus-Ertragsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 23. Juni 2009–31. Dezember 2017



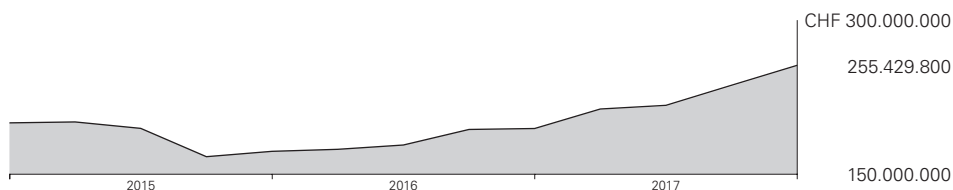
1 Für Thesaurierungs- und Ertragsanteile, 23. Juni 2009; für institutionelle Plus-Thesaurierungs- und institutionelle Plus-Ertragsanteile, 2. September 2014.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Emerging Markets Stock Index Fund
Benchmark: MSCI Emerging Markets Index

In Schweizer Franken

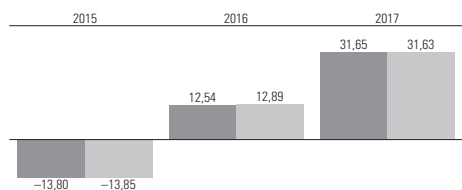
Kumulative Wertentwicklung: 10. März 2015–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. CHF 200.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von CHF 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile	31,65 %	9,09 %	CHF 255.429.800
Benchmark	31,63	9,18	256.029.663

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,02 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 10. März 2015–31. Dezember 2017



	2015	2016	2017
Institutionelle Plus-Anteile	-13,80	12,54	31,65
Benchmark	-13,85	12,89	31,63

¹ 10. März 2015.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Aktien 98,63 % (2016: 99,64 %)							
Brasilien 6,71 % (2016: 7,67 %)							
Itau Unibanco Holding SA - Vorzugsaktien	6.261.826	80.380.016	0,75 %	Odontoprev SA	517.965	2.484.346	0,02 %
Vale SA	6.169.525	74.880.190	0,70 %	EDP-Energias do Brasil SA	580.888	2.451.669	0,02 %
Banco Bradesco SA - Vorzugsaktien	5.954.924	60.768.194	0,57 %	Centrais Eletricas Brasileiras SA	416.300	2.427.193	0,02 %
Ambev SA	9.147.799	58.685.346	0,55 %	Porto Seguro SA	216.580	2.372.057	0,02 %
Petroleo Brasileiro SA - Vorzugsaktien	7.630.603	37.036.179	0,35 %	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA	337.300	2.169.962	0,02 %
Petroleo Brasileiro SA	5.737.637	29.249.478	0,27 %	Sul America SA	378.078	2.126.838	0,02 %
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	4.006.104	27.511.697	0,26 %	Compania Energetica de Minas Gerais (BVMF)	284.226	591.227	0,01 %
Itausa-Investimentos Itau SA - Vorzugsaktien	7.685.238	25.068.366	0,23 %	Compania Energetica de Minas Gerais	16.383	32.597	0,00 %
Cielo SA	2.364.008	16.762.072	0,16 %	AES Tiete Energia SA - Vorzugsaktien	3	2	0,00 %
Banco Bradesco SA	1.722.870	16.651.657	0,16 %	AES Tiete Energia SA	1	1	0,00 %
Banco do Brasil SA	1.660.744	15.931.046	0,15 %			717.793.717	6,71 %
Ultrapar Participacoes SA	698.390	15.790.676	0,15 %	Chile 1,24 % (2016: 1,19 %)			
Kroton Educacional SA	2.709.776	15.031.165	0,14 %	SACI Falabella	1.415.917	14.148.119	0,13 %
Lojas Renner SA	1.395.646	14.932.163	0,14 %	Empresas COPEC SA	889.912	14.108.820	0,13 %
Telefonica Brasil SA - Vorzugsaktien	862.254	12.638.386	0,12 %	Enel Americas SA	55.571.034	12.379.641	0,12 %
Raia Drogasil SA	452.100	12.511.766	0,12 %	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA - Vorzugsaktien Klasse B	187.591	11.118.560	0,10 %
BB Seguridade Participacoes SA	1.371.612	11.780.539	0,11 %	Banco Santander Chile	129.232.122	10.107.752	0,10 %
CCR SA	2.372.426	11.550.656	0,11 %	Empresas CMPC SA	2.440.270	8.332.503	0,08 %
BRF SA	873.116	9.633.730	0,09 %	Latam Airlines Group SA	584.722	8.257.684	0,08 %
Rumo SA	2.138.901	8.363.193	0,08 %	Cencosud SA	2.761.562	8.127.788	0,08 %
WEG SA	1.114.540	8.100.919	0,08 %	Banco de Chile	48.387.858	7.773.782	0,07 %
Banco Santander Brasil SA	820.100	7.881.821	0,07 %	Banco de Credito e Inversiones	85.138	5.869.868	0,06 %
Embraer SA	1.303.292	7.858.021	0,07 %	Enel Generacion Chile SA	6.328.637	5.742.164	0,05 %
Equatorial Energia SA	388.200	7.683.015	0,07 %	Enel Chile SA	39.020.598	4.631.229	0,04 %
Gerdau SA - Vorzugsaktien	2.035.187	7.595.676	0,07 %	Compania Cervecerias Unidas SA	296.636	4.442.449	0,04 %
Compania Brasileira de Distribuicao - Vorzugsaktien	310.713	7.393.379	0,07 %	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA	304.475	3.426.074	0,03 %
Hypermarcas SA	677.696	7.354.935	0,07 %	Colbun SA	14.993.652	3.376.973	0,03 %
Lojas Americanas SA - Vorzugsaktien	1.416.940	7.283.117	0,07 %	Agua Andinas SA Klasse A	5.080.807	3.337.744	0,03 %
Fibra Celulose SA	481.009	6.938.676	0,06 %	Itau CorpBanca	282.608.853	2.573.433	0,03 %
Compania de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	669.775	6.931.770	0,06 %	Embotelladora Andina SA - Vorzugsaktien Klasse B	482.618	2.409.245	0,02 %
TIM Participacoes SA	1.649.488	6.514.212	0,06 %	AES Gener SA	6.037.025	1.982.957	0,02 %
Localiza Rent a Car SA	954.702	6.349.138	0,06 %			132.146.785	1,24 %
BR Malls Participacoes SA	1.626.779	6.243.073	0,06 %	China 28,70 % (2016: 25,90 %)			
Klabin SA	1.130.897	6.000.358	0,06 %	Tencent Holdings Ltd.	11.065.836	574.716.260	5,37 %
Suzano Papel e Celulose SA	843.500	4.752.650	0,04 %	Alibaba Group Holding Ltd. ADR	2.237.789	385.861.957	3,61 %
JBS SA	1.549.821	4.583.445	0,04 %	China Construction Bank Corp. Klasse H	163.201.397	150.314.055	1,41 %
Braskem SA - Vorzugsaktien Klasse A	344.669	4.454.481	0,04 %	Baidu, Inc. ADR	532.060	124.613.773	1,17 %
Qualicorp SA	449.815	4.203.752	0,04 %	China Mobile Ltd.	11.904.440	120.684.491	1,13 %
Cosan SA Industria e Comercio	327.524	4.097.629	0,04 %	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Klasse H	143.101.703	115.143.299	1,08 %
Atacadao Distribuicao Comercio e Industria Ltda	789.500	3.629.639	0,03 %	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. Klasse H	10.143.744	105.559.921	0,99 %
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	162.616	3.475.769	0,03 %	Bank of China Ltd. Klasse H	154.532.891	75.909.368	0,71 %
Engie Brasil Energia SA	311.415	3.333.739	0,03 %	NetEase, Inc. ADR	154.197	53.208.759	0,50 %
Natura Cosmeticos SA	325.542	3.244.526	0,03 %	JD.com, Inc. ADR	1.276.347	52.866.293	0,49 %
Centrais Eletricas Brasileiras SA - Vorzugsaktien	451.173	3.087.524	0,03 %	CNOOC Ltd.	34.452.891	49.449.482	0,46 %
Compania Energetica de Minas Gerais - Vorzugsaktien	1.472.302	3.049.264	0,03 %	China Life Insurance Co., Ltd. Klasse H	14.481.697	45.479.342	0,43 %
M Dias Branco SA	190.600	2.993.657	0,03 %	China Petroleum & Chemical Corp. Klasse H	49.611.430	36.364.665	0,34 %
Compania Siderurgica Nacional SA	1.166.576	2.947.125	0,03 %	Ctrip.com International Ltd. ADR	763.658	33.677.318	0,31 %
				Geely Automobile Holdings Ltd.	9.573.108	33.186.807	0,31 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
China Merchants Bank Co., Ltd. Klasse H	7.583.918	30.171.523	0,28 %	CITIC Securities Co., Ltd. Klasse H	4.459.497	9.195.898	0,09 %
Yum China Holdings, Inc.	745.796	29.846.756	0,28 %	Vipshop Holdings Ltd. ADR	783.752	9.185.573	0,09 %
PetroChina Co., Ltd. Klasse H	41.021.578	28.599.082	0,27 %	China Vanke Co., Ltd. Klasse H	2.292.469	9.149.583	0,09 %
China Pacific Insurance Group Co., Ltd. Klasse H	5.121.906	24.602.813	0,23 %	CRRC Corp., Ltd. Klasse H	8.051.623	8.610.590	0,08 %
New Oriental Education & Technology Group, Inc. ADR	259.794	24.420.636	0,23 %	Haitong Securities Co., Ltd. Klasse H	5.905.385	8.566.521	0,08 %
China Overseas Land & Investment Ltd.	7.450.425	23.969.681	0,22 %	Lenovo Group Ltd.	13.813.007	7.792.379	0,07 %
Agricultural Bank of China Ltd. Klasse H	50.664.044	23.590.897	0,22 %	Guangdong Investment Ltd.	5.721.582	7.655.808	0,07 %
China Evergrande Group	6.383.511	22.007.038	0,21 %	China Conch Venture Holdings Ltd.	3.142.136	7.275.231	0,07 %
Country Garden Holdings Co., Ltd.	10.319.777	19.669.794	0,18 %	Beijing Enterprises Water Group Ltd.	9.196.353	7.117.283	0,07 %
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	9.143.322	18.456.708	0,17 %	Longfor Properties Co., Ltd.	2.819.524	7.062.065	0,07 %
Sunny Optical Technology Group Co., Ltd.	1.394.166	17.816.533	0,17 %	Great Wall Motor Co., Ltd. Klasse H	6.075.667	6.956.010	0,07 %
Sunac China Holdings Ltd.	4.269.644	17.668.886	0,17 %	China Everbright International Ltd.	4.840.127	6.909.779	0,06 %
China Shenhua Energy Co., Ltd. Klasse H	6.637.792	17.194.592	0,16 %	China Resources Power Holdings Co., Ltd.	3.688.473	6.869.912	0,06 %
PICC Property & Casualty Co., Ltd. Klasse H	8.893.012	17.086.851	0,16 %	Zhuzhou CRRC Times Electric Co., Ltd. Klasse H	1.046.176	6.805.169	0,06 %
TAL Education Group ADR	559.423	16.620.457	0,16 %	Haier Electronics Group Co., Ltd.	2.482.621	6.796.220	0,06 %
CITIC Ltd.	11.371.405	16.408.408	0,15 %	Kingboard Chemical Holdings Ltd.	1.225.500	6.623.435	0,06 %
China Unicom Hong Kong Ltd.	11.989.090	16.195.463	0,15 %	People's Insurance Co. Group of China Ltd. Klasse H	13.335.213	6.567.558	0,06 %
China Resources Land Ltd.	5.418.379	15.941.913	0,15 %	Kunlun Energy Co., Ltd.	6.282.434	6.541.774	0,06 %
Brilliance China Automotive Holdings Ltd.	5.916.474	15.818.033	0,15 %	China Merchants Port Holdings Co., Ltd.	2.489.633	6.512.862	0,06 %
Hengan International Group Co., Ltd.	1.392.854	15.456.754	0,14 %	Autohome, Inc. ADR	100.101	6.473.532	0,06 %
Sino Biopharmaceutical Ltd.	8.711.793	15.445.928	0,14 %	China Cinda Asset Management Co., Ltd. Klasse H	17.454.588	6.385.852	0,06 %
Shenzhou International Group Holdings Ltd.	1.446.738	13.769.116	0,13 %	Dongfeng Motor Group Co., Ltd. Klasse H	5.217.067	6.313.363	0,06 %
China Telecom Corp., Ltd. Klasse H	26.804.124	12.755.215	0,12 %	China Medical System Holdings Ltd.	2.708.067	6.311.768	0,06 %
58.com, Inc. ADR	176.725	12.648.208	0,12 %	China Resources Gas Group Ltd. Klasse H	1.736.833	6.298.750	0,06 %
Bank of Communications Co., Ltd. Klasse H	16.908.470	12.545.140	0,12 %	Huatai Securities Co., Ltd. Klasse H	3.153.046	6.276.003	0,06 %
China Taiping Insurance Holdings Co., Ltd.	3.173.223	11.893.548	0,11 %	Fullshare Holdings Ltd.	13.563.880	6.246.398	0,06 %
Anhui Conch Cement Co., Ltd. Klasse H	2.422.273	11.387.376	0,11 %	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co., Ltd. Klasse H	954.299	6.122.075	0,06 %
China Resources Beer Holdings Co., Ltd.	3.126.960	11.220.144	0,10 %	China Railway Group Ltd. Klasse H	7.832.589	5.791.304	0,05 %
Fosun International Ltd.	5.047.257	11.182.696	0,10 %	Beijing Enterprises Holdings Ltd.	966.320	5.735.644	0,05 %
SINA Corp.	110.398	11.074.023	0,10 %	China State Construction International Holdings Ltd.	3.969.692	5.555.426	0,05 %
China CITIC Bank Corp., Ltd. Klasse H	17.480.881	10.957.276	0,10 %	TravelSky Technology Ltd. Klasse H	1.850.258	5.550.324	0,05 %
BYD Co., Ltd. Klasse H	1.255.935	10.941.012	0,10 %	CGN Power Co., Ltd. Klasse H	20.216.589	5.482.605	0,05 %
China Minsheng Banking Corp., Ltd. Klasse H	10.705.707	10.723.099	0,10 %	GF Securities Co., Ltd. Klasse H	2.702.086	5.433.691	0,05 %
ENN Energy Holdings Ltd.	1.482.720	10.574.193	0,10 %	ZTE Corp. Klasse H	1.431.418	5.374.249	0,05 %
New China Life Insurance Co., Ltd. Klasse H	1.498.640	10.237.214	0,10 %	Aluminum Corp. of China Ltd. Klasse H	7.490.186	5.356.087	0,05 %
Sinopharm Group Co., Ltd. Klasse H	2.340.904	10.121.468	0,09 %	Kingsoft Corp., Ltd.	1.559.545	5.186.979	0,05 %
China Communications Construction Co., Ltd. Klasse H	8.639.316	9.813.763	0,09 %	Huaneng Power International, Inc. Klasse H	8.260.037	5.177.514	0,05 %
Guangzhou Automobile Group Co., Ltd. Klasse H	4.131.128	9.787.074	0,09 %	Shimao Property Holdings Ltd.	2.369.716	5.153.336	0,05 %
Semiconductor Manufacturing International Corp.	5.500.800	9.513.619	0,09 %	China National Building Material Co., Ltd. Klasse H	5.647.245	5.049.601	0,05 %
ANTA Sports Products Ltd.	2.064.516	9.362.196	0,09 %	Momo, Inc. ADR	205.599	5.033.063	0,05 %
YY, Inc. ADR	82.691	9.349.044	0,09 %	Nine Dragons Paper Holdings Ltd.	3.109.319	4.979.811	0,05 %
China Gas Holdings Ltd.	3.377.827	9.333.282	0,09 %	China Resources Pharmaceutical Group Ltd.	3.748.500	4.852.675	0,05 %
Weibo Corp. ADR	89.559	9.265.774	0,09 %	China Molybdenum Co., Ltd. Klasse H	7.380.000	4.739.181	0,04 %
China Huarong Asset Management Co., Ltd. Klasse H	19.600.948	9.252.235	0,09 %	China Galaxy Securities Co., Ltd. Klasse H	6.405.301	4.719.601	0,04 %
				Agile Group Holdings Ltd.	3.092.000	4.691.021	0,04 %
				China Railway Construction Corp., Ltd. Klasse H	3.888.509	4.506.657	0,04 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Indien 8,62 % (2016: 8,29 %)							
Housing Development Finance Corp., Ltd.	2.930.483	78.533.409	0,73 %	Bharat Forge Ltd.	411.985	4.706.095	0,04 %
Reliance Industries Ltd.	5.039.640	72.648.510	0,68 %	Marico Ltd.	904.653	4.553.915	0,04 %
Infosys Ltd.	3.437.213	56.072.978	0,52 %	Bosch Ltd.	14.408	4.533.630	0,04 %
Tata Consultancy Services Ltd.	895.352	37.874.747	0,35 %	Ashok Leyland Ltd.	2.289.219	4.293.126	0,04 %
Maruti Suzuki India Ltd.	205.890	31.403.406	0,29 %	Havells India Ltd.	474.777	4.179.659	0,04 %
Axis Bank Ltd.	3.252.865	28.677.093	0,27 %	Britannia Industries Ltd.	55.482	4.098.684	0,04 %
ITC Ltd.	6.612.134	27.271.071	0,26 %	Mahindra & Mahindra Financial Services Ltd.	529.860	3.921.184	0,04 %
Hindustan Unilever Ltd.	1.258.408	26.857.801	0,25 %	Petronet LNG Ltd.	857.775	3.416.183	0,03 %
ICICI Bank Ltd.	4.619.323	22.742.897	0,21 %	Rural Electrification Corp., Ltd.	1.370.255	3.346.876	0,03 %
Tata Motors Ltd.	3.076.829	20.786.161	0,19 %	Tata Power Co., Ltd.	2.219.004	3.247.111	0,03 %
Bharti Airtel Ltd.	2.333.673	19.403.553	0,18 %	Tata Motors Ltd. Klasse A	759.870	2.902.453	0,03 %
Larsen & Toubro Ltd.	920.877	18.198.962	0,17 %	Cadila Healthcare Ltd.	405.528	2.762.502	0,03 %
Mahindra & Mahindra Ltd.	1.443.232	16.992.501	0,16 %	Glenmark Pharmaceuticals Ltd.	280.417	2.614.267	0,03 %
Sun Pharmaceutical Industries Ltd.	1.854.920	16.563.576	0,16 %	Siemens Ltd.	131.202	2.559.187	0,02 %
State Bank of India	3.358.158	16.310.038	0,15 %	Bharat Heavy Electricals Ltd.	1.744.549	2.532.333	0,02 %
Yes Bank Ltd.	3.278.985	16.187.508	0,15 %	ACC Ltd.	89.945	2.485.809	0,02 %
HCL Technologies Ltd.	1.075.884	15.102.241	0,14 %	IDFC Bank Ltd.	2.790.977	2.369.997	0,02 %
Vedanta Ltd. Foreign	2.865.742	14.841.111	0,14 %	Power Finance Corp., Ltd.	1.233.886	2.348.786	0,02 %
Eicher Motors Ltd.	26.165	12.441.877	0,12 %	Container Corp. Of India Ltd.	75.365	1.634.055	0,02 %
Bharat Petroleum Corp., Ltd.	1.487.814	12.062.884	0,11 %	Vedanta Ltd. - Vorzugsaktien	3.443.936	563.850	0,01 %
Grasim Industries Ltd.	642.035	11.720.138	0,11 %			921.958.167	8,62 %
Indiabulls Housing Finance Ltd.	622.350	11.632.346	0,11 %	Indonesien 2,21 % (2016: 2,62 %)			
UltraTech Cement Ltd.	171.601	11.622.303	0,11 %	Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT	98.051.608	32.087.646	0,30 %
Asian Paints Ltd.	562.996	10.231.881	0,10 %	Bank Central Asia Tbk PT	19.184.250	30.966.285	0,29 %
Wipro Ltd.	2.034.346	9.944.240	0,09 %	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	107.762.400	28.911.379	0,27 %
Hindalco Industries Ltd.	2.266.703	9.735.876	0,09 %	Astra International Tbk PT	39.297.345	24.040.388	0,22 %
Zee Entertainment Enterprises Ltd.	1.026.225	9.346.200	0,09 %	Bank Mandiri Persero Tbk PT	35.868.788	21.149.829	0,20 %
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	1.401.587	8.930.718	0,08 %	Unilever Indonesia Tbk PT	3.004.773	12.380.086	0,12 %
NTPC Ltd.	3.203.545	8.851.125	0,08 %	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	14.683.639	10.714.430	0,10 %
Bajaj Finance Ltd.	319.936	8.822.018	0,08 %	United Tractors Tbk PT	3.231.193	8.430.752	0,08 %
Dr Reddy's Laboratories Ltd.	221.431	8.375.540	0,08 %	Hanjaya Mandala Sampoerna Tbk PT	17.755.006	6.189.879	0,06 %
Titan Co., Ltd.	611.941	8.229.361	0,08 %	Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT	3.631.979	5.875.949	0,05 %
Bajaj Auto Ltd.	157.157	8.203.483	0,08 %	Gudang Garam Tbk PT	925.043	5.713.551	0,05 %
UPL Ltd.	686.061	8.190.490	0,08 %	Kalbe Farma Tbk PT	40.427.275	5.035.717	0,05 %
Hindustan Petroleum Corp., Ltd.	1.178.947	7.739.278	0,07 %	Indofood Sukses Makmur Tbk PT	8.381.548	4.710.470	0,04 %
GAIL India Ltd.	981.303	7.700.986	0,07 %	Semen Indonesia Persero Tbk PT	5.678.539	4.143.544	0,04 %
Oil & Natural Gas Corp., Ltd.	2.471.445	7.552.471	0,07 %	Adaro Energy Tbk PT	28.436.153	3.898.378	0,04 %
Bharti Infratel Ltd.	1.267.959	7.531.967	0,07 %	Matahari Department Store Tbk PT	4.944.754	3.644.558	0,03 %
Godrej Consumer Products Ltd.	471.589	7.388.492	0,07 %	Bank Danamon Indonesia Tbk PT	6.386.247	3.271.378	0,03 %
Tech Mahindra Ltd.	925.124	7.303.591	0,07 %	Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT	14.552.799	3.217.866	0,03 %
Motherson Sumi Systems Ltd.	1.217.044	7.236.194	0,07 %	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	4.691.108	3.077.270	0,03 %
JSW Steel Ltd.	1.678.751	7.113.207	0,07 %	Perusahaan Gas Negara Persero Tbk	21.997.955	2.837.400	0,03 %
Indian Oil Corp., Ltd.	1.119.166	6.819.938	0,06 %	Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT	8.182.200	2.152.973	0,02 %
Piramal Enterprises Ltd.	151.645	6.804.454	0,06 %	Pakuwon Jati Tbk PT	39.922.900	2.015.639	0,02 %
Tata Steel Ltd.	578.529	6.625.744	0,06 %	Surya Citra Media Tbk PT	10.917.632	1.995.631	0,02 %
Shriram Transport Finance Co., Ltd.	283.911	6.552.049	0,06 %	Jasa Marga Persero Tbk PT	4.191.981	1.977.422	0,02 %
United Spirits Ltd.	110.876	6.380.614	0,06 %	Bumi Serpong Damai Tbk PT	15.295.799	1.916.555	0,02 %
Cipla Ltd.	667.576	6.348.653	0,06 %	Tower Bersama Infrastructure Tbk PT	4.028.136	1.907.557	0,02 %
Bajaj Finserv Ltd.	74.642	6.120.814	0,06 %	AKR Corporindo Tbk PT	3.388.300	1.585.827	0,01 %
Hero MotoCorp Ltd.	99.287	5.921.987	0,06 %	Waskita Karya Persero Tbk PT	9.615.000	1.566.180	0,01 %
Lupin Ltd.	424.135	5.894.465	0,06 %	XL Axiata Tbk PT	6.626.928	1.445.786	0,01 %
Dabur India Ltd.	1.016.475	5.569.890	0,05 %			236.860.325	2,21 %
Aurobindo Pharma Ltd.	517.311	5.567.207	0,05 %				
Nestle India Ltd.	44.340	5.454.006	0,05 %				
Vakrangee Ltd.	828.420	5.438.220	0,05 %				
Coal India Ltd.	1.315.232	5.419.388	0,05 %				
LIC Housing Finance Ltd.	584.414	5.159.489	0,05 %				
Idea Cellular Ltd.	2.874.657	4.879.857	0,05 %				
Ambuja Cements Ltd.	1.140.892	4.848.489	0,05 %				
Shree Cement Ltd.	16.624	4.708.972	0,04 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Malaysia 2,32 % (2016: 2,51 %)							
Public Bank Bhd	5.666.076	29.093.417	0,27 %	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV Klasse B	397.962	7.295.139	0,07 %
Tenaga Nasional Bhd	6.594.525	24.865.938	0,23 %	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV Klasse B	686.758	7.090.292	0,07 %
Malayan Banking Bhd	8.081.197	19.568.997	0,18 %	Grupo Bimbo SAB de CV	3.145.290	7.004.180	0,06 %
CIMB Group Holdings Bhd	8.862.600	14.322.067	0,13 %	Coca-Cola Femsa SAB de CV	951.266	6.668.659	0,06 %
Genting Bhd	4.497.000	10.222.980	0,10 %	Alfa SAB de CV Klasse A	6.002.917	6.642.465	0,06 %
Petronas Chemicals Group Bhd	4.712.244	8.965.722	0,08 %	Arca Continental SAB de CV	855.778	5.955.083	0,06 %
Genting Malaysia Bhd	5.711.900	7.946.132	0,07 %	Industrias Penoles SAB de CV	273.485	5.743.528	0,05 %
DiGi.Com Bhd	6.072.040	7.651.941	0,07 %	Grupo Financiero Santander Mexico SAB de CV Klasse B	3.616.423	5.314.056	0,05 %
Axiata Group Bhd	5.270.437	7.149.666	0,07 %	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV Klasse A	2.971.134	5.257.247	0,05 %
Sime Darby Plantation Bhd	4.633.484	6.869.509	0,06 %	Gruma SAB de CV Klasse B	411.281	5.241.518	0,05 %
Petronas Gas Bhd	1.371.300	5.922.986	0,06 %	Mexichem SAB de CV	2.046.089	5.089.732	0,05 %
IHH Healthcare Bhd	4.005.601	5.800.055	0,05 %	Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	1.032.154	5.074.913	0,05 %
Kuala Lumpur Kepong Bhd	925.750	5.718.742	0,05 %	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	449.550	4.463.677	0,04 %
Maxis Bhd	3.731.500	5.541.467	0,05 %	Grupo Carso SAB de CV	925.142	3.063.553	0,03 %
Hong Leong Bank Bhd	1.244.169	5.226.309	0,05 %	El Puerto de Liverpool SAB de CV	378.944	2.408.213	0,02 %
MISC Bhd	2.614.383	4.793.359	0,05 %	Grupo Lala SAB de CV Klasse B	1.236.668	1.747.029	0,02 %
IOI Corp. Bhd	4.229.850	4.745.125	0,04 %	Gentera SAB de CV	2.002.058	1.672.006	0,02 %
IJM Corp. Bhd	5.642.980	4.252.802	0,04 %			310.023.122	2,90 %
Gamuda Bhd	3.430.800	4.204.786	0,04 %	Pakistan 0,08 % (2016: 0,00 %)			
PPB Group Bhd	903.900	3.850.565	0,04 %	Habib Bank Ltd.	1.198.600	1.813.921	0,02 %
Dialog Group Bhd	6.058.550	3.757.588	0,04 %	Oil & Gas Development Co., Ltd.	1.211.300	1.778.257	0,02 %
Malaysia Airports Holdings Bhd	1.657.160	3.599.317	0,03 %	United Bank Ltd.	1.027.800	1.751.032	0,02 %
AMMB Holdings Bhd	3.282.100	3.576.491	0,03 %	MCB Bank Ltd.	864.800	1.653.582	0,01 %
Press Metal Aluminium Holdings Bhd	2.587.500	3.446.164	0,03 %	Lucky Cement Ltd.	230.500	1.076.781	0,01 %
Telekom Malaysia Bhd	2.134.900	3.323.417	0,03 %			8.073.573	0,08 %
Hartalega Holdings Bhd	1.250.400	3.299.795	0,03 %	Peru 0,38 % (2016: 0,39 %)			
Petronas Dagangan Bhd	498.100	2.985.892	0,03 %	Credicorp Ltd.-New York	131.373	27.250.702	0,26 %
Nestle Malaysia Bhd	116.200	2.963.143	0,03 %	Southern Copper Corp.	168.454	7.993.142	0,07 %
YTL Corp. Bhd	8.553.848	2.895.669	0,03 %	Compania de Minas Buenaventura SAA ADR	365.372	5.144.438	0,05 %
British American Tobacco Malaysia Bhd	290.783	2.874.060	0,03 %			40.388.282	0,38 %
HAP Seng Consolidated Bhd	1.182.000	2.789.251	0,03 %	Philippinen 1,12 % (2016: 1,20 %)			
Sime Darby Bhd	4.723.284	2.579.308	0,02 %	Ayala Land, Inc.	14.219.500	12.704.121	0,12 %
AirAsia Bhd	2.796.900	2.315.200	0,02 %	BDO Unibank, Inc.	3.842.509	12.623.627	0,12 %
Sime Darby Property Bhd	4.845.784	2.131.331	0,02 %	SM Prime Holdings, Inc.	16.761.267	12.591.096	0,12 %
Hong Leong Financial Group Bhd	470.623	2.079.254	0,02 %	Ayala Corp.	484.775	9.856.703	0,09 %
Alliance Bank Malaysia Bhd	1.969.083	1.985.139	0,02 %	SM Investments Corp.	471.540	9.351.454	0,09 %
SP Setia Bhd Group	1.975.300	1.952.360	0,02 %	JG Summit Holdings, Inc.	5.565.460	8.038.255	0,08 %
Astro Malaysia Holdings Bhd	2.845.500	1.863.251	0,02 %	Aboitiz Equity Ventures, Inc.	3.911.900	5.798.890	0,05 %
RHB Bank Bhd	1.488.900	1.839.511	0,02 %	Universal Robina Corp.	1.697.220	5.133.819	0,05 %
Westports Holdings Bhd	1.850.900	1.692.199	0,02 %	PLDT, Inc.	164.415	4.874.483	0,05 %
IOI Properties Group Bhd	3.396.500	1.552.638	0,02 %	GT Capital Holdings, Inc.	170.695	4.417.827	0,04 %
YTL Power International Bhd	4.228.420	1.347.828	0,01 %	Jollibee Foods Corp.	834.220	4.227.918	0,04 %
Sapura Energy Bhd	7.469.385	1.310.418	0,01 %	Metro Pacific Investments Corp.	28.292.800	3.882.325	0,04 %
UMW Holdings Bhd	967.300	1.242.886	0,01 %	Bank of the Philippine Islands	1.462.514	3.167.022	0,03 %
Genting Plantations Bhd	467.681	1.213.405	0,01 %	Manila Electric Co.	447.490	2.945.617	0,03 %
Felda Global Ventures Holdings Bhd	2.731.269	1.140.560	0,01 %	Alliance Global Group, Inc.	8.329.761	2.669.795	0,02 %
RHB Capital Bhd	1.161.678	13.901	0,00 %	Metropolitan Bank & Trust Co.	1.206.600	2.450.906	0,02 %
		248.482.541	2,32 %	Globe Telecom, Inc.	64.240	2.445.032	0,02 %
Mexiko 2,90 % (2016: 3,53 %)				Aboitiz Power Corp.	2.886.309	2.402.367	0,02 %
America Movil SAB de CV	65.476.181	56.689.914	0,53 %	Megaworld Corp.	22.327.800	2.307.922	0,02 %
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	3.790.797	35.830.012	0,33 %	DMCI Holdings, Inc.	7.987.650	2.304.130	0,02 %
Grupo Financiero Banorte SAB de CV Klasse O	4.849.307	26.750.439	0,25 %	Security Bank Corp.	433.660	2.183.937	0,02 %
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	10.192.184	25.119.067	0,23 %	International Container Terminal Services, Inc.	1.008.230	2.130.775	0,02 %
Grupo Mexico SAB de CV	7.402.381	24.565.516	0,23 %	Robinsons Land Corp.	3.261.400	1.391.583	0,01 %
Cemex SAB de CV	28.212.267	21.210.930	0,20 %			119.899.604	1,12 %
Grupo Televisa SAB	4.760.244	17.918.886	0,17 %				
Fibra Uno Administracion SA de CV REIT	5.844.048	8.688.935	0,08 %				
Grupo Financiero Inbursa SAB de CV Klasse O	4.569.619	7.518.133	0,07 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Polen 1,32 % (2016: 1,14 %)							
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	1.806.451	23.035.525	0,21 %	Inter RAO UES PJSC	62.685.000	3.702.004	0,03 %
Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	584.889	17.842.245	0,17 %	PhosAgro PJSC GDR	225.780	3.465.723	0,03 %
Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	1.178.819	14.302.696	0,13 %	Magnitogorsk Iron & Steel Works PJSC	4.459.000	3.242.135	0,03 %
Bank Pekao SA	303.606	11.314.889	0,11 %	Transneft PJSC - Vorzugsaktien	870	2.718.597	0,03 %
KGHM Polska Miedz SA	274.872	8.796.410	0,08 %	RusHydro PJSC	206.227.076	2.611.007	0,02 %
Bank Zachodni WBK SA	66.870	7.625.543	0,07 %	Novatek PJSC GDR	20.737	2.492.587	0,02 %
LPP SA	2.538	6.507.880	0,06 %			351.511.901	3,29 %
Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo SA	3.421.023	6.192.654	0,06 %	Südafrika 7,02 % (2016: 7,07 %)			
PGE Polska Grupa Energetyczna SA	1.626.760	5.641.320	0,05 %	Naspers Ltd. Klasse N	850.849	237.179.313	2,22 %
CCC SA	54.876	4.500.881	0,04 %	Standard Bank Group Ltd.	2.515.838	39.761.621	0,37 %
Alior Bank SA	172.272	3.941.414	0,04 %	Sasol Ltd.	1.075.600	37.201.164	0,35 %
mBank SA	29.082	3.891.772	0,04 %	MTN Group Ltd.	3.295.589	36.363.284	0,34 %
CD Projekt SA	133.227	3.719.068	0,03 %	FirstRand Ltd.	6.542.692	35.540.875	0,33 %
Bank Millennium SA	1.226.785	3.156.285	0,03 %	Barclays Africa Group Ltd.	1.328.553	19.530.158	0,18 %
Cyfrowy Polsat SA	419.719	3.002.824	0,03 %	Remgro Ltd.	1.013.629	19.322.815	0,18 %
Grupa Lotos SA	179.323	2.977.707	0,03 %	Sanlam Ltd.	2.744.229	19.284.970	0,18 %
Jastrzebska Spolka Weglowa SA	98.518	2.729.460	0,03 %	Aspen Pharmacare Holdings Ltd.	747.882	16.763.914	0,16 %
Orange Polska SA	1.335.488	2.225.301	0,02 %	Bid Corp., Ltd.	656.512	15.961.514	0,15 %
PLAY Communications SA	228.627	2.224.554	0,02 %	Shoprite Holdings Ltd.	877.547	15.678.887	0,15 %
Dino Polska SA	96.975	2.199.157	0,02 %	Vodacom Group Ltd.	1.179.470	13.879.256	0,13 %
Tauron Polska Energia SA	2.162.485	1.898.118	0,02 %	NEPI Rockcastle plc	724.641	12.500.935	0,12 %
Grupa Azoty SA	89.976	1.802.213	0,02 %	Tiger Brands Ltd.	313.938	11.664.901	0,11 %
Bank Handlowy w Warszawie SA	62.497	1.472.676	0,01 %	Bidvest Group Ltd.	625.769	11.023.745	0,10 %
		141.000.592	1,32 %	Discovery Ltd.	690.699	10.377.223	0,10 %
				Woolworths Holdings Ltd.	1.957.679	10.327.626	0,10 %
				Growthpoint Properties Ltd. REIT	4.207.407	9.400.394	0,09 %
				Mr Price Group Ltd.	469.832	9.293.034	0,09 %
				Nedbank Group Ltd.	441.922	9.141.860	0,08 %
				RMB Holdings Ltd.	1.390.039	8.889.288	0,08 %
				Redefine Properties Ltd. REIT	9.971.105	8.617.999	0,08 %
				AngloGold Ashanti Ltd.	786.339	8.169.541	0,08 %
				Sappi Ltd.	1.072.823	7.755.869	0,07 %
				Gold Fields Ltd.	1.609.741	7.034.490	0,06 %
				Foschini Group Ltd.	440.619	7.023.211	0,06 %
				Resilient Ltd. REIT	569.366	6.951.968	0,06 %
				Capitec Bank Holdings Ltd.	77.597	6.881.939	0,06 %
				Truworths International Ltd.	845.802	6.454.193	0,06 %
				Imperial Holdings Ltd.	298.898	6.329.008	0,06 %
				Exxaro Resources Ltd.	467.062	6.130.660	0,06 %
				SPAR Group Ltd.	368.891	6.058.692	0,06 %
				Mondi Ltd.	231.869	5.979.711	0,06 %
				Life Healthcare Group Holdings Ltd.	2.487.467	5.575.704	0,05 %
				Fortress Ltd. REIT Klasse B	1.594.300	5.434.528	0,05 %
				Rand Merchant Investment Holdings Ltd.	1.316.034	4.879.318	0,04 %
				Hyprop Investments Ltd. REIT	484.356	4.589.254	0,04 %
				Sibanye Gold Ltd.	3.379.460	4.318.502	0,04 %
				Netcare Ltd.	1.973.817	4.009.814	0,04 %
				Investec Ltd.	550.923	3.992.634	0,04 %
				Pick n Pay Stores Ltd.	708.744	3.982.248	0,04 %
				PSG Group Ltd.	179.490	3.914.564	0,04 %
				Kumba Iron Ore Ltd.	127.339	3.899.680	0,04 %
				MMI Holdings Ltd.	1.822.002	3.090.633	0,03 %
				Fortress Ltd. REIT Klasse A	2.057.742	3.084.951	0,03 %
				Anglo American Platinum Ltd.	105.943	3.024.767	0,03 %
				Pioneer Foods Group Ltd.	251.886	2.789.058	0,03 %
				Liberty Holdings Ltd.	253.964	2.552.564	0,02 %
				Coronation Fund Managers Ltd.	422.197	2.520.223	0,02 %
				Brait SE	708.544	2.384.325	0,02 %
				Steinhoff International Holdings NV	5.982.226	2.246.959	0,02 %
				Telkom SA SOC Ltd.	539.198	2.095.816	0,02 %
						750.859.600	7,02 %
Katar 0,55 % (2016: 0,88 %)							
Qatar National Bank QPSC	447.698	15.610.425	0,15 %				
Industries Qatar QSC	294.233	7.917.308	0,07 %				
Masraf Al Rayan QSC	732.020	7.456.876	0,07 %				
Ezdan Holding Group QSC	1.523.823	5.142.170	0,05 %				
Qatar Insurance Co. SAQ	274.454	4.046.727	0,04 %				
Ooredoo QPSC	153.124	3.825.998	0,03 %				
Commercial Bank QPSC	379.851	3.024.624	0,03 %				
Qatar Islamic Bank SAQ	111.300	2.994.893	0,03 %				
Qatar Electricity & Water Co. QSC	54.784	2.722.654	0,02 %				
Qatar Gas Transport Co., Ltd.	504.485	2.228.765	0,02 %				
Doha Bank QPSC	284.129	2.215.613	0,02 %				
Barwa Real Estate Co.	190.769	1.697.121	0,02 %				
		58.883.174	0,55 %				
Russische Föderation 3,29 % (2016: 4,50 %)							
Sberbank of Russia PJSC	20.924.465	81.849.700	0,77 %				
Lukoil PJSC	827.842	47.948.223	0,45 %				
Gazprom PJSC	20.724.990	46.978.504	0,44 %				
Tatneft PJSC	2.962.715	24.639.867	0,23 %				
MMC Norilsk Nickel PJSC	121.933	22.979.752	0,22 %				
Novatek PJSC GDR (XLON)	157.386	18.917.797	0,18 %				
Magnit PJSC GDR (XLON)	510.626	13.965.621	0,13 %				
Rosneft Oil Co. PJSC	2.262.609	11.456.248	0,11 %				
Mobile TeleSystems PJSC ADR	965.424	9.837.671	0,09 %				
VTB Bank PJSC	9.731.554.881	7.998.735	0,07 %				
Surgutneftegas OJSC	13.711.420	6.642.404	0,06 %				
Surgutneftegas OJSC - Vorzugsaktien	13.571.480	6.634.723	0,06 %				
Alosa PJSC	4.929.000	6.426.311	0,06 %				
Severstal PJSC	405.669	6.252.959	0,06 %				
Novolipetsk Steel PJSC	2.363.090	6.042.844	0,06 %				
Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC	2.898.930	5.487.051	0,05 %				
Magnit PJSC GDR	181.563	4.965.748	0,05 %				
Polyus PJSC	53.320	4.255.690	0,04 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Südkorea 15,18 % (2016: 14,37 %)							
Samsung Electronics Co., Ltd.	189.009	449.857.486	4,21 %	Hanon Systems	373.636	4.851.282	0,05 %
SK Hynix, Inc.	1.132.839	80.951.084	0,76 %	Korea Investment Holdings Co., Ltd.	74.351	4.792.134	0,04 %
Samsung Electronics Co., Ltd. - Vorzugsaktien	33.914	66.209.201	0,62 %	Hotel Shilla Co., Ltd.	59.805	4.742.837	0,04 %
KB Financial Group, Inc.	773.323	45.797.654	0,43 %	Hyundai Glovis Co., Ltd.	36.849	4.681.205	0,04 %
POSCO	144.203	44.787.724	0,42 %	BNK Financial Group, Inc.	507.032	4.461.484	0,04 %
Hyundai Motor Co.	306.596	44.677.013	0,42 %	Samsung Securities Co., Ltd.	127.553	4.360.786	0,04 %
NAVER Corp.	54.546	44.327.701	0,41 %	OCI Co., Ltd.	33.425	4.246.229	0,04 %
Shinhan Financial Group Co., Ltd.	831.013	38.346.684	0,36 %	Hyundai Development Co.- Engineering & Construction	117.713	4.238.790	0,04 %
LG Chem Ltd.	89.830	33.983.607	0,32 %	Orion Corp.	42.626	4.160.868	0,04 %
Celltrion, Inc.	158.086	32.649.399	0,31 %	Daelim Industrial Co., Ltd.	52.875	4.069.777	0,04 %
Hyundai Mobis Co., Ltd.	132.582	32.571.170	0,30 %	KCC Corp.	11.142	3.965.347	0,04 %
Hana Financial Group, Inc.	573.218	26.665.038	0,25 %	Lotte Shopping Co., Ltd.	21.274	3.954.534	0,04 %
KT&G Corp.	224.296	24.198.952	0,23 %	Shinsegae, Inc.	14.085	3.947.037	0,04 %
SK Innovation Co., Ltd.	125.235	23.922.804	0,22 %	Hyundai Motor Co. - Vorzugsaktien	44.077	3.857.844	0,04 %
Samsung SDI Co., Ltd.	107.552	20.544.939	0,19 %	Medy-Tox, Inc.	8.286	3.753.100	0,03 %
LG Electronics, Inc.	207.009	20.496.898	0,19 %	LG Innotek Co., Ltd.	27.173	3.655.048	0,03 %
LG Household & Health Care Ltd.	18.269	20.290.356	0,19 %	Hanwha Corp.	90.703	3.516.113	0,03 %
Amorepacific Corp.	62.878	17.884.593	0,17 %	Lotte Corp.	57.733	3.510.736	0,03 %
Korea Electric Power Corp.	490.731	17.487.635	0,16 %	NH Investment & Securities Co., Ltd.	268.426	3.485.238	0,03 %
Samsung C&T Corp.	147.996	17.418.613	0,16 %	CJ E&M Corp.	37.550	3.426.869	0,03 %
SK Holdings Co., Ltd.	61.657	16.299.034	0,15 %	S-1 Corp.	34.200	3.418.243	0,03 %
Kia Motors Corp.	512.137	16.025.958	0,15 %	Samsung Heavy Industries Co., Ltd.	498.873	3.415.757	0,03 %
Samsung Life Insurance Co., Ltd.	136.040	15.820.821	0,15 %	BGF retail Co., Ltd.	17.325	3.398.487	0,03 %
LG Corp.	184.373	15.672.265	0,15 %	Hanssem Co., Ltd.	20.107	3.380.748	0,03 %
Samsung Fire & Marine Insurance Co., Ltd.	59.863	14.930.102	0,14 %	Yuhan Corp.	16.448	3.364.730	0,03 %
NCSOFT Corp.	33.886	14.164.668	0,13 %	Kumho Petrochemical Co., Ltd.	36.071	3.352.543	0,03 %
Samsung SDS Co., Ltd.	68.184	12.738.125	0,12 %	DGB Financial Group, Inc.	338.457	3.335.408	0,03 %
LG Display Co., Ltd.	448.570	12.528.367	0,12 %	Hanwha Life Insurance Co., Ltd.	510.803	3.297.042	0,03 %
Samsung Biologics Co., Ltd.	32.249	11.175.918	0,10 %	LG Chem Ltd. - Vorzugsaktien	14.010	3.258.596	0,03 %
Woori Bank	728.815	10.722.373	0,10 %	ING Life Insurance Korea Ltd.	64.289	3.206.793	0,03 %
Lotte Chemical Corp.	30.184	10.375.706	0,10 %	Korean Air Lines Co., Ltd.	93.271	2.949.160	0,03 %
Samsung Electro-Mechanics Co., Ltd.	109.427	10.221.568	0,10 %	Hyundai Department Store Co., Ltd.	28.264	2.758.944	0,03 %
E-MART, Inc.	40.327	10.208.413	0,10 %	Cheil Worldwide, Inc.	136.637	2.705.810	0,03 %
SK Telecom Co., Ltd.	39.063	9.742.488	0,09 %	Amorepacific Corp. - Vorzugsaktien	17.371	2.693.556	0,03 %
S-Oil Corp.	88.086	9.626.885	0,09 %	Hanmi Science Co. Ltd	24.644	2.555.214	0,02 %
Coway Co., Ltd.	99.748	9.103.152	0,08 %	GS Engineering & Construction Corp.	94.241	2.491.262	0,02 %
SillaJen, Inc.	102.445	8.947.370	0,08 %	LG Household & Health Care Ltd. - Vorzugsaktien	3.798	2.476.301	0,02 %
Hyundai Steel Co.	156.155	8.547.647	0,08 %	Hanwha Techwin Co., Ltd.	71.835	2.385.441	0,02 %
Kakao Corp.	65.674	8.404.407	0,08 %	Samsung Card Co., Ltd.	60.156	2.225.190	0,02 %
Industrial Bank of Korea	493.703	7.586.207	0,07 %	Korea Gas Corp.	55.127	2.191.074	0,02 %
Korea Zinc Co., Ltd.	16.385	7.545.472	0,07 %	Doosan Bobcat, Inc.	64.507	2.157.163	0,02 %
AMOREPACIFIC Group	56.975	7.504.063	0,07 %	Pan Ocean Co., Ltd.	397.269	1.955.637	0,02 %
Kangwon Land, Inc.	226.704	7.369.389	0,07 %	GS Retail Co., Ltd.	51.805	1.950.158	0,02 %
Hankook Tire Co., Ltd.	143.560	7.321.821	0,07 %	Hyundai Wia Corp.	31.946	1.939.648	0,02 %
Celltrion Healthcare Co., Ltd.	68.518	6.950.684	0,06 %	CJ Logistics Corp.	14.595	1.908.645	0,02 %
Hyundai Robotics Co., Ltd.	19.105	6.799.313	0,06 %	Dongsuh Cos, Inc.	67.772	1.842.198	0,02 %
Hanmi Pharm Co., Ltd.	12.014	6.553.805	0,06 %	SK Networks Co., Ltd.	274.705	1.706.402	0,02 %
DB Insurance Co., Ltd.	95.038	6.320.775	0,06 %	Ottogi Corp.	2.203	1.658.604	0,02 %
Hanwha Chemical Corp.	210.934	6.226.252	0,06 %	KEPCO Plant Service & Engineering Co., Ltd.	43.133	1.635.794	0,02 %
Mirae Asset Daewoo Co., Ltd.	724.076	6.215.738	0,06 %	KT Corp.	52.592	1.486.066	0,01 %
Hyundai Motor Co. New - Vorzugsaktien	65.196	6.211.753	0,06 %	Daewoo Engineering & Construction Co., Ltd.	258.909	1.431.733	0,01 %
Korea Aerospace Industries Ltd.	135.486	6.005.148	0,06 %	Doosan Heavy Industries & Construction Co., Ltd.	95.773	1.373.234	0,01 %
Netmarble Games Corp.	33.554	5.908.112	0,06 %	Posco Daewoo Corp.	63.913	1.083.575	0,01 %
GS Holdings Corp.	97.609	5.671.178	0,05 %	BGF Co., Ltd.	32.340	460.684	0,00 %
Hyundai Heavy Industries Co., Ltd.	59.885	5.621.823	0,05 %	KT Corp. ADR	18.248	284.851	0,00 %
Hyundai Marine & Fire Insurance Co., Ltd.	124.268	5.455.697	0,05 %				
Hyosung Corp.	41.186	5.366.818	0,05 %				
CJ CheilJedang Corp.	15.631	5.343.932	0,05 %				
Hyundai Engineering & Construction Co., Ltd.	148.251	5.026.866	0,05 %				
CJ Corp.	28.766	4.876.959	0,05 %				
						1.623.617.572	15,18 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Taiwan 11,12 % (2016: 12,15 %)							
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	47823.618	368.819.676	3,45 %	Hiwin Technologies Corp.	410.171	4.438.230	0,04 %
Hon Hai Precision Industry Co., Ltd.	30.316.521	96.985.157	0,91 %	Novatek Microelectronics Corp.	1.133.344	4.322.615	0,04 %
MediaTek, Inc.	2.918.629	28.834.683	0,27 %	Airtac International Group	240.000	4.314.734	0,04 %
Cathay Financial Holding Co., Ltd.	15.874.898	28.539.982	0,27 %	Asia Cement Corp.	4.522.337	4.285.495	0,04 %
Formosa Plastics Corp.	8.036.072	26.653.235	0,25 %	WPG Holdings Ltd.	3.128.491	4.142.095	0,04 %
Largan Precision Co., Ltd.	195.280	26.379.878	0,25 %	Powertech Technology, Inc.	1.390.769	4.112.696	0,04 %
Chunghwa Telecom Co., Ltd.	7.399.668	26.357.673	0,25 %	Wistron Corp.	5.077.090	4.086.103	0,04 %
Nan Ya Plastics Corp.	9.244.410	24.199.457	0,23 %	Inventec Corp.	5.032.255	4.016.199	0,04 %
CTBC Financial Holding Co., Ltd.	33.994.328	23.417.972	0,22 %	Vanguard International Semiconductor Corp.	1.713.000	3.799.183	0,04 %
Fubon Financial Holding Co., Ltd.	12.897.666	21.973.946	0,21 %	Synnex Technology International Corp.	2.755.127	3.754.235	0,03 %
Uni-President Enterprises Corp.	9.396.602	20.840.289	0,19 %	Teco Electric and Machinery Co., Ltd.	3.856.000	3.692.928	0,03 %
China Steel Corp.	24.377.354	20.274.527	0,19 %	Eclat Textile Co., Ltd.	348.191	3.480.916	0,03 %
Formosa Chemicals & Fibre Corp.	5.684.047	19.673.601	0,18 %	Nanya Technology Corp.	1.357.000	3.474.752	0,03 %
Delta Electronics, Inc.	3.800.766	18.327.870	0,17 %	Micro-Star International Co., Ltd.	1.308.000	3.366.863	0,03 %
Mega Financial Holding Co., Ltd.	21.280.865	17.198.609	0,16 %	Giant Manufacturing Co., Ltd.	599.286	3.292.614	0,03 %
Advanced Semiconductor Engineering, Inc.	13.003.034	16.669.716	0,16 %	Realtek Semiconductor Corp.	891.648	3.265.945	0,03 %
Catcher Technology Co., Ltd.	1.286.318	14.177.875	0,13 %	HTC Corp.	1.318.096	3.237.825	0,03 %
Asustek Computer, Inc.	1.343.344	12.617.056	0,12 %	Nien Made Enterprise Co., Ltd.	286.000	3.056.202	0,03 %
First Financial Holding Co., Ltd.	17.640.550	11.589.050	0,11 %	Standard Foods Corp.	1.177.728	2.928.638	0,03 %
E.Sun Financial Holding Co., Ltd.	17.696.731	11.239.418	0,11 %	Feng TAY Enterprise Co., Ltd.	634.036	2.886.969	0,03 %
Taiwan Mobile Co., Ltd.	3.101.128	11.202.556	0,10 %	Phison Electronics Corp.	285.213	2.798.602	0,03 %
United Microelectronics Corp.	23.435.366	11.182.761	0,10 %	Chicony Electronics Co., Ltd.	1.106.269	2.788.117	0,03 %
Quanta Computer, Inc.	5.302.982	11.030.616	0,10 %	Taiwan High Speed Rail Corp.	3.406.000	2.689.685	0,03 %
President Chain Store Corp.	1.112.328	10.615.493	0,10 %	Highwealth Construction Corp.	1.643.180	2.335.686	0,02 %
Formosa Petrochemical Corp.	2.537.750	9.849.627	0,09 %	General Interface Solution Holding Ltd.	346.000	2.313.759	0,02 %
Yuanta Financial Holding Co., Ltd.	19.763.748	9.165.103	0,09 %	TaiMed Biologics, Inc.	359.000	2.231.799	0,02 %
Pegatron Corp.	3.768.737	9.118.372	0,09 %	Evergreen Marine Corp. Taiwan Ltd.	3.946.801	2.168.463	0,02 %
China Development Financial Holding Corp.	26.321.846	8.977.829	0,08 %	Taiwan Business Bank	7.574.740	2.135.594	0,02 %
Taishin Financial Holding Co., Ltd.	18.648.038	8.679.044	0,08 %	China Airlines Ltd.	5.248.224	2.054.600	0,02 %
Taiwan Cooperative Financial Holding Co., Ltd.	15.538.056	8.667.498	0,08 %	Eva Airways Corp.	3.397.116	1.809.375	0,02 %
Taiwan Cement Corp.	6.758.803	8.278.588	0,08 %	Ruentex Development Co., Ltd.	1.674.846	1.798.186	0,02 %
Hua Nan Financial Holdings Co., Ltd.	13.776.183	7.754.123	0,07 %	Zhen Ding Technology Holding Ltd.	816.605	1.797.390	0,02 %
Far EasTone Telecommunications Co., Ltd.	3.069.829	7.582.117	0,07 %	Ruentex Industries Ltd.	1.056.292	1.796.071	0,02 %
Innolux Corp.	17.330.513	7.221.411	0,07 %	Asia Pacific Telecom Co., Ltd.	4.477.000	1.501.435	0,01 %
AU Optronics Corp.	16.739.696	6.975.225	0,07 %	Formosa Taffeta Co., Ltd.	1.380.500	1.452.010	0,01 %
Chailease Holding Co., Ltd.	2.309.175	6.719.914	0,06 %	Ya Hsin Industrial Co., Ltd.	146.498	—	0,00 %
SinoPac Financial Holdings Co., Ltd.	20.648.504	6.709.714	0,06 %			1.188.874.847	11,12 %
Cheng Shin Rubber Industry Co., Ltd.	3.727.139	6.575.425	0,06 %	Thailand 2,25 % (2016: 2,33 %)			
Siliconware Precision Industries Co., Ltd.	3.868.161	6.538.250	0,06 %	PTT PCL Foreign	2.052.385	27.709.402	0,26 %
Win Semiconductors Corp.	678.000	6.447.704	0,06 %	CP ALL PCL Foreign	9.574.763	22.622.177	0,21 %
Hotai Motor Co., Ltd.	525.000	6.245.275	0,06 %	Kasikornbank PCL Foreign	2.663.569	19.533.384	0,18 %
Compal Electronics, Inc.	8.023.201	5.742.702	0,05 %	Airports of Thailand PCL	8.265.555	17.246.325	0,16 %
Far Eastern New Century Corp.	6.347.457	5.716.412	0,05 %	Siam Commercial Bank PCL Foreign	3.558.675	16.379.296	0,15 %
Globalwafers Co., Ltd.	426.000	5.690.307	0,05 %	Advanced Info Service PCL Foreign RG	2.009.622	11.777.778	0,11 %
Pou Chen Corp.	4.342.078	5.624.850	0,05 %	PTT Global Chemical PCL Foreign	4.351.817	11.350.244	0,11 %
Lite-On Technology Corp.	4.109.890	5.607.189	0,05 %	Siam Cement PCL Foreign REG	616.360	9.153.674	0,09 %
Shin Kong Financial Holding Co., Ltd.	15.706.931	5.542.039	0,05 %	PTT Exploration & Production PCL Foreign	2.697.857	8.278.174	0,08 %
Macronix International	3.575.000	5.309.912	0,05 %	Thai Oil PCL	2.193.614	6.966.525	0,07 %
Foxconn Technology Co., Ltd.	1.795.414	5.140.356	0,05 %	Central Pattana PCL Foreign	2.636.977	6.897.892	0,06 %
Chang Hwa Commercial Bank Ltd.	9.203.858	5.118.667	0,05 %	Kasikornbank PCL	862.319	6.138.632	0,06 %
Yageo Corp.	415.000	4.922.795	0,05 %	Minor International PCL Foreign	4.224.152	5.670.655	0,05 %
China Life Insurance Co., Ltd.	4.753.458	4.784.047	0,04 %	Bangkok Dusit Medical Services PCL Klasse F	7.605.964	4.877.712	0,05 %
Advantech Co., Ltd.	663.756	4.695.151	0,04 %	Berli Jucker PCL	2.394.561	4.849.372	0,05 %
Winbond Electronics Corp.	5.805.000	4.574.399	0,04 %	Indorama Ventures PCL	2.931.368	4.789.670	0,04 %
Acer, Inc.	5.512.650	4.473.697	0,04 %	Charoen Pokphand Foods PCL Foreign	5.887.896	4.335.977	0,04 %
				IRPC PCL	18.985.062	4.106.925	0,04 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Anteile	Kosten US-Dollar (\$)		Anteile	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
Tencent Holdings Ltd.	2.032.100	71.047.476	Samsung Electronics Co., Ltd.	26.432	57.816.074
Samsung Electronics Co., Ltd.	33.589	67.011.048	Tencent Holdings Ltd.	1.344.479	57.249.202
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	8.472.000	57.079.955	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	5.676.000	41.011.372
Alibaba Group Holding Ltd. ADR	403.814	54.706.666	Alibaba Group Holding Ltd. ADR	218.492	33.481.934
Naspers Ltd. Klasse N	155.358	30.568.911	Naspers Ltd. Klasse N	104.303	24.278.014
China Construction Bank Corp. Klasse H	30.003.000	24.471.498	China Construction Bank Corp. Klasse H	20.375.774	17.164.919
China Mobile Ltd.	2.187.500	23.690.681	China Mobile Ltd.	1.489.480	15.460.236
Hon Hai Precision Industry Co., Ltd.	5.506.000	18.987.327	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Klasse H	17.842.119	12.970.654
Baidu, Inc. ADR	94.715	18.121.750	Baidu, Inc. ADR	58.909	12.658.421
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. Klasse H	26.246.000	17.729.866	Hon Hai Precision Industry Co., Ltd.	3.431.000	11.614.012
Bank of China Ltd. Klasse H	26.946.000	13.222.424	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. Klasse H	1.210.566	9.968.588
Itau Unibanco Holding SA - Vorzugsaktien	1.076.800	12.955.486	Bank Central Asia Tbk PT	7.184.662	9.583.427
Housing Development Finance Corp., Ltd.	519.569	12.809.236	Itau Unibanco Holding SA - Vorzugsaktien	733.400	9.034.727
ICICI Bank Ltd.	2.570.781	12.600.160	Gazprom PJSC	3.851.790	8.793.944
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. Klasse H	1.838.000	12.165.272	SK Holdings Co., Ltd.	34.871	8.511.571
Grasim Industries Ltd.	711.733	11.717.042	Bank of China Ltd. Klasse H	17.364.814	8.466.943
SillaJen, Inc.	105.292	10.691.262	Housing Development Finance Corp., Ltd.	328.339	8.214.995
SK Hynix, Inc.	196.538	10.474.708	SK Hynix, Inc.	130.412	8.111.797
Sberbank of Russia PJSC	3.748.730	10.417.725	Minh Group Ltd.	1.430.000	7.982.894
Samsung Electronics Co., Ltd. - Vorzugsaktien	6.630	10.253.755	Samsung Electronics Co., Ltd. - Vorzugsaktien	4.207	7.449.605

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	10.546.036.109	7.205.844.722
Derivative Finanzinstrumente	2.140.426	128.174
Barmittel	114.371.550	14.352.317
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	23.644.823	21.320.782
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	16.560.020	15.013.724
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	5.313.754	270.023
Bareinschüsse für Futures	3.359.022	1.201.866
Summe Umlaufvermögen	10.711.425.704	7.258.131.608
Kurzfristige Passiva		
Überziehungskredit	4.852.516	—
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	76.588	32.295
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	549	—
Zahlbare Dividenden	7.789.249	12.293.656
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	3.207.132	12.155.851
Zahlbare Verwaltungsgebühren	2.570.442	1.850.010
Summe kurzfristige Passiva	18.496.476	26.331.812
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	10.692.929.228	7.231.799.796

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	1.547.617.257	1.150.381.295	856.501.441
Nettovermögen	1.288.821.842	1.090.667.284	788.457.558
Anzahl der umlaufenden Anteile	7.661.145	7.803.943	6.436.988
Nettoinventarwert je Anteil	168,23	139,76	122,49
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	1.329.130.895	335.368.168	89.968.664
Anzahl der umlaufenden Anteile	6.578.162	2.274.576	676.009
Nettoinventarwert je Anteil	202,05	147,44	133,09
EUR-Anlegeranteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	465.837.770	493.482.654	525.102.953
Nettovermögen	387.939.518	467.866.949	483.386.684
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.316.271	3.358.206	3.953.662
Nettoinventarwert je Anteil	167,48	139,32	122,26
USD-Anlegeranteile (\$)			
Nettovermögen	2.376.857.037	1.890.254.304	1.702.671.691
Anzahl der umlaufenden Anteile	11.818.392	12.863.330	12.819.871
Nettoinventarwert je Anteil	201,12	146,95	132,82
Thesaurierende GBP-Anteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	1.582.626.619	1.095.162.234	750.836.443
Nettovermögen	1.169.932.858	886.304.600	509.421.571
Anzahl der umlaufenden Anteile	5.091.436	4.828.169	3.667.175
Nettoinventarwert je Anteil	229,78	183,57	138,91
Ausschüttende GBP-Anteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	330.386.298	507.356.299	425.228.673
Nettovermögen	244.233.088	410.598.729	288.505.786
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.259.766	2.602.972	2.364.923
Nettoinventarwert je Anteil	193,87	157,74	121,99
Institutionelle Plus CHF-Ertragsanteile			
Gegenwert in US (\$)	120.857.666	59.285.345	51.412.699
Nettovermögen	117.775.796	60.254.660	51.464.111
Anzahl der umlaufenden Anteile	923.488	621.102	597.015
Nettoinventarwert je Anteil	127,53	97,01	86,20
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	1.716.262.927	711.395.620	660.672.527
Nettovermögen	1.429.266.272	674.468.485	608.186.072
Anzahl der umlaufenden Anteile	9.922.533	5.639.086	5.804.744
Nettoinventarwert je Anteil	144,04	119,61	104,77
Institutionelle Plus USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	811.716.804	800.271.919	544.785.823
Anzahl der umlaufenden Anteile	6.421.949	8.680.778	6.550.081
Nettoinventarwert je Anteil	126,40	92,19	83,17
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	322.464.512	137.997.672	134.535
Nettovermögen	238.377.027	111.680.231	91.278
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.707.588	1.001.917	1.083
Nettoinventarwert je Anteil	139,60	111,47	84,31
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	89.171.443	50.844.286	26.460.609
Nettovermögen	65.918.644	41.147.807	17.952.785
Anzahl der umlaufenden Anteile	508.359	390.036	220.042
Nettoinventarwert je Anteil	129,67	105,50	81,59

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	592.725	249.844
Dividenden	244.455.039	191.368.175
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	2.010.277	2.936.831
Verschiedene Erträge	11.825	24
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	2.646.414.755	561.452.944
Summe Anlageerträge/(-verluste)	2.893.484.621	756.007.818
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	27.653.113	20.816.094
Transaktionsgebühren und Provisionen	3.997.637	3.191.923
Sonstige Aufwendungen	132.073	972.896
Summe Aufwendungen	31.782.823	24.980.913
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	30.942	17.325
Ausgezahlte Ausschüttungen	7.789.249	12.293.656
Ertragsausgleich	4.100.986	(413.705)
Summe Finanzierungskosten	11.921.177	11.897.276
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2.849.780.621	719.129.629
Ausländische Quellensteuer	(27.381.329)	(21.509.558)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)	2.822.399.292	697.620.071

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	2.822.399.292	697.620.071
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	4.479.669.577	3.102.526.681
Rücknahmen	(3.847.052.729)	(2.202.123.014)
Reinvestitionen	6.113.292	—
Summe Kapitalgeschäfte ¹	638.730.140	900.403.667
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	3.461.129.432	1.598.023.738
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)		
Zu Jahresbeginn	7.231.799.796	5.633.776.058
Zum Jahresende	10.692.929.228	7.231.799.796

¹ Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

European Stock Index Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Asset Management, Limited.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Anlageziel

Der Fonds strebt einen langfristigen Kapitalzuwachs durch Nachbildung der Performance des MSCI Europe Index an. Dieser Index umfasst Stammaktien von Unternehmen mit Sitz in Europa.

Portfoliomerkmale

	Fonds	MSCI Europe Index
Anzahl der Aktien	459	446
Mittlere Marktkapitalisierung		
US-Dollar	\$ 51,2 Mrd.	\$ 52,5 Mrd.
Euro	€ 42,6 Mrd.	€ 43,7 Mrd.
Kurs/Gewinn-Verhältnis	18,0x	18,0x
Kurs/Buch-Verhältnis	1,9x	1,9x
Rendite	3,1 %	3,1 %
Eigenkapitalrendite	12,0 %	12,2 %
Ertragszuwachsrate	0,8 %	0,8 %
Portfolioumschlag ¹	-34 %	—
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,30 %	
Anlegeranteile	0,35 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,20 %	
Kurzfristige Reserven	0,0 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	MSCI Europe Index
R ²	1,00	1,00
Beta	1,00	1,00

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI Europe Index
Vereinigtes Königreich	28,0 %	28,0 %
Frankreich	16,8	16,8
Deutschland	15,5	15,5
Schweiz	12,6	12,6
Niederlande	5,6	5,6
Spanien	5,1	5,1
Schweden	4,2	4,2
Italien	3,7	3,7
Dänemark	2,9	2,9
Belgien	1,7	1,7
Finnland	1,5	1,5
Norwegen	1,0	1,0
Sonstige	1,4	1,4

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI Europe Index
Luxusgüter	10,5 %	10,5 %
Grundbedarfsgüter	13,7	13,7
Energie	7,3	7,3
Finanzwerte	21,0	21,0
Gesundheitswesen	12,2	12,2
Industriegüter	13,2	13,2
Informationstechnologie	5,0	5,0
Grundstoffe	8,4	8,3
Immobilien	1,3	1,4
Telekommunikationsdienste	3,8	3,8
Versorger	3,6	3,6

Die 10 grössten Positionen² (% des Gesamtvermögens)

Royal Dutch Shell plc	Integrierter Öl- und Gaskonzern	2,9 %
Nestle SA	Abgepackte Lebensmittel und Fleischerzeugnisse	2,8
HSBC Holdings plc	Diversifizierte Banken	2,2
Novartis AG	Pharma	2,0
Roche Holding AG	Pharma	1,8
Unilever	Körperpflegeprodukte	1,7
British American Tobacco plc	Tabak	1,6
BP plc	Integrierter Öl- und Gaskonzern	1,5
TOTAL SA	Integrierter Öl- und Gaskonzern	1,4
SAP SE	Software	1,1
Zehn grösste Positionen		19,0 %

Anlagefokus

Stil	Wert	Mischung	Wachstum
Marktkapitalisierung	Gross		
	Mittel		
	Klein		

¹ Ein negativer Portfolioumschlag deutet darauf hin, dass der Gesamtwert der Zeichnungen und Rückkäufe über dem Wert der Wertpapiertransaktionen gelegen hat.

² Die aufgeführten Positionen schliessen etwaige vorübergehende Baranlagen und Aktienindexprodukte aus.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

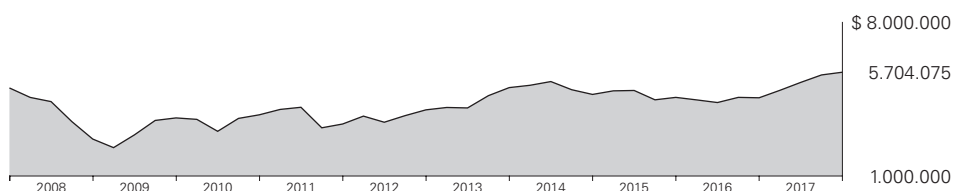
Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

European Stock Index Fund
Benchmark: MSCI Europe Index

In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000



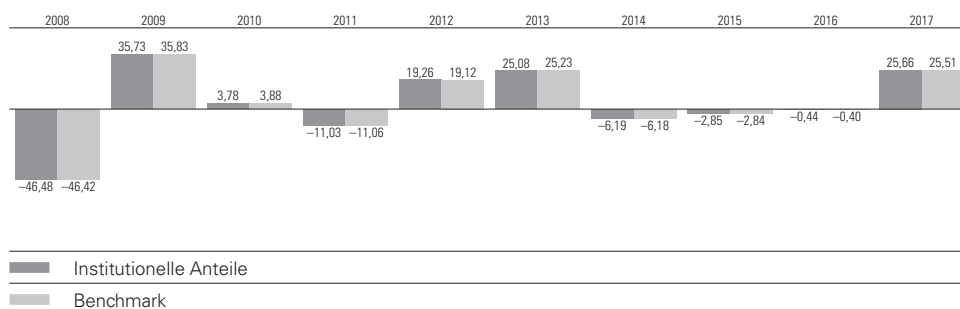
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
— Institutionelle Anteile	25,66 %	7,36 %	1,33 %	\$ 5.704.075
— Benchmark	25,51	7,37	1,34	5.714.652

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Anlegeranteile	25,60 %	7,29 %	1,25 %	\$ 113.197
Benchmark	25,51	7,37	1,34	114.293

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von \$ 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile	25,79 %	4,32 %	\$ 237.198.000
Benchmark	25,51	4,20	236.136.256

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,15 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,09 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,28 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



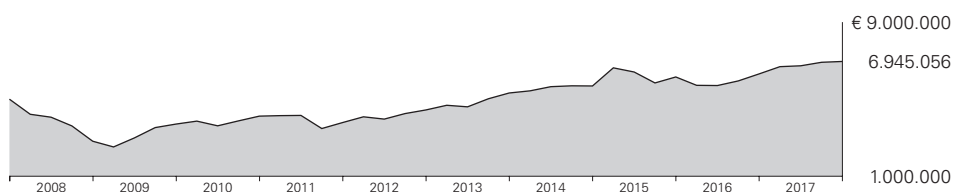
¹ 19. Dezember 2013.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

European Stock Index Fund
Benchmark: MSCI Europe Index

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



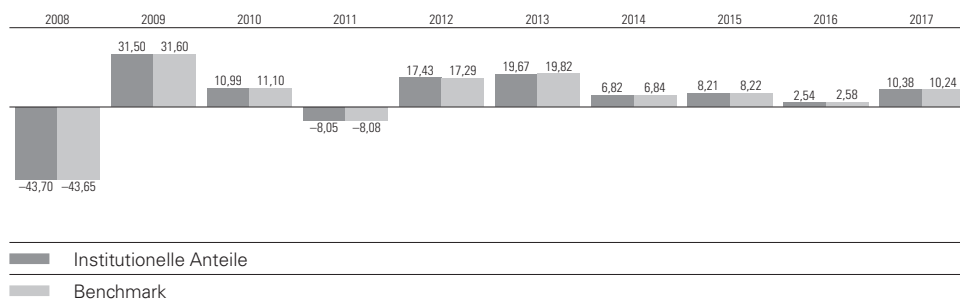
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
— Institutionelle Anteile	10,38 %	9,38 %	3,34 %	€ 6.945.056
— Benchmark	10,24	9,40	3,36	6.957.947

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Anlegeranteile	10,32 %	9,32 %	3,26 %	€ 137.807
Benchmark	10,24	9,40	3,36	139.159

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile	10,49 %	7,90 %	€ 272.539.000
Benchmark	10,24	7,78	271.299.342

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,14 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,08 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,25 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



¹ 6. Dezember 2013.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Aktien 99,56 % (2016: 99,90 %)				LVMH Moët Hennessy Louis			
Österreich 0,40 % (2016: 0,31 %)				Vuitton SE			
Erste Group Bank AG	165.934	7.194.049	0,13 %		153.883	45.345.676	0,85 %
OMV AG	80.550	5.109.952	0,10 %	Airbus SE	320.664	31.959.426	0,60 %
Voestalpine AG	64.062	3.834.359	0,07 %	AXA SA	1.070.970	31.809.724	0,60 %
Raiffeisen Bank International AG	81.394	2.951.685	0,06 %	Vinci SA	278.309	28.456.572	0,54 %
ANDRITZ AG	39.517	2.234.278	0,04 %	Danone SA	332.839	27.957.131	0,53 %
		21.324.323	0,40 %	Schneider Electric SE	312.647	26.602.723	0,50 %
				Societe Generale SA	423.444	21.889.700	0,41 %
Belgien 1,73 % (2016: 1,86 %)				Kering	41.764	19.709.033	0,37 %
Anheuser-Busch InBev SA	420.388	47012.202	0,89 %	Orange SA	1.099.590	19.112.611	0,36 %
KBC Group NV	138.532	11.829.093	0,22 %	Safran SA	184.546	19.037.900	0,36 %
Solvay SA	41.258	5.741.988	0,11 %	Pernod Ricard SA	117.008	18.539.398	0,35 %
UCB SA	69.487	5.522.059	0,10 %	L'Oreal SA (Prime De Fidelite)	80.065	17.781.472	0,33 %
Ageas	102.701	5.021.111	0,10 %	Air Liquide SA (Prime De Fidelite)	140.134	17.677.069	0,33 %
Umicore SA	105.742	5.009.798	0,10 %	Essilor International Cie Generale			
Groupe Bruxelles Lambert SA	45.126	4.876.315	0,09 %	d'Optique SA	114.808	15.847.173	0,30 %
Proximus SADP	83.850	2.753.792	0,05 %	Cie de Saint-Gobain	277.372	15.314.480	0,29 %
Telenet Group Holding NV	29.771	2.076.660	0,04 %	Vivendi SA	568.313	15.300.086	0,29 %
Colruyt SA	33.276	1.732.571	0,03 %	Unibail-Rodamco SE REIT	55.318	13.949.429	0,26 %
		91.575.589	1,73 %	Cie Generale des Etablissements			
				Michelin	94.533	13.570.745	0,26 %
Dänemark 2,86 % (2016: 2,61 %)				Air Liquide SA	96.508	12.173.909	0,23 %
Novo Nordisk A/S Klasse B	1.028.677	55.495.203	1,05 %	L'Oreal SA (XPAR)	53.832	11.955.439	0,23 %
Danske Bank A/S	415.616	16.194.572	0,30 %	Legrand SA	146.080	11.259.752	0,21 %
Vestas Wind Systems A/S	119.484	8.263.135	0,16 %	Renault SA	106.604	10.741.326	0,20 %
DSV A/S	104.749	8.254.365	0,16 %	Caggemini SE	88.726	10.535.956	0,20 %
Novozymes A/S Klasse B	123.532	7.062.785	0,13 %	Valeo SA	131.636	9.842.926	0,19 %
Carlsberg A/S Klasse B	58.241	6.997.862	0,13 %	Engie SA	560.865	9.654.432	0,18 %
AP Moller-Maersk A/S Klasse B	3.726	6.514.070	0,12 %	Hermes International	17.577	9.418.758	0,18 %
Pandora A/S	59.403	6.471.635	0,12 %	Publicis Groupe SA	114.227	7.770.328	0,15 %
Orsted A/S	104.122	5.687.717	0,11 %	Engie SA (Prime De Fidelite 2019)	450.303	7.751.276	0,15 %
Genmab A/S	32.346	5.368.046	0,10 %	Dassault Systemes SE	72.213	7.681.937	0,14 %
Coloplast A/S Klasse B	65.323	5.199.165	0,10 %	STMicroelectronics NV	349.788	7.646.563	0,14 %
Chr Hansen Holding A/S	55.364	5.196.737	0,10 %	Atos SE	52.040	7.583.117	0,14 %
ISS A/S	91.426	3.543.266	0,07 %	Carrefour SA	322.883	6.994.431	0,13 %
AP Moller-Maersk A/S Klasse A	1.946	3.251.494	0,06 %	Veolia Environnement SA	266.023	6.796.095	0,13 %
TDC A/S	451.149	2.774.387	0,05 %	Peugeot SA	323.235	6.580.924	0,12 %
H Lundbeck A/S	39.479	2.005.659	0,04 %	Thales SA	58.198	6.281.188	0,12 %
William Demant Holding A/S	66.393	1.857.813	0,03 %	Bouygues SA	117.752	6.123.887	0,12 %
Tryg A/S	65.929	1.650.245	0,03 %	Klepierre SA REIT	123.025	5.416.462	0,10 %
		151.788.156	2,86 %	Accor SA	103.188	5.328.050	0,10 %
				Credit Agricole SA (Prime De			
Finnland 1,47 % (2016: 1,53 %)				Fidelite)	318.047	5.270.369	0,10 %
Nokia OYJ	3.229.309	15.099.975	0,28 %	Gecina SA REIT	26.407	4.880.096	0,09 %
Sampo OYJ Klasse A	247.890	13.633.117	0,26 %	Arkema SA	37.854	4.615.964	0,09 %
Kone OYJ Klasse B	185.216	9.959.402	0,19 %	Credit Agricole SA (XPAR)	275.098	4.558.660	0,09 %
UPM-Kymmene OYJ	295.362	9.189.518	0,17 %	Teleperformance	31.687	4.545.043	0,09 %
Wartsila OYJ Abp	81.577	5.152.573	0,10 %	Eiffage SA	40.131	4.401.611	0,08 %
Fortum OYJ	248.484	4.923.263	0,09 %	Sodexo SA (Prime De Fidelite)	32.159	4.326.982	0,08 %
Stora Enso OYJ Klasse R	306.663	4.868.145	0,09 %	Natixis SA	519.547	4.115.060	0,08 %
Neste OYJ	70.513	4.517.252	0,09 %	Bureau Veritas SA	146.215	4.001.354	0,08 %
Elisa OYJ	80.353	3.157.083	0,06 %	SCOR SE	94.895	3.822.450	0,07 %
Nokian Renkaat OYJ	64.070	2.908.153	0,06 %	Eurofins Scientific SE	6.189	3.772.357	0,07 %
Metso OYJ	64.330	2.199.235	0,04 %	Suez	205.886	3.625.597	0,07 %
Orion OYJ Klasse B	57.440	2.143.710	0,04 %	Edenred	124.098	3.603.228	0,07 %
		77.751.426	1,47 %	Alstom SA	86.427	3.591.360	0,07 %
				Ingenico Group SA	32.616	3.486.103	0,07 %
Frankreich 16,49 % (2016: 15,95 %)				Iliad SA	14.496	3.477.008	0,07 %
Total SA	1.311.715	72.525.818	1,37 %	Zodiac Aerospace	114.319	3.422.247	0,06 %
Sanofi	626.886	54.086.144	1,02 %	Getlink SE	262.483	3.378.832	0,06 %
BNP Paribas SA	620.364	46.372.085	0,87 %	Faurecia	41.621	3.255.099	0,06 %
				SES SA Klasse A	202.636	3.165.662	0,06 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Aeroports de Paris	16.612	3.161.709	0,06 %	Beiersdorf AG	55.721	6.550.467	0,12 %
Rexel SA	169.151	3.071.122	0,06 %	Symrise AG	68.069	5.854.022	0,11 %
Electricite de France SA (XPAR)	231.090	2.891.476	0,05 %	RWE AG	285.011	5.818.101	0,11 %
Amundi SA	32.898	2.790.952	0,05 %	Brenntag AG	84.796	5.373.202	0,10 %
Ubisoft Entertainment SA	35.355	2.723.018	0,05 %	MTU Aero Engines AG	28.865	5.178.367	0,10 %
Wendel SA	15.521	2.691.272	0,05 %	GEA Group AG	102.395	4.919.466	0,09 %
Bollore SA	475.282	2.584.214	0,05 %	OSRAM Licht AG	54.482	4.902.069	0,09 %
Ipsen SA	20.587	2.461.457	0,05 %	Deutsche Lufthansa AG	128.543	4.741.768	0,09 %
Sodexo SA	18.070	2.431.312	0,05 %	United Internet AG	68.309	4.703.339	0,09 %
Eutelsat Communications SA	95.839	2.220.536	0,04 %	ProSiebenSat.1 Media SE	130.293	4.491.065	0,08 %
Dassault Aviation SA	1.400	2.181.926	0,04 %	Hannover Rueck SE	33.638	4.237.174	0,08 %
Eurazeo SA	23.521	2.174.789	0,04 %	LANXESS AG	50.432	4.014.439	0,08 %
Lagardere SCA	67.041	2.151.841	0,04 %	QIAGEN NV	119.586	3.760.854	0,07 %
CNP Assurances	92.571	2.140.371	0,04 %	Volkswagen AG	18.166	3.679.977	0,07 %
Fonciere Des Regions REIT	18.542	2.103.619	0,04 %	Uniper SE	112.202	3.503.036	0,07 %
BioMerieux	22.748	2.040.217	0,04 %	Evonik Industries AG	91.467	3.445.479	0,07 %
Imerys SA	19.879	1.874.805	0,04 %	KION Group AG	38.755	3.349.734	0,06 %
Casino Guichard Perrachon SA	30.787	1.869.154	0,03 %	Zalando SE	62.333	3.301.984	0,06 %
ICADE REIT	18.314	1.801.760	0,03 %	HUGO BOSS AG	35.404	3.015.881	0,06 %
Societe BIC SA	16.229	1.786.250	0,03 %	Innogy SE	75.444	2.960.131	0,06 %
Remy Cointreau SA	12.226	1.695.653	0,03 %	Bayerische Motoren Werke AG - Vorzugsaktien	30.163	2.703.441	0,05 %
JCDecaux SA	40.304	1.626.383	0,03 %	K+S AG	106.137	2.645.210	0,05 %
SEB SA	6.882	1.276.360	0,02 %	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	23.611	2.604.423	0,05 %
L'Oreal SA (Prime De Fidelite 2018)	5.181	1.150.638	0,02 %	Drillisch AG	28.776	2.378.367	0,04 %
SEB SA (XPAR)	5.300	982.957	0,02 %	MAN SE	19.937	2.283.909	0,04 %
Electricite de France SA (Prime De Fidelite)	77.418	968.680	0,02 %	Telefonica Deutschland Holding AG	423.991	2.131.212	0,04 %
Credit Agricole SA Prime	37.938	628.672	0,01 %	Fuchs Petrolub SE - Vorzugsaktien	39.684	2.108.625	0,04 %
Electricite de France SA	6.929	86.698	0,00 %	Axel Springer SE	26.959	2.108.412	0,04 %
		875.264.074	16,49 %	METRO AG	98.516	1.969.662	0,04 %
Deutschland 15,39 % (2016: 14,72 %)				Hochtief AG	10.888	1.929.768	0,04 %
SAP SE	542.226	60.845.760	1,15 %	RTL Group SA	21.370	1.721.090	0,03 %
Siemens AG	422.166	58.880.724	1,11 %	Schaeffler AG - Vorzugsaktien	90.514	1.606.970	0,03 %
Allianz SE	248.116	57.055.068	1,08 %			816.878.526	15,39 %
Bayer AG	456.223	56.974.588	1,07 %	Irland 0,45 % (2016: 0,38 %)			
BASF SE	506.391	55.784.737	1,05 %	Kerry Group plc Klasse A	87.041	9.772.511	0,18 %
Daimler AG	531.271	45.166.875	0,85 %	Paddy Power Betfair plc	43.786	5.215.760	0,10 %
Deutsche Telekom AG	1.838.404	32.660.784	0,62 %	Bank of Ireland Group plc	509.282	4.338.917	0,08 %
Deutsche Post AG	535.339	25.552.694	0,48 %	AIB Group plc	453.476	2.994.937	0,06 %
Linde AG	102.384	23.930.798	0,45 %	Ryanair Holdings plc	83.576	1.510.389	0,03 %
Deutsche Bank AG	1.138.635	21.705.457	0,41 %			23.832.514	0,45 %
Adidas AG	103.841	20.842.313	0,39 %	Italien 3,66 % (2016: 3,29 %)			
Volkswagen AG - Vorzugsaktien Klasse Preferre	102.147	20.416.444	0,38 %	Enel SpA	4.488.149	27.647.464	0,52 %
Bayerische Motoren Werke AG	182.706	19.049.926	0,36 %	Intesa Sanpaolo SpA	7.434.663	24.729.295	0,47 %
Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen	85.593	18.577.498	0,35 %	Eni SpA	1.404.682	23.277.041	0,44 %
Fresenius SE & Co. KGaA	230.225	17.988.873	0,34 %	UniCredit SpA	1.105.446	20.681.197	0,39 %
Infineon Technologies AG	628.400	17.230.896	0,32 %	Assicurazioni Generali SpA	692.456	12.638.818	0,24 %
Continental AG	60.593	16.374.655	0,31 %	Fiat Chrysler Automobiles NV	592.150	10.601.811	0,20 %
E.ON SE	1.219.327	13.266.825	0,25 %	Atlantia SpA	250.088	7.904.045	0,15 %
Vonovia SE	266.617	13.251.161	0,25 %	CNH Industrial NV	565.806	7.589.120	0,14 %
Henkel AG & Co. KGaA - Vorzugsaktien	99.099	13.131.438	0,25 %	Ferrari NV	67.757	7.115.160	0,13 %
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA	118.088	12.447.210	0,23 %	Snam SpA	1.269.521	6.219.718	0,12 %
Deutsche Börse AG	106.742	12.407.417	0,23 %	Luxtotta Group SpA	93.752	5.758.334	0,11 %
HeidelbergCement AG	82.759	8.968.775	0,17 %	Telecom Italia SpA	6.514.083	5.635.831	0,11 %
Commerzbank AG	591.934	8.888.483	0,17 %	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	775.815	4.512.664	0,08 %
Deutsche Wohnen SE	196.591	8.606.984	0,16 %	Tenaris SA	261.065	4.125.487	0,08 %
Merck KGaA	71.364	7.691.027	0,15 %	Prysmian SpA	112.374	3.668.983	0,07 %
Wirecard AG	64.873	7.250.106	0,14 %	EXOR NV	59.427	3.646.493	0,07 %
Porsche Automobil Holding SE - Vorzugsaktien	84.822	7.107.390	0,13 %	Mediobanca SpA	320.507	3.640.821	0,07 %
thyssenkrupp AG	240.572	6.995.202	0,13 %	Recordati SpA	59.741	2.658.573	0,05 %
Covestro AG	67.712	6.994.976	0,13 %	Leonardo SpA	219.660	2.616.576	0,05 %
Henkel AG & Co. KGaA	56.977	6.841.798	0,13 %	Davide Campari-Milano SpA	311.642	2.411.846	0,04 %
				Poste Italiane SpA	297.666	2.242.919	0,04 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Telecom Italia SpA (Non CVA)	3.108.402	2.224.611	0,04 %	Enagas SA	124.832	3.578.072	0,07 %
Intesa Sanpaolo SpA (Non CNV)	493.228	1.575.433	0,03 %	Bankinter SA	365.897	3.472.773	0,07 %
UnipolSai Assicurazioni SpA	534.937	1.250.660	0,02 %	International Consolidated Airlines Group SA	349.757	3.039.035	0,06 %
		194.372.900	3,66 %	Bankia SA	633.291	3.031.937	0,06 %
Niederlande 5,72 % (2016: 5,33 %)				Mapfre SA	617.119	1.984.496	0,04 %
Unilever NV	898.694	50.671.570	0,96 %	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	135.041	1.853.457	0,03 %
ING Groep NV	2.141.776	39.413.518	0,74 %	Repsol SA - Rights Issue 5.1.2018	678.701	308.879	0,01 %
ASML Holding NV	214.301	37.351.833	0,70 %			267.637.284	5,04 %
NXP Semiconductors NV	190.833	22.344.636	0,42 %	Schweden 4,21 % (2016: 4,50 %)			
Koninklijke Philips NV	521.175	19.738.582	0,37 %	Nordea Bank AB	1.674.071	20.303.542	0,38 %
Koninklijke Ahold Delhaize NV	704.940	15.520.430	0,29 %	Atlas Copco AB Klasse A	372.713	16.123.963	0,30 %
Heineken NV	143.522	14.981.622	0,28 %	Volvo AB Klasse B	862.452	16.085.059	0,30 %
RELX NV	535.517	12.324.030	0,23 %	Swedbank AB Klasse A	500.207	12.090.500	0,23 %
Akzo Nobel NV	139.730	12.251.864	0,23 %	Svenska Handelsbanken AB Klasse A	843.514	11.559.361	0,22 %
ArcelorMittal	365.516	11.901.088	0,23 %	Investor AB Klasse B	252.246	11.525.524	0,22 %
Koninklijke DSM NV	100.660	9.629.914	0,18 %	Assa Abloy AB Klasse B	549.859	11.443.783	0,22 %
Wolters Kluwer NV	163.998	8.562.464	0,16 %	Telefonaktiebolaget LM Ericsson Klasse B	1.700.617	11.185.127	0,21 %
ABN AMRO Group NV	233.142	7.530.841	0,14 %	Sandvik AB	627.579	11.014.730	0,21 %
NN Group NV	168.914	7.326.289	0,14 %	Hennes & Mauritz AB Klasse B	525.724	10.870.849	0,21 %
Koninklijke KPN NV	1.872.077	6.537.155	0,12 %	Skandinaviska Enskilda Banken AB Klasse A	843.465	9.920.694	0,19 %
Heineken Holding NV	64.271	6.366.299	0,12 %	Essity AB Klasse B	336.225	9.568.296	0,18 %
Aegon NV	979.853	6.253.669	0,12 %	Atlas Copco AB Klasse B	212.183	8.153.010	0,15 %
AerCap Holdings NV	78.087	4.108.157	0,08 %	Hexagon AB Klasse B	143.735	7.213.522	0,14 %
Randstad Holding NV	65.697	4.042.270	0,08 %	Telia Co. AB	1.437.875	6.418.850	0,12 %
Altice NV Klasse A	298.671	3.136.702	0,06 %	Boliden AB	149.603	5.127.158	0,10 %
Boskalis Westminster	50.433	1.903.399	0,04 %	SKF AB Klasse B	208.931	4.649.432	0,09 %
Koninklijke Vopak NV	38.864	1.706.645	0,03 %	Kinnevik AB Klasse B	127.861	4.330.486	0,08 %
		303.602.977	5,72 %	Electrolux AB	132.938	4.291.360	0,08 %
Norwegen 1,04 % (2016: 1,05 %)				Swedish Match AB	100.142	3.953.086	0,07 %
Statoil A.S.A	637.872	13.663.088	0,26 %	Skanska AB Klasse B	189.217	3.928.781	0,07 %
DNB A.S.A	539.736	10.036.720	0,19 %	Alfa Laval AB	160.981	3.810.457	0,07 %
Telenor A.S.A	412.641	8.874.000	0,17 %	Securitas AB Klasse B	175.375	3.067.322	0,06 %
Norsk Hydro A.S.A	737.588	5.622.526	0,11 %	Millicom International Cellular SA	35.768	2.420.210	0,05 %
Orkla A.S.A	456.503	4.858.404	0,09 %	Tele2 AB Klasse B	196.375	2.417.661	0,05 %
Yara International A.S.A	98.241	4.524.490	0,08 %	Lundin Petroleum AB	101.626	2.331.037	0,04 %
Marine Harvest A.S.A	232.698	3.954.473	0,07 %	Industrivarden AB Klasse C	94.021	2.325.405	0,04 %
Gjensidige Forsikring A.S.A	112.048	2.121.958	0,04 %	Husqvarna AB Klasse B	226.421	2.159.814	0,04 %
Schibsted A.S.A Klasse B	53.839	1.434.943	0,03 %	Getinge AB Klasse B	122.921	1.786.577	0,03 %
		55.090.602	1,04 %	ICA Gruppen AB	44.766	1.628.799	0,03 %
Portugal 0,23 % (2016: 0,24 %)				L E Lundbergforetagen AB Klasse B	21.183	1.585.976	0,03 %
Galp Energia SGPS SA	272.791	5.019.971	0,09 %			223.290.371	4,21 %
EDP-Energias de Portugal SA	1.333.330	4.619.066	0,09 %	Schweiz 12,58 % (2016: 13,70 %)			
Jeronimo Martins SGPS SA	141.112	2.744.199	0,05 %	Nestle SA	1.717.978	147.733.767	2,78 %
Banco Espirito Santo SA	1.505.981	1.732	0,00 %	Novartis AG	1.227.198	103.767.178	1,95 %
		12.384.968	0,23 %	Roche Holding AG	387.775	98.087.776	1,85 %
Spanien 5,04 % (2016: 4,97 %)				UBS Group AG	2.019.393	37.175.896	0,70 %
Banco Santander SA	8.917.680	58.671.050	1,11 %	ABB Ltd.	1.015.648	27.222.910	0,51 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	3.677.653	31.407.486	0,59 %	Cie Financiere Richemont SA	287.409	26.042.293	0,49 %
Iberdrola SA	3.148.519	24.423.591	0,46 %	Zurich Insurance Group AG	83.374	25.375.812	0,48 %
Telefonica SA	2.499.096	24.382.430	0,46 %	Credit Suisse Group AG	1.339.432	23.915.974	0,45 %
Industria de Diseno Textil SA	601.067	20.963.555	0,39 %	Swiss Re AG	173.125	16.211.038	0,31 %
Amadeus IT Group SA Klasse A	241.507	17.431.996	0,33 %	LafargeHolcim Ltd.	252.435	14.234.277	0,27 %
Repsol SA (XMCE)	671.310	11.886.078	0,22 %	Givaudan SA	5.114	11.818.089	0,22 %
CaixaBank SA	1.986.619	9.277.334	0,17 %	Lonza Group AG	41.156	11.119.933	0,21 %
Abertis Infraestructuras SA	383.873	8.550.710	0,16 %	Sika AG	1.192	9.467.501	0,18 %
Aena SME SA	37.161	7.541.275	0,14 %	Geberit AG	20.561	9.053.592	0,17 %
Ferrovial SA	273.491	6.215.121	0,12 %	SGS SA	2.959	7.715.566	0,14 %
Banco de Sabadell SA	2.972.170	5.910.234	0,11 %	Julius Baer Group Ltd.	124.114	7.590.759	0,14 %
Red Electrica Corp. SA	236.070	5.303.777	0,10 %	Swisscom AG	14.072	7.487.257	0,14 %
ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	132.159	5.176.681	0,10 %	Swatch Group AG	17.024	6.942.368	0,13 %
Grifols SA	166.744	4.890.525	0,09 %	Adecco Group AG	89.996	6.884.763	0,13 %
Gas Natural SDG SA	195.967	4.529.855	0,08 %				
Endesa SA	177.560	3.806.937	0,07 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Partners Group Holding AG	9.515	6.522.340	0,12 %	3i Group plc	537.389	6.640.715	0,12 %
Swiss Life Holding AG	17.760	6.287.532	0,12 %	Sage Group plc	596.258	6.436.572	0,12 %
Schindler Holding AG	23.096	5.315.991	0,10 %	Worldpay Group plc	1.106.372	6.375.706	0,12 %
Kuehne + Nagel International AG	29.593	5.238.371	0,10 %	InterContinental Hotels Group plc	99.573	6.356.369	0,12 %
Sonova Holding AG	29.196	4.559.909	0,09 %	Persimmon plc	170.687	6.321.955	0,12 %
Baloise Holding AG	27.222	4.237.637	0,08 %	Intertek Group plc	89.253	6.266.250	0,12 %
Chocoladefabriken Lindt & Sprüngli AG REG	57	4.122.776	0,08 %	Burberry Group plc	238.181	5.773.812	0,11 %
Straumann Holding AG	5.773	4.078.718	0,08 %	Centrica plc	3.066.445	5.695.387	0,11 %
Swiss Prime Site AG	39.124	3.613.299	0,07 %	Land Securities Group plc REIT	412.686	5.627.271	0,11 %
Clariant AG	126.011	3.523.653	0,07 %	Kingfisher plc	1.198.927	5.476.982	0,10 %
Vifor Pharma AG	26.933	3.451.957	0,06 %	Whitbread plc	100.435	5.434.538	0,10 %
Chocoladefabriken Lindt & Sprüngli AG	558	3.406.978	0,06 %	Mondi plc	201.926	5.274.630	0,10 %
EMS-Chemie Holding AG	4.583	3.059.252	0,06 %	Bunzl plc	186.440	5.225.723	0,10 %
Dufry AG	19.614	2.916.438	0,05 %	Randgold Resources Ltd.	51.429	5.155.180	0,10 %
Barry Callebaut AG	1.224	2.553.506	0,05 %	Taylor Wimpey plc	1.825.840	5.097.884	0,10 %
Schindler Holding AG REG	10.741	2.430.365	0,05 %	British Land Co., plc REIT	543.986	5.088.590	0,10 %
Swatch Group AG REG	31.744	2.426.812	0,05 %	TUI AG	242.916	5.060.511	0,10 %
Pargesa Holding SA	22.036	1.910.766	0,04 %	Next plc	82.214	5.032.478	0,09 %
		667.503.049	12,58 %	DCC plc	49.630	5.011.776	0,09 %
Vereinigtes Königreich 28,29 % (2016: 29,46 %)				St James's Place plc	296.553	4.918.247	0,09 %
HSBC Holdings plc	11.100.309	115.157.263	2,17 %	Barratt Developments plc	561.154	4.915.179	0,09 %
British American Tobacco plc	1.266.298	85.957.565	1,62 %	Coca-Cola European Partners plc	122.005	4.868.315	0,09 %
Royal Dutch Shell plc Klasse A	2.485.155	83.372.474	1,57 %	RSA Insurance Group plc	557.079	4.766.448	0,09 %
BP plc	10.908.306	77.130.712	1,45 %	Pearson plc	456.172	4.541.758	0,09 %
Royal Dutch Shell plc Klasse B	2.074.304	70.388.877	1,33 %	ITV plc	2.020.015	4.522.412	0,09 %
Diageo plc	1.390.360	51.252.057	0,97 %	Johnson Matthey plc	107.427	4.468.647	0,08 %
GlaxoSmithKline plc	2.714.122	48.555.963	0,91 %	Smiths Group plc	218.861	4.411.357	0,08 %
AstraZeneca plc	698.752	48.405.573	0,91 %	Segro plc REIT	548.533	4.355.704	0,08 %
Vodafone Group plc	14.726.271	46.814.262	0,88 %	Croda International plc	72.305	4.327.140	0,08 %
Unilever plc	697.148	38.906.226	0,73 %	United Utilities Group plc	379.534	4.258.774	0,08 %
Prudential plc	1.428.196	36.814.109	0,69 %	Berkeley Group Holdings plc	72.406	4.110.845	0,08 %
Lloyds Banking Group plc	39.729.875	36.578.566	0,69 %	GKN plc	947.633	4.094.422	0,08 %
Rio Tinto plc	681.778	36.356.087	0,68 %	Direct Line Insurance Group plc	756.640	3.906.870	0,07 %
Glencore plc	6.756.690	35.646.437	0,67 %	Marks & Spencer Group plc	896.176	3.816.327	0,07 %
Reckitt Benckiser Group plc	368.770	34.515.681	0,65 %	Severn Trent plc	129.633	3.791.306	0,07 %
Shire plc	500.844	26.423.151	0,50 %	WM Morrison Supermarkets plc	1.228.867	3.655.507	0,07 %
Barclays plc	9.404.912	25.839.386	0,49 %	Hargreaves Lansdown plc	145.570	3.548.495	0,07 %
BHP Billiton plc	1.164.111	23.975.585	0,45 %	Weir Group plc	122.226	3.510.194	0,07 %
Imperial Brands plc	528.726	22.644.311	0,43 %	Coca-Cola HBC AG	102.858	3.367.216	0,06 %
National Grid plc	1.883.083	22.291.776	0,42 %	John Wood Group plc	377.257	3.317.173	0,06 %
Standard Chartered plc	1.814.889	19.152.165	0,36 %	Schroders plc	67.761	3.222.895	0,06 %
Compass Group plc	872.539	18.885.233	0,36 %	Hammerson plc REIT	429.930	3.181.285	0,06 %
BT Group plc Klasse A	4.642.074	17.061.579	0,32 %	Royal Mail plc	500.312	3.062.507	0,06 %
CRH plc	462.708	16.643.590	0,31 %	G4S plc	839.961	3.033.807	0,06 %
Anglo American plc	740.252	15.516.319	0,29 %	J Sainsbury plc	917.061	2.994.698	0,06 %
Aviva plc	2.219.379	15.206.471	0,29 %	Antofagasta plc	217.324	2.954.550	0,06 %
RELX plc	586.421	13.795.156	0,26 %	Admiral Group plc	108.880	2.948.694	0,06 %
BAE Systems plc	1.765.981	13.688.573	0,26 %	Travis Perkins plc	139.015	2.946.783	0,06 %
Tesco plc	4.543.321	12.860.457	0,24 %	Meggitt plc	430.668	2.809.230	0,05 %
WPP plc	700.491	12.707.171	0,24 %	IMI plc	149.347	2.693.049	0,05 %
Legal & General Group plc	3.290.781	12.166.233	0,23 %	Investec plc	363.323	2.629.446	0,05 %
Experian plc	514.399	11.384.159	0,21 %	Auto Trader Group plc	541.087	2.582.339	0,05 %
Rolls-Royce Holdings plc	909.754	10.423.772	0,20 %	Fresnillo plc	120.548	2.330.289	0,04 %
Ferguson plc	139.494	10.057.737	0,19 %	Cobham plc	1.300.467	2.221.878	0,04 %
SSE plc	548.447	9.793.234	0,18 %	ConvaTec Group plc	732.854	2.037.262	0,04 %
London Stock Exchange Group plc	172.322	8.841.808	0,17 %	Capita plc	375.617	2.037.037	0,04 %
Standard Life Aberdeen plc	1.487.905	8.787.725	0,17 %	Merlin Entertainments plc	384.456	1.887.344	0,04 %
Old Mutual plc	2.708.991	8.490.849	0,16 %	Mediclinic International plc	210.495	1.849.432	0,03 %
Smith & Nephew plc	484.528	8.442.135	0,16 %	easyJet plc	87.168	1.726.298	0,03 %
Micro Focus International plc	238.757	8.148.748	0,15 %	Babcock International Group plc	138.272	1.319.620	0,02 %
Sky plc	569.930	7.802.245	0,15 %	Rolls-Royce Holdings plc Entitlement	43.931.518	594	0,00 %
Associated British Foods plc	196.821	7.508.239	0,14 %				
Ashtead Group plc	275.097	7.412.978	0,14 %			1.501.362.137	28,29 %
Royal Bank of Scotland Group plc	1.967.497	7.399.057	0,14 %				
Carnival plc	103.764	6.866.741	0,13 %				
						5.283.658.896	99,56 %
						5.283.658.896	99,56 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures (0,00 %) (2016: (0,00 %))				
FTSE 100 Index März 2018	86	8.772.455	113.327	0,00 %
Euro Stoxx 50 März 2018	334	14.186.128	(176.851)	(0,00 %)
			(63.524)	(0,00 %)

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf- betrag)	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte 0,00 % (2016: (0,01 %))							
EUR	4.923.632	USD	(5.814.668)	BNP Paribas	21.03.2018	125.292	0,00 %
EUR	3.339.848	USD	(3.969.393)	UBS	21.03.2018	59.860	0,00 %
EUR	5.179.491	USD	(6.191.357)	Barclays Bank Plc	21.03.2018	57.275	0,00 %
GBP	2.659.680	USD	(3.556.511)	JP Morgan Chase	21.03.2018	50.564	0,00 %
EUR	3.647.230	USD	(4.365.079)	BNP Paribas	21.03.2018	35.005	0,00 %
EUR	4.780.350	USD	(5.732.788)	BNP Paribas	21.03.2018	34.313	0,00 %
GBP	2.843.697	USD	(3.822.541)	JP Morgan Chase	21.03.2018	34.099	0,00 %
GBP	2.040.743	USD	(2.736.547)	Bank of America	21.03.2018	31.122	0,00 %
GBP	2.032.830	USD	(2.733.607)	JP Morgan Chase	21.03.2018	23.329	0,00 %
GBP	2.559.860	USD	(3.449.659)	BNP Paribas	21.03.2018	22.039	0,00 %
EUR	780.902	USD	(927.392)	Barclays Bank Plc	21.03.2018	14.702	0,00 %
EUR	738.171	USD	(876.636)	UBS	21.03.2018	13.907	0,00 %
EUR	283.920	USD	(336.723)	JP Morgan Chase	21.03.2018	5.804	0,00 %
GBP	444.187	USD	(599.475)	UBS	21.03.2018	2.933	0,00 %
GBP	148.050	USD	(198.126)	JP Morgan Chase	21.03.2018	2.661	0,00 %
GBP	174.412	USD	(233.899)	JP Morgan Chase	21.03.2018	2.640	0,00 %
USD	599.268	GBP	(447.630)	BNP Paribas	21.03.2018	(7.811)	(0,00 %)
USD	1.006.879	GBP	(748.300)	Barclays Bank Plc	21.03.2018	(7.970)	(0,00 %)
USD	929.115	EUR	(778.580)	Barclays Bank Plc	21.03.2018	(10.178)	(0,00 %)
USD	1.622.792	EUR	(1.357.360)	Barclays Bank Plc	21.03.2018	(14.752)	(0,00 %)
USD	1.497.740	GBP	(1.116.300)	JP Morgan Chase	21.03.2018	(16.193)	(0,00 %)
USD	2.333.723	EUR	(1.970.650)	JP Morgan Chase	21.03.2018	(43.705)	(0,00 %)
USD	5.595.077	GBP	(4.159.120)	UBS	21.03.2018	(45.547)	(0,00 %)
USD	9.112.858	EUR	(7.668.000)	Bank of America	21.03.2018	(137.957)	(0,00 %)
						231.432	0,00 %
Summe Derivative Finanzinstrumente						167.908	0,00 %

	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva	23.005.759	0,44 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	5.306.832.563	100,00 %

REIT – Real Estate Investment Trust.

Analyse des Gesamtvermögens	US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	5.278.790.581	99,47 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	—	0,00 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	4.868.315	0,09 %
(d) Derivative Finanzinstrumente	167.908	0,00 %
(e) Sonstige Aktiva und Passiva	23.005.759	0,44 %
Gesamtvermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	5.306.832.563	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Anteile	Kosten US-Dollar (\$)		Anteile	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
British American Tobacco plc	297.658	20.588.824	Nestle SA	398.264	33.186.059
Nestle SA	130.699	10.564.594	Novartis AG	293.128	23.988.748
HSBC Holdings plc	916.648	8.087.379	Roche Holding AG	90.437	23.359.619
Total SA	151.129	7.769.710	HSBC Holdings plc	2.503.159	22.822.583
BP plc	1.296.219	7.704.760	British American Tobacco plc	262.775	17.624.724
Micro Focus International plc	258.449	7.617.077	Sanofi	161.174	15.365.548
Roche Holding AG	30.002	7.550.030	Royal Dutch Shell plc Klasse A	517.739	14.539.232
Novartis AG	95.831	7.545.718	Total SA	276.358	14.519.363
Wirecard AG	66.077	7.056.156	BP plc	2.366.331	14.335.840
Royal Dutch Shell plc Klasse A	252.501	6.810.960	Royal Dutch Shell plc Klasse B	488.572	14.068.422
Lloyds Banking Group plc	7.184.022	6.399.864	Bayer AG	106.535	13.692.134
BNP Paribas SA	85.269	6.031.505	Siemens AG	98.357	13.678.859
MTU Aero Engines AG	28.865	5.198.715	SAP SE	125.815	13.297.353
Teleperformance	31.687	4.698.191	Novo Nordisk A/S Klasse B	299.912	13.140.695
Royal Dutch Shell plc Klasse B	166.243	4.651.083	Banco Santander SA	1.968.986	12.933.290
GlaxoSmithKline plc	225.057	4.641.794	Allianz SE	62.562	12.904.841
Reckitt Benckiser Group plc	47.640	4.634.000	GlaxoSmithKline plc	619.149	12.435.097
Novo Nordisk A/S Klasse B	108.955	4.529.389	BASF SE	118.604	11.809.088
Siemens AG	32.581	4.408.943	Unilever NV	209.525	11.644.322
Sanofi	48.098	4.402.647	Anheuser-Busch InBev SA	98.153	11.355.560

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	5.283.658.896	4.920.562.950
Derivative Finanzinstrumente	628.872	471.243
Barmittel	4.044.144	10.950.591
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenkassageschäften	—	145.000
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	14.069.391	12.139.934
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	18.576.390	9.604.426
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	—	1.132.306
Bareinschüsse für Futures	1.544.734	229.485
Summe Umlaufvermögen	5.322.522.427	4.955.235.935
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	460.964	1.157.118
Überziehungskredit	10.541.042	—
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	116.169	—
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	—	216
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	3.274.829	31.800.058
Zahlbare Verwaltungsgebühren	1.296.860	1.164.764
Summe kurzfristige Passiva	15.689.864	34.122.156
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	5.306.832.563	4.921.113.779

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	3.838.736.107	3.607.855.826	3.749.707.142
Nettovermögen	3.196.815.568	3.420.579.188	3.451.815.483
Anzahl der umlaufenden Anteile	158.841.393	187.599.004	194.115.840
Nettoinventarwert je Anteil	20,13	18,23	17,78
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	543.593.477	486.314.500	724.570.199
Anzahl der umlaufenden Anteile	22.502.442	25.297.550	37.525.273
Nettoinventarwert je Anteil	24,16	19,22	19,31
EUR-Anlegeranteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	186.249.048	144.525.994	149.518.092
Nettovermögen	155.104.138	137.023.936	137.639.780
Anzahl der umlaufenden Anteile	7.849.626	7.650.501	7.875.960
Nettoinventarwert je Anteil	19,76	17,91	17,48
USD-Anlegeranteile (\$)			
Nettovermögen	49.633.356	31.721.492	29.365.251
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.091.064	1.678.557	1.546.260
Nettoinventarwert je Anteil	23,74	18,90	18,99
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	666.472.281	645.289.785	1.047.289.642
Nettovermögen	555.023.556	611.794.073	964.088.784
Anzahl der umlaufenden Anteile	4.072.985	4.960.498	8.023.292
Nettoinventarwert je Anteil	136,27	123,33	120,16
Institutionelle Plus USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	22.148.294	5.406.182	2.296.224
Anzahl der umlaufenden Anteile	186.749	57.339	24.271
Nettoinventarwert je Anteil	118,60	94,28	94,61

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	59.827	313.415
Dividenden	187.711.501	197.113.192
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	1.446.645	2.888.402
Verschiedene Erträge	1.315.436	27.627
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	1.060.112.939	(242.391.023)
Summe Anlageerträge/(-verluste)	1.250.646.348	(42.048.387)
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	15.339.911	14.600.069
Transaktionsgebühren und Provisionen	1.382.024	1.325.409
Sonstige Aufwendungen	40.797	2.926
Summe Aufwendungen	16.762.732	15.928.404
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	71.676	34.792
Summe Finanzierungskosten	71.676	34.792
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1.233.811.940	(58.011.583)
Ausländische Quellensteuer	(13.971.956)	(14.967.659)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	1.219.839.984	(72.979.242)

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	1.219.839.984	(72.979.242)
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	1.435.777.897	1.300.077.847
Rücknahmen	(2.269.899.097)	(2.008.731.376)
Summe Kapitalgeschäfte	(834.121.200)	(708.653.529)
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	385.718.784	(781.632.771)
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	4.921.113.779	5.702.746.550
Zum Jahresende	5.306.832.563	4.921.113.779

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Eurozone Stock Index Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Asset Management, Limited.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Anlageziel

Der Fonds strebt langfristiges Kapitalwachstum durch Nachbildung der Performance des MSCI EMU Index an. Dabei handelt es sich um einen nach Marktkapitalisierung gewichteten Index, der sich aus Stammaktien zusammensetzt und 85 % der zugrundeliegenden Marktkapitalisierung der Länder der Eurozone erfassen soll.

Portfoliomerkmale

	Fonds	MSCI EMU Index
Anzahl der Aktien	257	248
Mittlere Marktkapitalisierung		
US-Dollar	\$ 46,9 Mrd.	\$ 48,4 Mrd.
Euro	€ 39,0 Mrd.	€ 40,3 Mrd.
Kurs/Gewinn-Verhältnis	16,3x	16,3x
Kurs/Buch-Verhältnis	1,7x	1,7x
Rendite	2,8 %	2,8 %
Eigenkapitalrendite	11,1 %	11,3 %
Ertragszuwachsrate	5,4 %	5,3 %
Portfolioumschlag ¹	-37 %	—
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,30 %	
Anlegeranteile	0,35 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,20 %	
Kurzfristige Reserven	0,0 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	MSCI EMU Index
R ²	1,00	1,00
Beta	1,00	1,00

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI EMU Index
Frankreich	32,8 %	32,8 %
Deutschland	30,2	30,2
Niederlande	10,9	10,9
Spanien	9,9	9,9
Italien	7,2	7,2
Belgien	3,4	3,4
Finnland	2,9	2,9
Irland	1,5	1,5
Sonstige	1,2	1,2
Zwischensumme	100,0 %	100,0 %

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI EMU Index
Luxusgüter	13,8 %	13,8 %
Grundbedarfsgüter	10,1	10,1
Energie	5,1	5,1
Finanzwerte	20,3	20,3
Gesundheitswesen	7,8	7,8
Industriegüter	15,2	15,2
Informationstechnologie	8,2	8,2
Grundstoffe	8,7	8,7
Immobilien	1,8	1,8
Telekommunikationsdienste	3,9	3,9
Versorger	5,1	5,1

Die 10 grössten Positionen² (% des Gesamtvermögens)

TOTAL SA	Integrierter Öl- und Gaskonzern	2,7 %
SAP SE	Software	2,2
Siemens AG	Diversifizierte Industrietitel	2,2
Banco Santander SA	Banken	2,2
Allianz SE	Mehrspararten-Versicherung	2,1
Bayer AG	Spezialchemikalien	2,1
BASF SE	Rohstoff-Chemie	2,1
Sanofi	Pharma	2,0
Unilever	Körperpflegeprodukte	1,9
Anheuser-Busch InBev SA/NV	Brauer	1,7
Zehn grösste Positionen		21,2 %

Anlagefokus

Stil	Wert	Mischung	Wachstum
Marktkapitalisierung	Gross		
	Mittel		
	Klein		

¹ Ein negativer Portfolioumschlag deutet darauf hin, dass der Gesamtwert der Zeichnungen und Rückkäufe über dem Wert der Wertpapiertransaktionen gelegen hat.

² Die aufgeführten Positionen schliessen etwaige vorübergehende Baranlagen und Aktienindexprodukte aus.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

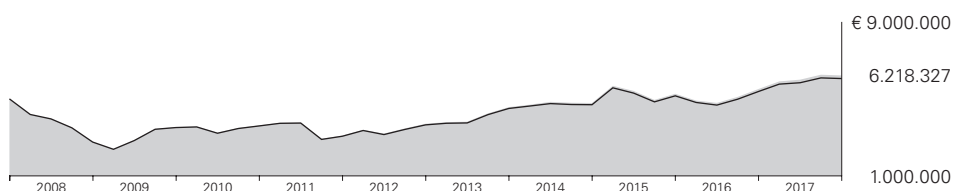
Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

Eurozone Stock Index Fund
Benchmark: MSCI EMU Index

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



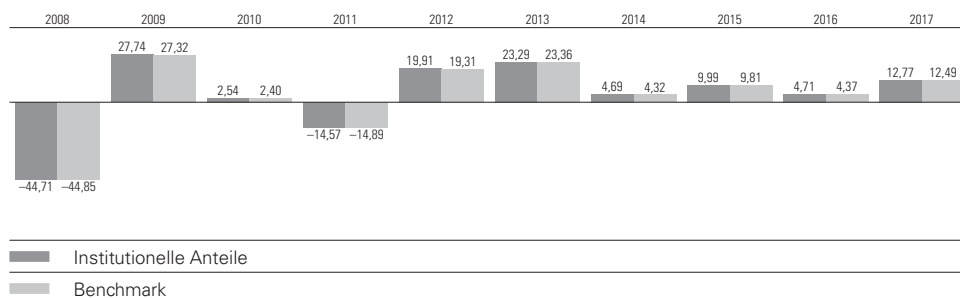
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Institutionelle Anteile	12,77 %	10,89 %	2,20 %	€ 6.218.327
Benchmark	12,49	10,66	1,94	6.056.315

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen			Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Anlegeranteile	12,71 %	10,82 %	7,01 %	€ 171.793
Benchmark	12,49	10,66	6,82	169.303

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen			Endwert einer Anlage von € 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹		
Institutionelle Plus-Anteile	12,88 %	8,42 %		€ 261.754.200
Benchmark	12,49	8,07		258.934.074

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,28 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,22 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,39 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017

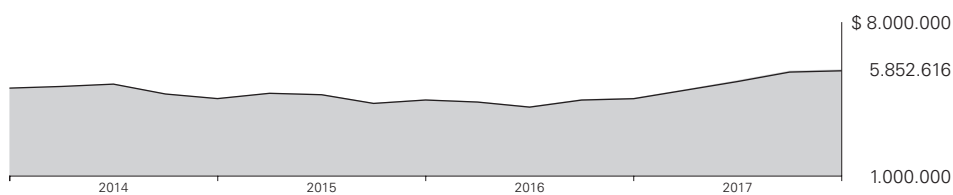


¹ Für Anlegeranteile, 5. Januar 2010; für institutionelle Plus-Anteile, 2. September 2014.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Eurozone Stock Index Fund
Benchmark: MSCI EMU Index

In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 27. Februar 2014–31. Dezember 2017
Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000

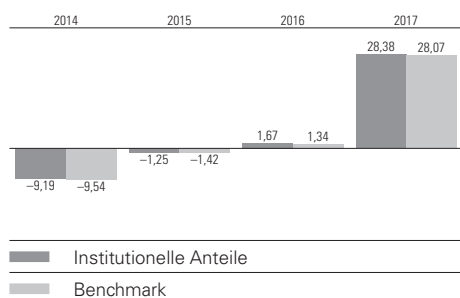
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Anteile	28,38 %	4,18 %	\$ 5.852.616
Benchmark	28,07	3,88	5.786.871

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von \$ 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Anlegeranteile	28,32 %	4,13 %	\$ 116.829
Benchmark	28,07	3,88	115.737

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von \$ 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile	28,51 %	4,28 %	\$ 234.956.400
Benchmark	28,07	3,88	231.458.921

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,31 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,25 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,44 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 27. Februar 2014–31. Dezember 2017



1 27. Februar 2014.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens
Aktien 99,35 % (2016: 99,92 %)							
Österreich 0,79 % (2016: 0,64 %)							
Erste Group Bank AG	128.586	4.642.597	0,27 %	L'Oreal U.K. Limited	47.166	8.723.352	0,50 %
OMV AG	62.524	3.303.143	0,19 %	Air Liquide SA International	80.071	8.411.458	0,48 %
Voestalpine AG	49.190	2.451.876	0,14 %	Legrand SA	113.427	7.280.879	0,42 %
Raiffeisen Bank International AG	63.473	1.916.885	0,11 %	Engie SA	505.136	7.241.125	0,41 %
ANDRITZ AG	31.418	1.479.316	0,08 %	Renault SA	81.995	6.880.200	0,39 %
				Capgemini SE	68.511	6.775.053	0,39 %
		13.793.817	0,79 %	Valeo SA	102.175	6.362.437	0,36 %
				Hermes International	13.493	6.021.251	0,34 %
Belgien 3,36 % (2016: 3,80 %)							
Anheuser-Busch InBev SA	324.922	30.259.986	1,73 %	Publicis Groupe SA	88.384	5.006.954	0,29 %
KBC Group NV	106.929	7.603.721	0,43 %	STMicroelectronics NV	271.798	4.948.083	0,28 %
Solvay SA	31.652	3.668.467	0,21 %	Atos SE	40.372	4.899.142	0,28 %
UCB SA	53.839	3.563.065	0,20 %	Dassault Systemes SE	55.261	4.895.572	0,28 %
Ageas	80.161	3.263.755	0,19 %	Carrefour SA	247.756	4.469.518	0,25 %
Umicore SA	81.218	3.204.456	0,18 %	Veolia Environnement SA	203.832	4.336.526	0,25 %
Groupe Bruxelles Lambert SA	34.306	3.087.197	0,18 %	Peugeot SA	250.841	4.253.009	0,24 %
Proximus SADP	65.289	1.785.654	0,10 %	Thales SA	45.108	4.054.307	0,23 %
Telenet Group Holding NV	22.872	1.328.635	0,08 %	Bouygues SA	91.459	3.961.089	0,23 %
Colruyt SA	25.131	1.089.680	0,06 %	Engie SA (Prime De Fidelite 2019)	273.556	3.921.425	0,22 %
		58.854.616	3,36 %	Credit Agricole SA (XPAR)	275.121	3.796.670	0,22 %
				Accor SA	80.417	3.457.931	0,20 %
Finnland 2,85 % (2016: 3,11 %)							
Nokia OYJ	2.488.717	9.691.064	0,55 %	Klepierre SA REIT	93.912	3.443.283	0,20 %
Sampo OYJ Klasse A	190.393	8.719.999	0,50 %	Gecina SA REIT	20.096	3.092.774	0,18 %
Kone OYJ Klasse B	144.095	6.452.574	0,37 %	Arkema SA	29.105	2.955.613	0,17 %
UPM-Kymmene OYJ	227.617	5.897.556	0,34 %	Teleperformance	24.669	2.946.712	0,17 %
Wartsila OYJ Abp	63.049	3.316.377	0,19 %	Credit Agricole SA	210.340	2.902.692	0,17 %
Fortum OYJ	189.299	3.123.434	0,18 %	Eiffage SA	31.446	2.872.278	0,16 %
Stora Enso OYJ Klasse R	234.864	3.104.902	0,18 %	Natixis SA	402.145	2.652.548	0,15 %
Neste OYJ	54.682	2.917.285	0,16 %	Bureau Veritas SA	113.125	2.578.119	0,15 %
Elisa OYJ	60.842	1.990.750	0,11 %	Electricite de France SA	246.292	2.566.363	0,15 %
Nokian Renkaat OYJ	49.732	1.879.870	0,11 %	SCOR SE	73.911	2.479.344	0,14 %
Orion OYJ Klasse B	44.708	1.389.525	0,08 %	Eurofins Scientific SE	4.715	2.393.334	0,14 %
Metso OYJ	48.799	1.389.308	0,08 %	Sodexo SA	21.075	2.361.454	0,13 %
		49.872.644	2,85 %	Suez	156.815	2.299.692	0,13 %
				Edenred	94.828	2.292.941	0,13 %
Frankreich 32,14 % (2016: 32,48 %)							
Total SA	1.013.333	46.658.918	2,66 %	Alstom SA	65.912	2.280.885	0,13 %
Sanofi	484.467	34.808.954	1,99 %	Ingenico Group SA	25.475	2.267.530	0,13 %
BNP Paribas SA	479.174	29.828.581	1,70 %	Iliad SA	11.295	2.256.176	0,13 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	118.902	29.178.551	1,67 %	Zodiac Aerospace	88.247	2.199.998	0,13 %
Airbus SE	247.682	20.557.606	1,17 %	Getlink SE	199.823	2.142.103	0,12 %
AXA SA	827.034	20.456.686	1,17 %	Faurecia	32.542	2.119.460	0,12 %
Vinci SA	215.209	18.325.046	1,05 %	SES SA Klasse A	155.696	2.025.605	0,12 %
Danone SA	257.379	18.003.661	1,03 %	Aeroports de Paris	12.700	2.012.950	0,11 %
Schneider Electric SE	241.752	17.130.547	0,98 %	Sodexo SA (Prime De Fidelite)	17.491	1.959.867	0,11 %
Societe Generale SA	327.237	14.087.553	0,80 %	Rexel SA	128.701	1.945.959	0,11 %
Kering	32.306	12.696.258	0,72 %	Amundi SA	25.558	1.805.673	0,10 %
Orange SA	850.041	12.304.343	0,70 %	Wendel SA	12.148	1.754.171	0,10 %
Safran SA	142.214	12.217.605	0,70 %	Ubisoft Entertainment SA	26.559	1.703.494	0,10 %
Pernod Ricard SA	90.520	11.944.114	0,68 %	Bolloré SA	375.007	1.698.032	0,10 %
L'Oreal SA	60.240	11.141.388	0,64 %	Ipsen SA	16.175	1.610.545	0,09 %
Air Liquide SA	102.124	10.728.126	0,61 %	Eutelsat Communications SA	75.567	1.458.065	0,08 %
Essilor International Cie Generale d'Optique SA	88.469	10.169.511	0,58 %	CNP Assurances	74.205	1.428.817	0,08 %
Cie de Saint-Gobain	215.057	9.888.321	0,56 %	Eurazeo SA	18.399	1.416.723	0,08 %
Vivendi SA	440.549	9.877.109	0,56 %	Dassault Aviation SA	1.070	1.388.753	0,08 %
Unibail-Rodamco SE REIT	42.601	8.946.210	0,51 %	BioMerieux	17.881	1.335.532	0,08 %
Cie Generale des Etablissements Michelin	73.026	8.730.258	0,50 %	Lagardere SCA	49.454	1.321.905	0,08 %
				Fonciere Des Regions REIT	13.929	1.316.012	0,07 %
				Imerys SA	15.003	1.178.336	0,07 %
				Casino Guichard Perrachon SA	23.255	1.175.773	0,07 %
				ICADE REIT	13.975	1.144.972	0,07 %
				Remy Cointreau SA	9.750	1.126.125	0,06 %
				Societe BIC SA	11.948	1.095.154	0,06 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens
JCDecaux SA	31.173	1.047.569	0,06 %	Drillisch AG	22.820	1.570.701	0,09 %
SEB SA (XPAR)	5.500	849.475	0,05 %	MAN SE	15.225	1.452.465	0,08 %
SEB SA	4.249	656.258	0,04 %	Axel Springer SE	21.005	1.368.056	0,08 %
		562.934.391	32,14 %	Telefonica Deutschland Holding AG	322.045	1.348.080	0,08 %
Deutschland 30,00 % (2016: 29,99 %)				Fuchs Petrolub SE - Vorzugsaktien	30.118	1.332.721	0,08 %
SAP SE	419.202	39.174.427	2,24 %	METRO AG	78.109	1.300.515	0,07 %
Siemens AG	326.248	37893.705	2,16 %	Hochtief AG	8.083	1.193.051	0,07 %
Allianz SE	191.703	36.711.124	2,10 %	RTL Group SA	16.215	1.087.540	0,06 %
Bayer AG	352.619	36.672.376	2,09 %	Schaeffler AG - Vorzugsaktien	69.558	1.028.415	0,06 %
BASF SE	391.850	35.948.319	2,05 %			525.403.321	30,00 %
Daimler AG	410.665	29.075.082	1,66 %	Irland 0,88 % (2016: 0,77 %)			
Deutsche Telekom AG	1.421.141	21.025.781	1,20 %	Kerry Group plc Klasse A	67.583	6.319.010	0,36 %
Deutsche Post AG	413.910	16.452.922	0,94 %	Paddy Power Betfair plc	34.251	3.397.699	0,19 %
Linde AG	78.812	15.340.756	0,88 %	Bank of Ireland Group plc	389.218	2.761.502	0,16 %
Deutsche Bank AG	881.456	13.993.114	0,80 %	AIB Group plc	343.655	1.890.102	0,11 %
Adidas AG	80.300	13.422.145	0,77 %	Ryanair Holdings plc	66.751	1.004.603	0,06 %
Volkswagen AG - Vorzugsaktien	78.755	13.108.770	0,75 %			15.372.916	0,88 %
Bayerische Motoren Werke AG	141.243	12.264.130	0,70 %	Italien 7,14 % (2016: 6,70 %)			
Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen	66.225	11.970.169	0,68 %	Enel SpA	3.467.778	17.789.701	1,02 %
Fresenius SE & Co. KGaA	177.289	11.536.195	0,66 %	Intesa Sanpaolo SpA	5.754.358	15.939.572	0,91 %
Infineon Technologies AG	484.397	11.061.205	0,63 %	Eni SpA	1.085.158	14.975.180	0,85 %
Continental AG	46.899	10.554.620	0,60 %	UniCredit SpA	854.226	13.308.841	0,76 %
Vonovia SE	206.861	8.561.977	0,49 %	Assicurazioni Generali SpA	532.508	8.094.122	0,46 %
E.ON SE	938.761	8.506.113	0,49 %	Fiat Chrysler Automobiles NV	458.855	6.841.528	0,39 %
Henkel AG & Co. KGaA - Vorzugsaktien	76.197	8.408.339	0,48 %	Atlantia SpA	193.428	5.091.025	0,29 %
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA	91.894	8.066.455	0,46 %	CNH Industrial NV	436.171	4.872.030	0,28 %
Deutsche Börse AG	82.305	7.967.124	0,45 %	Ferrari NV	52.361	4.578.969	0,26 %
HeidelbergCement AG	63.489	5.729.882	0,33 %	Snam SpA	970.541	3.959.807	0,23 %
Commerzbank AG	453.937	5.676.482	0,32 %	Luxottica Group SpA	72.353	3.700.856	0,21 %
Deutsche Wohnen SE	151.233	5.513.955	0,31 %	Telecom Italia SpA	4.892.278	3.524.886	0,20 %
Merck KGaA	55.087	4.944.058	0,28 %	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	598.505	2.899.158	0,17 %
Wirecard AG	50.051	4.658.247	0,27 %	Tenaris SA	201.604	2.653.109	0,15 %
Porsche Automobil Holding SE - Vorzugsaktien	65.320	4.558.030	0,26 %	Prysmian SpA	87.804	2.387.391	0,14 %
thyssenkrupp AG	185.769	4.498.396	0,26 %	EXOR NV	46.327	2.367.310	0,13 %
Covestro AG	51.840	4.459.795	0,25 %	Mediobanca SpA	243.991	2.308.155	0,13 %
Henkel AG & Co. KGaA	44.079	4.407.900	0,25 %	Leonardo SpA	174.068	1.726.755	0,10 %
Beiersdorf AG	43.146	4.223.993	0,24 %	Recordati SpA	45.015	1.668.256	0,09 %
Symrise AG	52.655	3.771.151	0,22 %	Davide Campari-Milano SpA	247.162	1.592.959	0,09 %
RWE AG	220.994	3.756.898	0,21 %	Telecom Italia SpA (Non CVA)	2.531.430	1.508.732	0,09 %
Brenntag AG	65.605	3.461.976	0,20 %	Poste Italiane SpA	225.833	1.417.102	0,08 %
MTU Aero Engines AG	22.012	3.288.593	0,19 %	Intesa Sanpaolo SpA-(Non CNV)	390.736	1.039.358	0,06 %
OSRAM Licht AG	42.451	3.180.853	0,18 %	UnipolSai Assicurazioni SpA	415.005	808.015	0,05 %
GEA Group AG	78.004	3.120.940	0,18 %			125.052.817	7,14 %
Deutsche Lufthansa AG	100.093	3.074.857	0,18 %	Niederlande 11,14 % (2016: 10,87 %)			
United Internet AG	52.387	3.003.871	0,17 %	Unilever NV	694.666	32.618.042	1,86 %
ProSiebenSat.1 Media SE	99.369	2.852.387	0,16 %	ING Groep NV	1.656.993	25.393.418	1,45 %
Hannover Rueck SE	25.868	2.713.553	0,15 %	ASML Holding NV	165.599	24.036.695	1,37 %
LANXESS AG	39.303	2.605.396	0,15 %	NXP Semiconductors NV	147.537	14.386.332	0,82 %
QIAGEN NV	92.222	2.415.294	0,14 %	Koninklijke Philips NV	401.234	12.654.920	0,72 %
Volkswagen AG	14.255	2.404.818	0,14 %	Koninklijke Ahold Delhaize NV	546.389	10.018.042	0,57 %
Uniper SE	86.652	2.252.952	0,13 %	Heineken NV	110.493	9.605.157	0,55 %
Evonik Industries AG	70.323	2.206.033	0,13 %	RELX NV	412.006	7.896.095	0,45 %
KION Group AG	30.322	2.182.578	0,12 %	Akzo Nobel NV	107.615	7.858.047	0,45 %
Zalando SE	47.449	2.093.213	0,12 %	ArcelorMittal	283.246	7.680.215	0,44 %
Innogy SE	59.564	1.946.254	0,11 %	Koninklijke DSM NV	77.419	6.167.972	0,35 %
HUGO BOSS AG	27.153	1.926.234	0,11 %	Wolters Kluwer NV	128.725	5.596.963	0,32 %
Bayerische Motoren Werke AG - Vorzugsaktien	23.495	1.753.667	0,10 %	ABN AMRO Group NV	180.388	4.852.437	0,28 %
K+S AG	80.759	1.676.153	0,10 %	NN Group NV	129.853	4.690.290	0,27 %
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	17.946	1.648.520	0,09 %	Koninklijke KPN NV	1.456.047	4.234.185	0,24 %
				Heineken Holding NV	49.079	4.048.527	0,23 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens
Aegon NV	752.192	3.997.901	0,23 %	Banco de Sabadell SA	2.275.970	3.769.006	0,22 %
AerCap Holdings NV	59.514	2.607.455	0,15 %	Red Electrica Corp. SA	184.572	3.453.342	0,20 %
Randstad Holding NV	50.813	2.603.658	0,15 %	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	102.830	3.354.315	0,19 %
Altice NV Klasse A	226.339	1.979.561	0,11 %	Grifols SA	127.124	3.105.004	0,18 %
Boskalis Westminster	38.154	1.199.180	0,07 %	Gas Natural SDG SA	149.344	2.874.872	0,16 %
Koninklijke Vopak NV	29.462	1.077.425	0,06 %	Endesa SA	135.560	2.420.424	0,14 %
		195.202.517	11,14 %	Enagas SA	96.887	2.312.693	0,13 %
Portugal 0,45 % (2016: 0,49 %)				Bankinter SA	285.982	2.260.402	0,13 %
Galp Energia SGPS SA	214.393	3.285.573	0,19 %	Bankia SA	490.039	1.953.785	0,11 %
EDP-Energias de Portugal SA	1.016.683	2.933.130	0,16 %	International Consolidated Airlines Group SA	266.566	1.928.871	0,11 %
Jeronimo Martins SGPS SA	108.339	1.754.550	0,10 %	Mapfre SA	451.646	1.209.508	0,07 %
Banco Espirito Santo SA	694.154	665	0,00 %	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	99.896	1.141.811	0,07 %
		7.973.918	0,45 %	Repsol SA - Rights Issue 5.1.2018	511.520	—	0,00 %
Spanien 9,81 % (2016: 10,13 %)						171.855.443	9,81 %
Banco Santander SA	6.889.370	37.746.858	2,15 %	Vereinigtes Königreich 0,79 % (2016: 0,94 %)			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	2.844.143	20.227.545	1,15 %	CRH plc	356.875	10.690.191	0,61 %
Telefonica SA	1.933.509	15.709.761	0,90 %	Coca-Cola European Partners plc	91.189	3.030.210	0,17 %
Iberdrola SA	2.425.156	15.666.508	0,89 %	Coca-Cola European Partners plc (XNYS)	1.700	56.417	0,01 %
Industria de Diseno Textil SA	465.213	13.512.112	0,77 %			13.776.818	0,79 %
Amadeus IT Group SA Klasse A	187.154	11.249.827	0,64 %	Summe Aktien		1.740.093.218	99,35 %
Repsol SA	521.752	7.693.233	0,44 %	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		1.740.093.218	99,35 %
CaixaBank SA	1.530.746	5.953.071	0,34 %				
Abertis Infraestructuras SA	295.460	5.480.783	0,31 %				
Aena SME SA	28.765	4.861.285	0,28 %				
Ferrovial SA	209.798	3.970.427	0,23 %				

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures (0,01 %) (2016: 0,00 %)				
Euro Stoxx 50 März 2018	324	11.574.075	(256.755)	(0,01 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente			(256.755)	(0,01 %)

	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva	11.610.589	0,66 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	1.751.447.052	100,00 %

REIT – Real Estate Investment Trust.

Analyse des Gesamtvermögens	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	1.737.063.008	99,18 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	—	0,00 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	3.030.210	0,17 %
(d) Derivative Finanzinstrumente	(256.755)	(0,01 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva	11.610.589	0,66 %
Gesamtvermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	1.751.447.052	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Anteile	Kosten Euro (€)		Anteile	Erlöse Euro (€)
Käufe			Verkäufe		
Total SA	343.079	15.867.345	Sanofi	91.345	7.542.774
Sanofi	153.758	12.379.871	Total SA	149.336	6.894.857
Siemens AG	102.533	12.209.478	Siemens AG	54.595	6.711.184
Bayer AG	110.712	11.821.834	Bayer AG	58.938	6.657.050
SAP SE	131.795	11.815.233	SAP SE	70.148	6.400.260
Banco Santander SA	2.042.179	11.128.150	Allianz SE	35.602	6.260.419
BASF SE	123.106	10.888.152	Banco Santander SA	1.072.336	6.141.639
BNP Paribas SA	171.371	10.737.324	Christian Dior SE	24.062	5.756.634
Allianz SE	61.038	10.630.037	BASF SE	65.404	5.740.774
Anheuser-Busch InBev SA	102.185	10.330.120	Anheuser-Busch InBev SA	54.463	5.484.938
Unilever NV	218.304	10.063.044	Unilever NV	116.258	5.431.633
Daimler AG	128.839	8.819.535	BNP Paribas SA	77.655	4.896.924
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	37.409	7.886.844	Daimler AG	68.461	4.636.812
ING Groep NV	520.790	7.436.060	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	20.101	4.354.577
ASML Holding NV	56.055	7.061.666	ING Groep NV	274.667	4.069.171
Deutsche Telekom AG	444.356	7.021.812	Telefonica SA	371.110	3.563.258
AXA SA	259.684	6.215.709	Deutsche Telekom AG	214.314	3.544.003
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	888.943	6.124.585	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	488.712	3.475.971
L'Oreal SA	33.766	6.007.250	AXA SA	138.237	3.361.850
Enel SpA	1.239.450	5.777.764	L'Oreal SA	18.002	3.277.476
NXP Semiconductors NV	60.422	5.771.857	Iberdrola SA	487.776	3.264.374
			Air Liquide SA	28.707	3.081.263
			Airbus SE	41.087	3.022.968

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	Euro (€) Zum 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.740.093.218	1.304.880.577
Derivative Finanzinstrumente	—	16.264
Barmittel	7.201.833	1.667.426
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	5.757.613	6.087.377
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	3.038.153	1.636.126
Bareinschüsse für Futures	853.281	68.043
Summe Umlaufvermögen	1.756.944.098	1.314.355.813
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	256.755	—
Überziehungskredit	—	3.875.145
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	44	—
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	222.668	—
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	4.629.271	4.214.863
Zahlbare Verwaltungsgebühren	388.308	309.046
Summe kurzfristige Passiva	5.497.046	8.399.054
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	1.751.447.052	1.305.956.759

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Nettovermögen	990.730.182	993.871.282	1.212.718.521
Anzahl der umlaufenden Anteile	4.999.890	5.655.566	7.226.024
Nettoinventarwert je Anteil	198,15	175,73	167,83
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Gegenwert in Euro (€)	11.708.047	3.314.785	2.471.963
Nettovermögen	14.059.023	3.496.269	2.685.294
Anzahl der umlaufenden Anteile	59.080	18.861	14.728
Nettoinventarwert je Anteil	237,97	185,37	182,33
EUR-Anlegeranteile (€)			
Nettovermögen	52.118.084	43.002.407	37.161.044
Anzahl der umlaufenden Anteile	303.412	282.137	255.172
Nettoinventarwert je Anteil	171,77	152,42	145,63
USD-Anlegeranteile (\$)			
Gegenwert in Euro (€)	2.642.044	1.678.136	1.557.183
Nettovermögen	3.172.566	1.770.014	1.691.568
Anzahl der umlaufenden Anteile	13.358	9.562	9.286
Nettoinventarwert je Anteil	237,50	185,11	182,16
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Nettovermögen	692.682.951	263.330.583	1.044.250.011
Anzahl der umlaufenden Anteile	5.293.212	2.271.230	9.440.217
Nettoinventarwert je Anteil	130,86	115,94	110,62
Institutionelle Plus USD-Anteile (\$)			
Gegenwert in Euro (€)	1.565.744	759.566	3.789.749
Nettovermögen	1.880.145	801.152	4.116.804
Anzahl der umlaufenden Anteile	16.006	8.764	45.832
Nettoinventarwert je Anteil	117,47	91,41	89,82

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	3.287	196.523
Dividenden	50.043.465	65.004.488
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	206.123	1.377.063
Verschiedene Erträge	1.018.943	15.436
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	144.426.336	(78.267.407)
Summe Anlageerträge/(-verluste)	195.698.154	(11.673.897)
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	4.189.466	4.358.854
Transaktionsgebühren und Provisionen	819.938	458.129
Sonstige Aufwendungen	4.761	2.758
Summe Aufwendungen	5.014.165	4.819.741
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	25.891	24.541
Summe Finanzierungskosten	25.891	24.541
Nettoanlageerträge/(-verluste)	190.658.098	(16.518.179)
Ausländische Quellensteuer	(3.461.921)	(5.195.661)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	187.196.177	(21.713.840)

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	187.196.177	(21.713.840)
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	854.710.071	590.205.997
Rücknahmen	(596.415.955)	(1.564.483.869)
Summe Kapitalgeschäfte	258.294.116	(974.277.872)
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	445.490.293	(995.991.712)
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	1.305.956.759	2.301.948.471
Zum Jahresende	1.751.447.052	1.305.956.759

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Global Enhanced Equity Fund

Verwaltet durch The Vanguard Group, Inc.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Anlageziel

Der Fonds ist bestrebt, die Gesamtergebnisse (Ertrag zuzüglich Kapitalzuwachs) des MSCI World Index zu übertreffen, während er ein dem Index ähnliches Risikoprofil einhält.

Portfoliomerkmale

	Fonds	MSCI World Index
Anzahl der Aktien	238	1.652
Mittlere Marktkapitalisierung		
US-Dollar	\$ 23,0 Mrd.	\$ 59,7 Mrd.
Kurs/Gewinn-Verhältnis	13,5x	20,1x
Kurs/Buch-Verhältnis	1,8x	2,4x
Rendite	2,3 %	2,2 %
Eigenkapitalrendite	11,2 %	13,7 %
Ertragszuwachsrate	11,2 %	7,9 %
Portfolioumschlag ¹	139 %	—
Ausgewiesene laufende Kosten—		
Institutionelle Anteile	0,50 %	—
Kurzfristige Reserven	0,1 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	MSCI World Index
R ²	0,96	1,00
Beta	1,05	1,00

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI World Index
Luxusgüter	12,3 %	12,3 %
Grundbedarfsgüter	9,1	9,0
Energie	6,4	6,3
Finanzwerte	18,1	18,1
Gesundheitswesen	11,7	11,8
Industriegüter	11,5	11,6
Informationstechnologie	16,6	16,8
Grundstoffe	5,4	5,2
Immobilien	3,2	3,1
Telekommunikationsdienste	2,7	2,8
Versorger	3,0	3,0

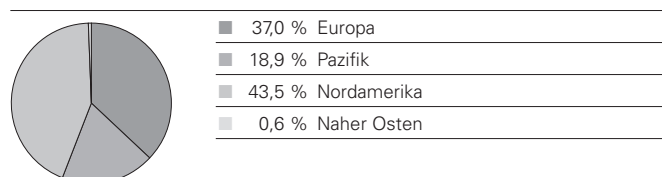
Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI World Index
Europa		
Vereinigtes Königreich	8,3 %	6,6 %
Frankreich	8,0	4,0
Italien	3,5	0,9
Deutschland	3,3	3,7
Niederlande	3,0	1,3
Spanien	2,9	1,2
Schweden	2,5	1,0
Norwegen	1,6	0,2
Dänemark	1,4	0,7
Österreich	1,1	0,1
Sonstige	1,4	3,9
Zwischensumme	37,0 %	23,6 %
Pazifik		
Japan	11,3 %	9,0 %
Australien	3,8	2,6
Hongkong	2,7	1,3
Singapur	1,1	0,5
Zwischensumme	18,9 %	13,4 %
Nordamerika		
USA	40,7 %	59,3 %
Kanada	2,8	3,5
Zwischensumme	43,5 %	62,8 %
Naher Osten	0,6 %	0,2 %

Die 10 grössten Positionen¹ (% des Gesamtvermögens)

Unternehmen	Sektor	Anteil
Alphabet Inc.	Internetsoftware und -dienste	1,7 %
Apple Inc.	Technologie-Hardware, Speicher und Peripheriegeräte	1,7
JPMorgan Chase & Co.	Diversifizierte Banken	1,2
Microsoft Corp.	Software	1,1
Procter & Gamble Co.	Kurzlebige Haushaltsprodukte	1,0
Boeing Co.	Luft- & Raumfahrt und Verteidigung	0,9
Royal Dutch Shell plc	Integrierter Öl- und Gaskonzern	0,9
AbbVie Inc.	Gesundheitswesen	0,9
International Business Machines Corp.	Software- und Computerdienstleistungen	0,8
Citigroup Inc.	Diversifizierte Banken	0,8
Summe		11,0 %

Allokation nach Region (% des Portfolios)



¹ Die aufgeführten Positionen schliessen etwaige vorübergehende Baranlagen und Aktienindexprodukte aus.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

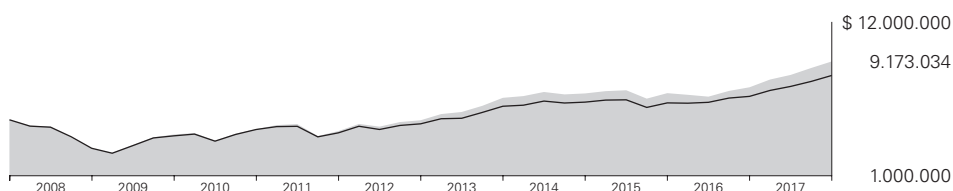
Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

Global Enhanced Equity Fund
Benchmark: MSCI World Index

In US-Dollar

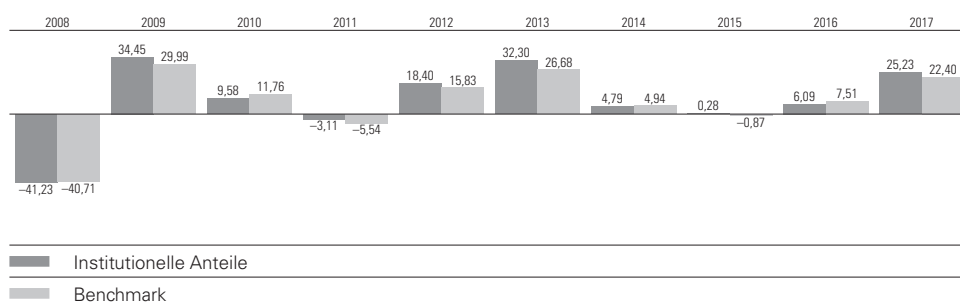
Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
— Institutionelle Anteile	25,23 %	13,06 %	6,26 %	\$ 9.173.034
— Benchmark	22,40	11,64	5,03	8.170.443

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 2,83 Prozentpunkte für institutionelle Anteile.¹

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



¹ Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Aktien 99,76 % (2016: 99,84 %)							
Argentinien 0,50 % (2016: 0,00 %)							
First Data Corp. Klasse A	71.256	1.190.688	0,50 %				
		1.190.688	0,50 %				
Australien 3,73 % (2016: 2,77 %)							
BlueScope Steel Ltd.	127.114	1.528.120	0,64 %				
Origin Energy Ltd.	193.545	1.426.011	0,59 %				
Santos Ltd.	334.401	1.425.457	0,59 %				
Coca-Cola Amatil Ltd.	191.809	1.276.699	0,53 %				
Fortescue Metals Group Ltd.	311.508	1.188.992	0,50 %				
Qantas Airways Ltd.	267.343	1.053.876	0,44 %				
Computershare Ltd.	82.161	1.047.474	0,44 %				
		8.946.629	3,73 %				
Österreich 1,13 % (2016: 0,54 %)							
Raiffeisen Bank International AG	38.102	1.381.737	0,58 %				
OMV AG	20.821	1.320.848	0,55 %				
		2.702.585	1,13 %				
Belgien 0,48 % (2016: 0,00 %)							
KBC Group NV	13.411	1.145.150	0,48 %				
		1.145.150	0,48 %				
Kanada 2,81 % (2016: 4,72 %)							
Teck Resources Ltd. Klasse B	54.559	1.431.306	0,60 %				
Canadian Imperial Bank of Commerce	12.908	1.262.418	0,53 %				
Valeant Pharmaceuticals International, Inc.	58.945	1.232.578	0,51 %				
Empire Co., Ltd.	41.981	820.555	0,34 %				
National Bank of Canada	13.780	689.798	0,29 %				
George Weston Ltd.	6.006	523.257	0,22 %				
West Fraser Timber Co., Ltd.	7.932	491.069	0,20 %				
BlackBerry Ltd.	11.170	125.166	0,05 %				
Power Corp. of Canada	4.735	122.329	0,05 %				
Manulife Financial Corp.	2.248	47.043	0,02 %				
		6.745.519	2,81 %				
Dänemark 1,38 % (2016: 1,14 %)							
Carlsberg A/S Klasse B	10.597	1.273.267	0,53 %				
H Lundbeck A/S	20.671	1.050.152	0,44 %				
TDC A/S	127.428	783.632	0,33 %				
Vestas Wind Systems A/S	2.794	193.224	0,08 %				
		3.300.275	1,38 %				
Frankreich 7,92 % (2016: 7,07 %)							
Total SA	34.012	1.880.552	0,78 %				
Sanofi	17.967	1.550.147	0,65 %				
BNP Paribas SA	20.379	1.523.326	0,63 %				
Bouygues SA	25.745	1.338.911	0,56 %				
Peugeot SA	60.846	1.238.798	0,52 %				
Orange SA	70.773	1.230.147	0,51 %				
Electricite de France SA	97.542	1.220.478	0,51 %				
Faurecia	15.523	1.214.024	0,51 %				
Credit Agricole SA	68.145	1.129.234	0,47 %				
Lagardere SCA	34.975	1.122.606	0,47 %				
Atos SE	7.703	1.122.459	0,47 %				
STMicroelectronics NV	50.446	1.102.778	0,46 %				
Engie SA	61.488	1.058.422	0,44 %				
Eurazeo SA	9.564	884.303	0,37 %				
CNP Assurances	21.628	500.070	0,21 %				
Casino Guichard Perrachon SA	7.369	447.390	0,19 %				
Engie SA (Prime De Fidelite 2019)	18.871	324.835	0,13 %				
Natixis SA	12.161	96.321	0,04 %				
		18.984.801	7,92 %				
Deutschland 3,33 % (2016: 4,53 %)							
Bayer AG	13.316	1.662.945	0,69 %				
Deutsche Lufthansa AG	37.787	1.393.908	0,58 %				
Covestro AG	13.329	1.376.950	0,58 %				
RWE AG	61.378	1.252.946	0,52 %				
METRO AG	57.416	1.147.936	0,48 %				
Schaeffler AG - Vorzugsaktien	61.198	1.086.499	0,45 %				
Ceconomy AG	4.040	61.150	0,03 %				
		7.982.334	3,33 %				
Hongkong 2,72 % (2016: 2,74 %)							
Kerry Properties Ltd.	301.000	1.353.428	0,56 %				
WH Group Ltd.	1.198.500	1.352.228	0,56 %				
CK Asset Holdings Ltd.	152.500	1.332.397	0,56 %				
Henderson Land Development Co., Ltd.	189.000	1.245.123	0,52 %				
Wheelock & Co., Ltd.	173.000	1.234.876	0,52 %				
		6.518.052	2,72 %				
Israel 0,56 % (2016: 1,45 %)							
Bank Leumi Le-Israel BM	223.425	1.349.566	0,56 %				
		1.349.566	0,56 %				
Italien 3,50 % (2016: 0,95 %)							
Fiat Chrysler Automobiles NV	75.952	1.359.839	0,57 %				
Enel SpA	216.354	1.332.763	0,55 %				
EXOR NV	20.186	1.238.631	0,52 %				
Mediobanca SpA	107.910	1.225.811	0,51 %				
Intesa Sanpaolo SpA - (Non CNV)	373.422	1.192.758	0,50 %				
Telecom Italia SpA (Non CVA)	1.588.135	1.136.591	0,47 %				
Assicurazioni Generali SpA	44.622	814.448	0,34 %				
Telecom Italia SpA	105.868	91.594	0,04 %				
		8.392.435	3,50 %				
Japan 11,31 % (2016: 11,11 %)							
Sony Corp.	34.700	1.565.735	0,65 %				
Hitachi Ltd.	192.000	1.496.288	0,62 %				
Sumitomo Corp.	86.700	1.473.862	0,61 %				
JXTG Holdings, Inc.	228.100	1.472.070	0,61 %				
Resona Holdings, Inc.	242.300	1.447.777	0,60 %				
Kirin Holdings Co., Ltd.	54.300	1.369.189	0,57 %				
Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	122.400	1.343.521	0,56 %				
Marubeni Corp.	183.500	1.329.377	0,55 %				
Daiwa House Industry Co., Ltd.	33.800	1.298.292	0,54 %				
ORIX Corp.	76.100	1.286.573	0,54 %				
Kajima Corp.	131.000	1.260.577	0,53 %				
Taisei Corp.	25.300	1.259.947	0,53 %				
Obayashi Corp.	103.000	1.247.155	0,52 %				
Fujitsu Ltd.	174.000	1.239.856	0,52 %				
Kansai Electric Power Co., Inc.	93.200	1.141.731	0,48 %				
Mixi, Inc.	23.800	1.069.046	0,45 %				
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	22.700	1.068.200	0,45 %				
Mitsubishi Corp.	37.100	1.025.231	0,43 %				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	114.600	840.705	0,35 %				
Kyushu Electric Power Co., Inc.	63.600	666.770	0,28 %				
Tosoh Corp.	26.800	607.609	0,25 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
ANA Holdings, Inc.	14.400	601.566	0,25 %	TUI AG	69.393	1.445.619	0,60 %
Idemitsu Kosan Co., Ltd.	9.200	369.552	0,15 %	AstraZeneca plc	18.989	1.315.450	0,55 %
Oji Holdings Corp.	27.000	179.760	0,08 %	Persimmon plc	34.973	1.295.340	0,54 %
Nomura Real Estate Holdings, Inc.	5.900	132.298	0,06 %	3i Group plc	104.650	1.293.199	0,54 %
Oracle Corp. Japan	1.300	107.785	0,05 %	G4S plc	344.066	1.242.712	0,52 %
Mitsui & Co., Ltd.	6.500	105.708	0,04 %	Pearson plc	124.267	1.237.232	0,52 %
Nissan Motor Co., Ltd.	5.000	49.867	0,02 %	Royal Mail plc	189.542	1.160.223	0,49 %
Brother Industries Ltd.	1.900	46.889	0,02 %	Coca-Cola HBC AG	31.001	1.014.866	0,42 %
		27.102.936	11,31 %	Taylor Wimpey plc	311.416	869.497	0,36 %
				Petrofac Ltd.	77.681	535.923	0,22 %
Niederlande 2,97 % (2016: 0,93 %)				Imperial Brands plc	12.073	517.063	0,22 %
Aegon NV	206.057	1.315.108	0,55 %	Carnival plc	7.594	502.545	0,21 %
ABN AMRO Group NV GDR	40.457	1.306.822	0,55 %	BT Group plc Klasse A	73.331	269.522	0,11 %
Coca-Cola European Partners plc	31.905	1.273.092	0,53 %	Centrica plc	75.659	140.524	0,06 %
Heineken Holding NV	12.596	1.247.684	0,52 %	Lloyds Banking Group plc	102.726	94.578	0,04 %
AerCap Holdings NV	19.343	1.017.635	0,42 %	Capita plc	14.430	78.256	0,03 %
NN Group NV	21.888	949.346	0,40 %	Berkeley Group Holdings plc	1.221	69.322	0,03 %
		7.109.687	2,97 %			19.889.928	8,30 %
				USA 40,07 % (2016: 48,05 %)			
Norwegen 1,62 % (2016: 0,36 %)				Apple, Inc.	23.693	4.009.566	1,67 %
Statoil A.S.A	64.136	1.373.780	0,57 %	Alphabet, Inc. Klasse A	2.879	3.032.739	1,27 %
Telenor A.S.A	59.313	1.275.548	0,53 %	JPMorgan Chase & Co.	27.233	2.912.297	1,22 %
Marine Harvest A.S.A	73.190	1.243.792	0,52 %	Microsoft Corp.	30.671	2.623.597	1,09 %
		3.893.120	1,62 %	Procter & Gamble Co.	25.653	2.356.998	0,98 %
				Boeing Co.	7.606	2.243.085	0,94 %
Portugal 0,13 % (2016: 0,25 %)				AbbVie, Inc.	21.172	2.047.544	0,85 %
Galp Energia SGPS SA	17.562	323.181	0,13 %	International Business Machines Corp.	13.006	1.995.381	0,83 %
		323.181	0,13 %	Citigroup, Inc.	25.409	1.890.684	0,79 %
				Amgen, Inc.	10.752	1.869.773	0,78 %
Singapur 1,14 % (2016: 0,62 %)				Caterpillar, Inc.	11.643	1.834.704	0,77 %
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	154.700	1.434.251	0,60 %	Home Depot, Inc.	9.237	1.750.689	0,73 %
Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.	1.110.800	1.221.847	0,51 %	Gilead Sciences, Inc.	23.679	1.696.364	0,71 %
Golden Agri-Resources Ltd.	273.300	75.666	0,03 %	Morgan Stanley	31.222	1.638.218	0,68 %
		2.731.764	1,14 %	Anthem, Inc.	7.177	1.614.897	0,67 %
				Express Scripts Holding Co.	21.227	1.584.383	0,66 %
Spanien 2,87 % (2016: 1,26 %)				Freeport-McMoRan, Inc.	83.309	1.579.539	0,66 %
International Consolidated Airlines Group SA	152.076	1.321.387	0,55 %	Micron Technology, Inc.	37.943	1.560.216	0,65 %
Repsol SA	74.361	1.316.621	0,55 %	Applied Materials, Inc.	30.310	1.549.447	0,65 %
Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	247.457	1.278.621	0,53 %	Cigna Corp.	7.593	1.542.062	0,64 %
ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	32.390	1.268.719	0,53 %	Ameriprise Financial, Inc.	8.908	1.509.639	0,63 %
Banco de Sabadell SA	623.926	1.240.692	0,52 %	Amazon.com, Inc.	1.281	1.498.091	0,62 %
Telefonica SA	47.459	463.034	0,19 %	Best Buy Co., Inc.	21.541	1.474.912	0,62 %
		6.889.074	2,87 %	Target Corp.	22.341	1.457.750	0,61 %
				United Rentals, Inc.	8.277	1.422.899	0,59 %
Schweden 2,52 % (2016: 2,98 %)				Kohl's Corp.	25.901	1.404.611	0,59 %
Volvo AB Klasse B	72.062	1.343.984	0,56 %	Allstate Corp.	13.280	1.390.549	0,58 %
Essity AB Klasse B	44.000	1.252.153	0,52 %	Humana, Inc.	5.498	1.363.889	0,57 %
L E Lundbergforetagen AB Klasse B	16.403	1.228.096	0,51 %	Centene Corp.	13.451	1.356.937	0,57 %
Industrivarden AB Klasse C	45.920	1.135.731	0,48 %	Citrix Systems, Inc.	15.350	1.350.800	0,56 %
Electrolux AB	27.929	901.574	0,38 %	Lam Research Corp.	7.338	1.350.706	0,56 %
Swedish Match AB	4.338	171.242	0,07 %	VMware, Inc. Klasse A	10.747	1.346.814	0,56 %
		6.032.780	2,52 %	Gap, Inc.	39.483	1.344.791	0,56 %
				Lincoln National Corp.	17.479	1.343.611	0,56 %
Schweiz 0,77 % (2016: 1,95 %)				Seagate Technology plc	32.113	1.343.608	0,56 %
Adecco Group AG	10.966	838.908	0,35 %	Conagra Brands, Inc.	35.082	1.321.539	0,55 %
Roche Holding AG	2.527	639.205	0,27 %	DXC Technology Co.	13.901	1.319.205	0,55 %
Nestle SA	4.286	368.565	0,15 %	Western Digital Corp.	16.583	1.318.846	0,55 %
		1.846.678	0,77 %	McKesson Corp.	8.371	1.305.457	0,54 %
				HP, Inc.	61.122	1.284.173	0,54 %
Vereinigtes Königreich 8,30 % (2016: 6,01 %)				Perrigo Co. plc	14.116	1.230.351	0,51 %
Royal Dutch Shell plc Klasse A	61.651	2.068.280	0,86 %	Athene Holding Ltd. Klasse A	23.544	1.217.460	0,51 %
Glencore plc	319.190	1.683.959	0,70 %	Facebook, Inc. Klasse A	6.897	1.217.045	0,51 %
GlaxoSmithKline plc	85.483	1.529.301	0,64 %	H&R Block, Inc.	45.209	1.185.380	0,49 %
Anglo American plc	72.827	1.526.517	0,64 %	Kimberly-Clark Corp.	9.711	1.171.729	0,49 %
				Alphabet, Inc. Klasse C	1.105	1.156.272	0,48 %
				CBRE Group, Inc. Klasse A	25.872	1.120.516	0,47 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Liberty Media Corp. - Liberty SiriusXM Klasse A	27.132	1.076.055	0,45 %	Discovery Communications, Inc. Klasse C	12.855	272.140	0,11 %
Electronic Arts, Inc.	9.851	1.034.946	0,43 %	Signet Jewelers Ltd.	4.267	241.299	0,10 %
Johnson & Johnson	7.174	1.002.351	0,42 %	NVIDIA Corp.	1.191	230.459	0,10 %
Principal Financial Group, Inc.	14.059	992.003	0,41 %	AmerisourceBergen Corp. Klasse A	2.296	210.819	0,09 %
Dell Technologies, Inc. Klasse V	10.923	887.821	0,37 %	Berkshire Hathaway, Inc. Klasse B	789	156.396	0,07 %
Omnicom Group, Inc.	11.889	865.876	0,36 %	Pfizer, Inc.	4.161	150.711	0,06 %
Exxon Mobil Corp.	10.215	854.383	0,36 %	Mallinckrodt plc	6.405	144.497	0,06 %
Unum Group	15.467	848.984	0,35 %	Michael Kors Holdings Ltd.	2.240	141.008	0,06 %
Carnival Corp.	12.633	838.452	0,35 %	Marathon Petroleum Corp.	2.125	140.208	0,06 %
General Motors Co.	19.078	782.007	0,33 %	Spectrum Brands Holdings, Inc.	984	110.602	0,05 %
Western Union Co.	34.200	650.142	0,27 %	Chevron Corp.	874	109.416	0,05 %
Valero Energy Corp.	6.599	606.514	0,25 %	Nordstrom, Inc.	2.258	106.984	0,04 %
United Therapeutics Corp.	4.073	602.600	0,25 %	AT&T, Inc.	2.457	95.528	0,04 %
Intel Corp.	11.884	548.565	0,23 %	Arista Networks, Inc.	337	79.390	0,03 %
UnitedHealth Group, Inc.	2.385	525.797	0,22 %	PepsiCo, Inc.	623	74.710	0,03 %
Juniper Networks, Inc.	18.245	519.983	0,22 %	HCA Healthcare, Inc.	803	70.536	0,03 %
Bank of America Corp.	16.064	474.209	0,20 %	Lear Corp.	390	68.897	0,03 %
Alliance Data Systems Corp.	1.836	465.389	0,19 %	FNF Group	1.214	47.637	0,02 %
Manpowergroup, Inc.	3.445	434.449	0,18 %	Ford Motor Co.	3.698	46.188	0,02 %
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	2.860	428.600	0,18 %	Macy's, Inc.	1.783	44.914	0,02 %
Wells Fargo & Co.	6.012	364.748	0,15 %	Comcast Corp. Klasse A	884	35.404	0,01 %
Discovery Communications, Inc. Klasse A	16.030	358.751	0,15 %	Safeway CASA Ley CVR	570	75	0,00 %
Xerox Corp.	10.402	303.218	0,13 %	Safeway PDC LLC CVR	570	—	0,00 %
Ally Financial, Inc.	10.337	301.427	0,13 %			96.050.614	40,07 %
Celgene Corp.	2.757	287.721	0,12 %	Summe Aktien		239.127.796	99,76 %
Royal Caribbean Cruises Ltd.	2.331	278.042	0,12 %	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		239.127.796	99,76 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures (0,00 %) (2016: (0,00 %))				
S&P 500 E-mini März 2018	6	806.100	(3.300)	(0,00 %)
			(3.300)	(0,00 %)

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf- betrag)	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte (0,19 %) (2016: (0,11 %))							
USD	4.850.490	HKD	(37.838.000)	BNP Paribas	16.01.2018	8.778	0,00 %
USD	8.043.205	JPY	(910.593.000)	JPMorgan Chase Bank	16.01.2018	(45.542)	(0,02 %)
USD	21.719.372	EUR	(18.422.000)	JPMorgan Chase Bank	16.01.2018	(419.475)	(0,17 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente						(459.539)	(0,19 %)

	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva	1.024.127	0,43 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)	239.692.384	100,00 %

GDR – Global Depositary Receipt.

Analyse des Gesamtvermögens	US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	237.301.343	99,00 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	1.826.453	0,76 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente	(459.539)	(0,19 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva	1.024.127	0,43 %
Gesamtvermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)	239.692.384	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Anteile	Kosten US-Dollar (\$)		Anteile	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
Exor NV	40.282	2.109.680	E.ON SE	179.328	1.988.284
Allergan plc	8.213	1.907.450	Bank of America Corp.	71.159	1.884.247
Bank of America Corp.	78.810	1.783.728	DNB A.S.A	98.873	1.828.735
AbbVie, Inc.	21.172	1.755.679	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	37.800	1.500.100
CBRE Group, Inc. Klasse A	42.827	1.748.450	Verizon Communications, Inc.	30.556	1.499.397
NN Group NV	42.093	1.657.151	Johnson & Johnson	11.082	1.471.646
Royal Dutch Shell plc Klasse A	55.461	1.596.979	Allergan plc	8.213	1.426.254
Citigroup, Inc.	28.146	1.592.037	Merck & Co., Inc.	25.283	1.412.774
Caterpillar, Inc.	11.643	1.583.923	AXA SA	48.709	1.410.776
Seagate Technology plc	36.182	1.531.510	Wharf Holdings Ltd.	377.000	1.397.550
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	37.800	1.428.649	Suzuki Motor Corp.	23.000	1.315.113
Allstate Corp.	13.280	1.385.615	Sompo Holdings, Inc.	32.800	1.277.690
Western Digital Corp.	16.583	1.380.981	Baxter International, Inc.	20.505	1.256.138
Daiwa House Industry Co., Ltd.	39.500	1.371.999	Royal Bank of Canada	17.325	1.254.661
AXA SA	48.709	1.353.126	Prudential Financial, Inc.	12.025	1.244.618
Cigna Corp.	7.593	1.343.329	Societe Generale SA	22.970	1.238.439
Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	247.457	1.330.442	Pfizer, Inc.	36.151	1.228.449
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	154.700	1.327.525	Goldman Sachs Group, Inc.	5.397	1.226.761
Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.	1.110.800	1.325.990	Everest Re Group Ltd.	5.078	1.199.233
Bank Leumi Le-Israel BM	254.282	1.325.755	Panasonic Corp.	88.300	1.184.549

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	239.127.796	159.620.488
Derivative Finanzinstrumente	8.778	—
Barmittel	1.408.529	1.197.650
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenkassageschäften	759	—
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	262.798	231.280
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	85.912	12.400
Bareinschüsse für Futures	27.610	16.410
Summe Umlaufvermögen	240.922.182	161.078.228
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	468.317	186.876
Überziehungskredit	6	935.323
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	662.006	—
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	—	16.000
Zahlbare Verwaltungsgebühren	99.469	67.755
Summe kurzfristige Passiva	1.229.798	1.205.954
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	239.692.384	159.872.274

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	239.692.384	159.872.274	131.039.709
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.284.449	1.072.100	932.230
Nettoinventarwert je Anteil	186,61	149,12	140,57

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	3.570	—
Dividenden	5.329.544	3.761.922
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	25.470	50.933
Verschiedene Erträge	4.181	4.003
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	39.773.749	6.666.587
Summe Anlageerträge/(-verluste)	45.136.514	10.483.445
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	981.009	677.877
Transaktionsgebühren und Provisionen	185.840	69.568
Sonstige Aufwendungen	510	—
Summe Aufwendungen	1.167.359	747.445
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	1.471	1.317
Summe Finanzierungskosten	1.471	1.317
Nettoanlageerträge/(-verluste)	43.967.684	9.734.683
Ausländische Quellensteuer	(658.096)	(604.447)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	43.309.588	9.130.236

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	43.309.588	9.130.236
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	51.814.496	37.580.503
Rücknahmen	(15.303.974)	(17.878.174)
Summe Kapitalgeschäfte	36.510.522	19.702.329
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	79.820.110	28.832.565
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	159.872.274	131.039.709
Zum Jahresende	239.692.384	159.872.274

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Global Small-Cap Index Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Asset Management, Limited.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Anlageziel

Der Fonds strebt langfristiges Kapitalwachstum durch Nachbildung der Performance des MSCI World Small Cap Index an, einem nach Marktkapitalisierung gewichteten Index, der sich aus Unternehmen mit geringer Marktkapitalisierung in Industrieländern zusammensetzt.

Portfoliomerkmale

	Fonds	MSCI World Small Cap Index
Anzahl der Aktien	4.364	4.330
Mittlere Marktkapitalisierung		
US-Dollar	\$ 2,9 Mrd.	\$ 2,9 Mrd.
Euro	€ 2,4 Mrd.	€ 2,4 Mrd.
Britisches Pfund	£ 2,2 Mrd.	£ 2,2 Mrd.
Kurs/Gewinn-Verhältnis	17,9x	17,9x
Kurs/Buch-Verhältnis	2,0x	2,0x
Rendite	1,8 %	1,8 %
Eigenkapitalrendite	8,9 %	8,9 %
Ertragszuwachsrate	11,8 %	11,8 %
Portfolioumschlag ¹	-26 %	—
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,38 %	
Anlegeranteile	0,40 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,30 %	
Thesaurierende Anteile	0,38 %	
Ausschüttende Anteile	0,38 %	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,30 %	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,30 %	
Kurzfristige Reserven	0,0 %	—

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI World Small Cap Index
Europa		
Vereinigtes Königreich	7,7 %	7,7 %
Deutschland	2,5	2,5
Schweden	2,1	2,1
Schweiz	2,0	2,0
Frankreich	1,6	1,6
Italien	1,6	1,6
Niederlande	1,0	1,0
Spanien	1,0	1,0
Sonstige	3,8	3,8
Zwischensumme	23,3 %	23,3 %
Pazifik		
Japan	12,6 %	12,6 %
Australien	2,7	2,8
Sonstige	2,0	2,0
Zwischensumme	17,3 %	17,4 %
Nordamerika		
USA	54,8 %	54,7 %
Kanada	4,0	4,0
Zwischensumme	58,8 %	58,7 %
Naher Osten	0,6 %	0,6 %

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	MSCI World Small Cap Index
R ²	1,00	1,00
Beta	1,00	1,00

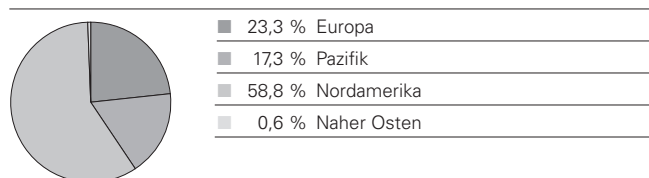
Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI World Small Cap Index
Luxusgüter	14,1 %	14,0 %
Grundbedarfsgüter	5,0	5,0
Energie	4,1	4,1
Finanzwerte	13,8	13,8
Gesundheitswesen	9,9	9,9
Industriegüter	17,6	17,6
Informationstechnologie	13,2	13,2
Grundstoffe	8,2	8,2
Immobilien	10,2	10,3
Telekommunikationsdienste	0,9	0,9
Versorger	3,0	3,0

Die 10 grössten Positionen² (% des Gesamtvermögens)

Unternehmen	Sektor	Anteil
XPO Logistics Inc.	Luftfracht und Logistik	0,2 %
Alcoa Corp.	Industriemetalle und Bergbau	0,2
Nektar Therapeutics	Biotechnologie	0,1
NRG Energy Inc.	Diversifizierte Versorger	0,1
Exelixis Inc.	Biotechnologie	0,1
Copart Inc.	Fahrzeughandel	0,1
WellCare Health Plans Inc.	Medizinische Versorgung	0,1
ON Semiconductor Corp.	Halbleiter	0,1
Bluebird Bio Inc.	Biotechnologie	0,1
Burlington Stores Inc.	Kaufhäuser	0,1
Summe		1,2 %

Allokation nach Region (% des Portfolios)



Anlagefokus

Stil	Wert	Mischung	Wachstum
Marktkapitalisierung	Gross		
	Mittel		
	Klein		

¹ Ein negativer Portfolioumschlag deutet darauf hin, dass der Gesamtwert der Zeichnungen und Rückkäufe über dem Wert der Wertpapiertransaktionen gelegen hat.

² Die aufgeführten Positionen schliessen etwaige vorübergehende Baranlagen und Aktienindexprodukte aus.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

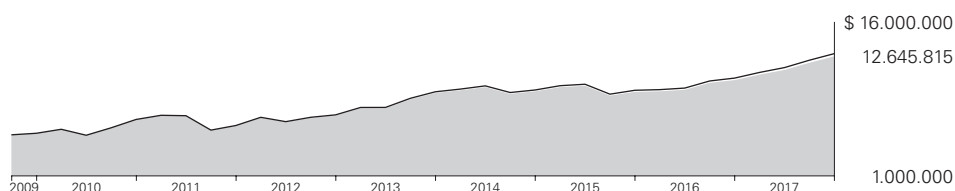
Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

Global Small-Cap Index Fund
 Benchmark: MSCI World Small Cap Index

In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 10. Dezember 2009–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000



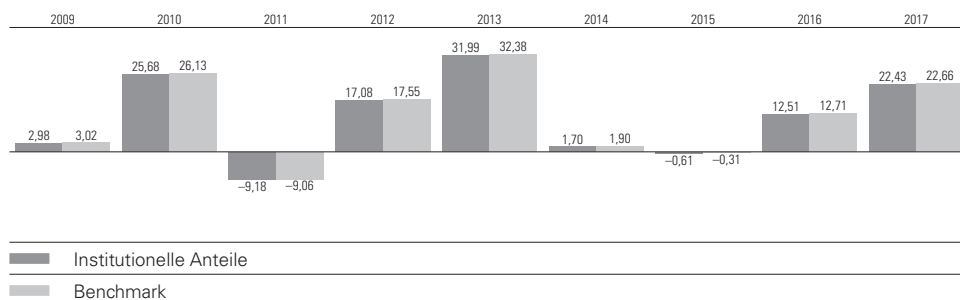
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
— Institutionelle Anteile	22,43 %	12,94 %	12,21 %	\$ 12.645.815
— Benchmark	22,66	13,20	12,49	12.910.873

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen		Endwert einer Anlage von \$ 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Anlegeranteile	22,41 %	11,30 %	\$ 135.129
Benchmark	22,66	11,57	136.050

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen		Endwert einer Anlage von \$ 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile	22,54 %	11,42 %	\$ 271.011.000
Benchmark	22,66	11,57	272.099.935

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,23 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,25 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,12 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 10. Dezember 2009–31. Dezember 2017



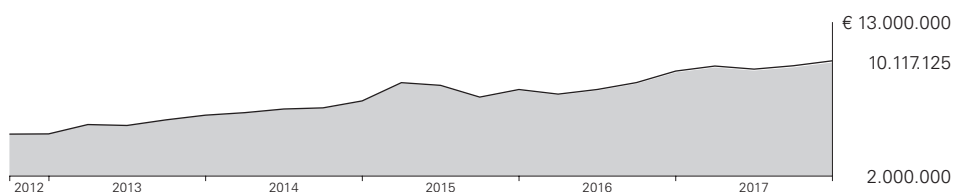
¹ Für institutionelle Anteile, 10. Dezember 2009; für Anleger- und institutionelle Plus-Anteile, 10. März 2015.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Global Small-Cap Index Fund
 Benchmark: MSCI World Small Cap Index

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 11. Dezember 2012–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



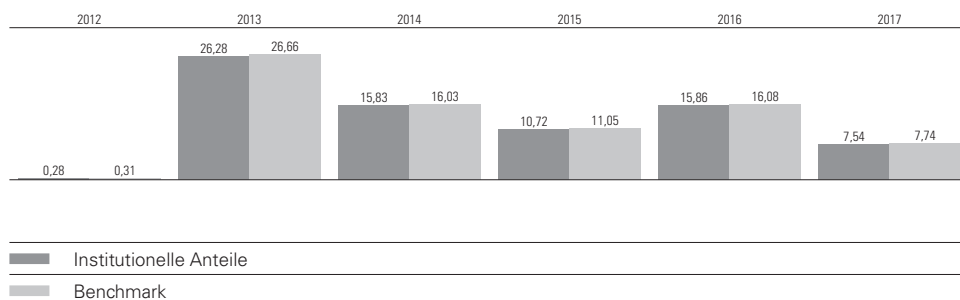
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
— Institutionelle Anteile	7,54 %	14,96 %	€ 10.117.125
— Benchmark	7,74	15,23	10.237.280

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Anlegeranteile	7,52 %	11,92 %	€ 154.118
Benchmark	7,74	12,18	155.496

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile	7,63 %	13,10 %	€ 328.566.999
Benchmark	7,74	13,26	330.416.443

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,20 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,22 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,11 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 11. Dezember 2012–31. Dezember 2017



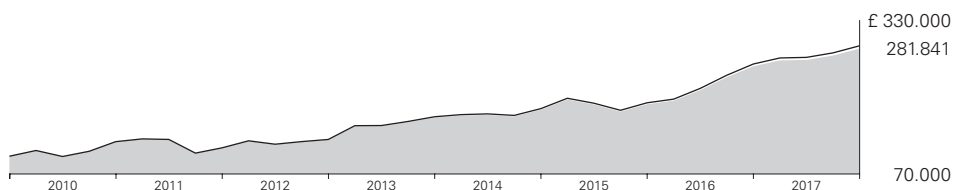
¹ Für institutionelle Anteile, 11. Dezember 2012; für Anlegeranteile, 27. Februar 2014; für institutionelle Plus-Anteile, 19. Dezember 2014.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Global Small-Cap Index Fund
 Benchmark: MSCI World Small Cap Index

In GBP

Kumulative Wertentwicklung: 11. Januar 2010–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile	11,83 %	17,19 %	13,88 %	£ 281.841
Benchmark	12,04	17,44	14,12	286.620

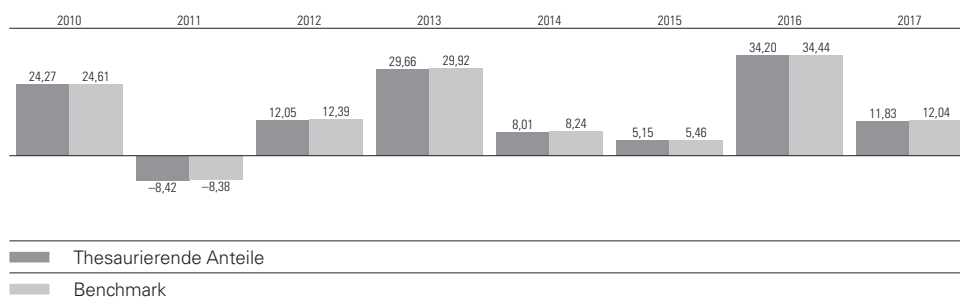
	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Ausschüttende Anteile	11,83 %	17,19 %	13,89 %	£ 281.941
Benchmark	12,04	17,44	14,12	286.620

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	11,92 %	15,68 %	15,68 %	£ 324.783.200
Benchmark	12,04	17,44	15,81	326.032.473

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	11,92 %	15,68 %	15,68 %	£ 324.762.308
Benchmark	12,04	17,44	15,81	326.032.473

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,21 Prozentpunkte für Thesaurierungsanteile und Ertragsanteile und 0,12 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile und institutionelle Plus-Ertragsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 11. Januar 2010–31. Dezember 2017



1 Für Thesaurierungs- und Ertragsanteile, 11. Januar 2010; für institutionelle Plus-Thesaurierungs- und institutionelle Plus-Ertragsanteile, 2. September 2014.
 2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Aktien 99,01 % (2016: 98,77 %)							
Australien 2,72 % (2016: 2,46 %)							
Star Entertainment Group Ltd.	175.542	834.785	0,06 %	Charter Hall Retail REIT	78.483	255.364	0,02 %
Spark Infrastructure Group	378.608	743.282	0,05 %	MYOB Group Ltd.	89.938	254.649	0,02 %
Iluka Resources Ltd.	90.845	722.623	0,05 %	Primary Health Care Ltd.	89.730	254.060	0,02 %
Downer EDI Ltd.	131.711	713.913	0,05 %	ARB Corp., Ltd.	17.245	252.634	0,02 %
Orora Ltd.	269.104	713.526	0,05 %	Altium Ltd.	23.726	246.441	0,02 %
Link Administration Holdings Ltd.	102.313	675.404	0,05 %	Galaxy Resources Ltd.	81.520	244.204	0,02 %
Macquarie Atlas Roads Group	132.680	652.749	0,05 %	Cromwell Property Group REIT	308.698	243.863	0,02 %
Qube Holdings Ltd.	321.706	651.702	0,05 %	Technology One Ltd.	62.364	241.939	0,02 %
ALS Ltd.	117.726	643.635	0,04 %	Mantra Group Ltd.	78.457	239.324	0,02 %
Northern Star Resources Ltd.	131.038	625.197	0,04 %	Saracen Mineral Holdings Ltd.	176.391	233.160	0,02 %
Ansell Ltd.	32.060	609.340	0,04 %	Premier Investments Ltd.	19.621	227.897	0,02 %
Magellan Financial Group Ltd.	27.628	582.585	0,04 %	Orocobre Ltd.	41.497	226.224	0,02 %
WorleyParsons Ltd.	50.859	570.834	0,04 %	Pact Group Holdings Ltd.	50.852	225.916	0,02 %
Mineral Resources Ltd.	33.680	556.887	0,04 %	Bega Cheese Ltd.	39.742	224.739	0,02 %
Cleanaway Waste Management Ltd.	472.008	553.772	0,04 %	SpeedCast International Ltd.	53.047	222.390	0,02 %
carsales.com Ltd.	48.483	549.475	0,04 %	Aconex Ltd.	36.539	219.201	0,01 %
IOOF Holdings Ltd.	64.986	544.885	0,04 %	Breville Group Ltd.	22.175	218.537	0,01 %
Metcash Ltd.	221.480	540.479	0,04 %	McMillan Shakespeare Ltd.	15.935	215.869	0,01 %
Evolution Mining Ltd.	256.601	531.856	0,04 %	Sandfire Resources NL	39.832	215.278	0,01 %
DuluxGroup Ltd.	85.800	514.051	0,04 %	WiseTech Global Ltd.	19.244	212.981	0,01 %
JB Hi-Fi Ltd.	26.309	513.205	0,04 %	Navitas Ltd.	48.616	207.236	0,01 %
OZ Minerals Ltd.	68.543	491.076	0,03 %	Abacus Property Group REIT	63.905	205.931	0,01 %
Charter Hall Group REIT	103.967	489.533	0,03 %	Sigma Healthcare Ltd.	263.026	203.669	0,01 %
Adelaide Brighton Ltd.	90.520	461.617	0,03 %	GUD Holdings Ltd.	21.157	201.719	0,01 %
Sims Metal Management Ltd.	35.999	444.030	0,03 %	Syrah Resources Ltd.	56.751	200.189	0,01 %
Independence Group NL	113.006	420.725	0,03 %	Lynas Corp., Ltd.	115.360	196.699	0,01 %
CSR Ltd.	112.820	420.033	0,03 %	Viva Energy REIT	110.385	195.123	0,01 %
Investa Office Fund REIT	117.904	419.595	0,03 %	Aveo Group	92.161	193.184	0,01 %
Beach Energy Ltd.	417.675	406.722	0,03 %	Ardent Leisure Group	120.701	188.813	0,01 %
Blackmores Ltd.	2.987	395.229	0,03 %	Super Retail Group Ltd.	28.740	185.676	0,01 %
Whitehaven Coal Ltd.	110.851	386.691	0,03 %	Mayne Pharma Group Ltd.	329.364	179.040	0,01 %
BT Investment Management Ltd.	43.377	383.039	0,03 %	Sirtex Medical Ltd.	13.486	174.254	0,01 %
Perpetual Ltd.	9.972	377.111	0,03 %	Nine Entertainment Co. Holdings Ltd.	143.177	171.898	0,01 %
Regis Resources Ltd.	107.986	363.183	0,02 %	APN Outdoor Group Ltd.	43.319	167.038	0,01 %
Steadfast Group Ltd.	161.672	356.594	0,02 %	Webjet Ltd.	20.455	166.868	0,01 %
St Barbara Ltd.	119.014	355.592	0,02 %	Brickworks Ltd.	14.225	165.445	0,01 %
GrainCorp Ltd. Klasse A	54.692	350.346	0,02 %	Credit Corp. Group Ltd.	9.426	164.482	0,01 %
Washington H Soul Pattinson & Co., Ltd.	24.597	342.446	0,02 %	Automotive Holdings Group Ltd.	56.095	159.704	0,01 %
Nufarm Ltd.	48.904	334.307	0,02 %	SmartGroup Corp., Ltd.	18.562	157.523	0,01 %
Shopping Centres Australasia Property Group REIT	180.312	328.602	0,02 %	IDP Education Ltd.	32.277	155.260	0,01 %
Reliance Worldwide Corp., Ltd.	105.624	322.194	0,02 %	Eclixp Group Ltd.	49.074	155.068	0,01 %
InvoCare Ltd.	25.476	320.809	0,02 %	Bellamy's Australia Ltd.	18.829	154.045	0,01 %
Platinum Asset Management Ltd.	53.107	320.255	0,02 %	Tox Free Solutions Ltd.	56.838	153.817	0,01 %
IRESS Ltd.	35.244	319.215	0,02 %	Southern Cross Media Group Ltd.	162.536	150.646	0,01 %
Vocus Group Ltd.	133.608	316.640	0,02 %	Western Areas Ltd.	58.393	147.978	0,01 %
Fairfax Media Ltd.	509.153	310.623	0,02 %	Ausdrill Ltd.	70.378	144.771	0,01 %
NEXTDC Ltd.	65.634	308.014	0,02 %	National Storage REIT	119.705	143.718	0,01 %
Seven Group Holdings Ltd.	25.316	303.152	0,02 %	IPH Ltd.	32.386	139.319	0,01 %
BWP Trust REIT	120.413	291.019	0,02 %	Blue Sky Alternative Investments Ltd.	12.225	139.028	0,01 %
Pilbara Minerals Ltd.	328.697	286.656	0,02 %	Domain Holdings Australia Ltd.	50.915	136.593	0,01 %
Costa Group Holdings Ltd.	54.506	281.370	0,02 %	BWX Ltd.	21.500	127.131	0,01 %
Bapcor Ltd.	62.174	274.756	0,02 %	Resolute Mining Ltd.	142.440	127.007	0,01 %
Corporate Travel Management Ltd.	16.570	270.350	0,02 %	Aventus Retail Property Fund Ltd. REIT	70.760	123.973	0,01 %
G8 Education Ltd.	101.807	269.940	0,02 %	Estia Health Ltd.	44.974	122.766	0,01 %
Monadelphous Group Ltd.	19.365	263.092	0,02 %	Growthpoint Properties Australia Ltd. REIT	46.028	122.763	0,01 %
				Genworth Mortgage Insurance Australia Ltd.	50.786	119.167	0,01 %
				Bingo Industries Ltd.	57.839	115.359	0,01 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
RCR Tomlinson Ltd.	36.792	115.107	0,01 %	AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	5.867	165.842	0,01 %
Afterpay Touch Group Ltd.	24.268	113.318	0,01 %	FACC AG	4.978	103.442	0,01 %
Charter Hall Long Wale REIT	34.228	111.369	0,01 %	Semperit AG Holding	3.303	87.654	0,01 %
Inghams Group Ltd.	39.796	106.452	0,01 %	DO & CO AG	1.478	83.805	0,01 %
Nanosonics Ltd.	48.987	106.133	0,01 %	POLYTEC Holding AG	3.700	82.195	0,01 %
Clean TeQ Holdings Ltd.	90.156	104.716	0,01 %	Porr AG	2.360	78.896	0,01 %
Collins Foods Ltd.	24.371	103.696	0,01 %	Zumtobel Group AG	6.196	74.550	0,00 %
oOh!media Ltd.	28.925	101.807	0,01 %	Kapsch TrafficCom AG	1.210	72.576	0,00 %
Infigen Energy	186.754	100.788	0,01 %			5.506.232	0,38 %
Tassal Group Ltd.	34.194	100.561	0,01 %				
Greencross Ltd.	20.223	99.492	0,01 %	Belgien 0,76 % (2016: 0,66 %)			
Australian Pharmaceutical Industries Ltd.	75.388	99.356	0,01 %	Galapagos NV	9.863	935.399	0,06 %
Westgold Resources Ltd.	71.662	99.209	0,01 %	Ackermans & van Haaren NV	5.153	898.148	0,06 %
Hansen Technologies Ltd.	32.086	99.129	0,01 %	bpost SA	22.758	693.716	0,05 %
Austal Ltd.	66.889	95.217	0,01 %	Ontex Group NV	18.586	615.421	0,04 %
GDI Property Group REIT	97.087	94.921	0,01 %	Cofinimmo SA REIT	4.585	604.247	0,04 %
Virtus Health Ltd.	22.178	91.243	0,01 %	Sofina SA	3.311	521.432	0,04 %
Gateway Lifestyle	52.939	90.266	0,01 %	KBC Ancora	8.085	509.597	0,04 %
Japara Healthcare Ltd.	57.119	87.564	0,01 %	Melexis NV	4.575	463.500	0,03 %
GWA Group Ltd.	38.247	85.257	0,01 %	Warehouses de Pauw CVA REIT	3.791	425.315	0,03 %
Asaleo Care Ltd.	72.219	84.729	0,01 %	Aedifica SA REIT	4.163	393.516	0,03 %
Folkestone Education Trust REIT	36.256	81.670	0,01 %	Elia System Operator SA	6.609	380.139	0,03 %
Seven West Media Ltd.	166.977	80.320	0,01 %	Ablynx NV	14.460	359.773	0,03 %
Centuria Industrial REIT	39.625	78.721	0,01 %	Bekaert SA	7.973	348.924	0,02 %
Pro Medicus Ltd.	11.243	76.681	0,01 %	Euronav NV	31.922	294.543	0,02 %
Freedom Foods Group Ltd.	18.741	75.930	0,01 %	Tessengerlo Group SA	6.253	292.009	0,02 %
HT&E Ltd.	51.303	75.438	0,01 %	Gimv NV	4.685	284.213	0,02 %
Australian Agricultural Co., Ltd.	73.643	75.168	0,00 %	Befimmo SA REIT	4.346	279.460	0,02 %
Retail Food Group Ltd.	38.886	75.124	0,00 %	Cie d'Entreprises CFE	1.804	263.632	0,02 %
Myer Holdings Ltd.	143.201	73.923	0,00 %	D'ieteren SA	5.515	248.572	0,02 %
FlexiGroup Ltd.	54.199	72.914	0,00 %	Kinopolis Group NV	3.241	216.617	0,02 %
Regis Healthcare Ltd.	25.781	70.979	0,00 %	Econocom Group SA	29.205	208.908	0,01 %
Mesoblast Ltd.	59.647	68.113	0,00 %	Barco NV	1.850	198.267	0,01 %
SG Fleet Group Ltd.	19.072	60.564	0,00 %	AGFA-Gevaert NV	41.933	195.723	0,01 %
Select Harvests Ltd.	16.024	59.157	0,00 %	Nyrstar NV	22.423	180.697	0,01 %
Ainsworth Game Technology Ltd.	33.264	56.198	0,00 %	Ion Beam Applications	5.101	146.302	0,01 %
WPP AUNZ Ltd.	69.830	50.248	0,00 %	Orange Belgium SA	5.941	124.844	0,01 %
Cedar Woods Properties Ltd.	10.187	48.603	0,00 %	Fagron	8.012	109.821	0,01 %
Village Roadshow Ltd.	15.112	45.979	0,00 %	Biocartis NV	6.787	97.309	0,01 %
OFX Group Ltd.	38.976	43.289	0,00 %	EVS Broadcast Equipment SA	2.697	94.631	0,01 %
Karoon Gas Australia Ltd.	39.989	40.973	0,00 %	Recticel SA	9.861	91.532	0,01 %
Michael Hill International Ltd.	40.033	38.514	0,00 %	Intervest Offices & Warehouses NV REIT	3.294	88.958	0,01 %
Accent Group Ltd.	59.405	38.100	0,00 %	Greenyard NV	3.129	75.541	0,01 %
Donaco International Ltd.	54.200	15.261	0,00 %	Van de Velde NV	1.229	65.591	0,00 %
Quintis Ltd.	53.031	12.236	0,00 %	Celyad SA	1.468	61.010	0,00 %
Strandline Resources Ltd.	1.367	139	0,00 %	Exmar NV	7.316	56.672	0,00 %
ACN 004 410 833 Ltd.	297.856	2	0,00 %	Sioen Industries NV	1.336	48.802	0,00 %
Jacana Minerals Ltd.	3.985	—	0,00 %	Balta Group NV	4.546	47.492	0,00 %
AET and D Holdings No.1 Ltd. Unlisted Shares	24.489	—	0,00 %			10.920.273	0,76 %
		39.170.885	2,72 %	Kanada 3,95 % (2016: 3,98 %)			
Österreich 0,38 % (2016: 0,30 %)				Algonquin Power & Utilities Corp.	98.505	1.105.376	0,08 %
BUWOG AG	25.409	877.195	0,06 %	WSP Global, Inc.	19.857	949.466	0,07 %
Wienerberger AG	25.890	627.059	0,04 %	Canopy Growth Corp.	36.856	874.813	0,06 %
CA Immobilien Anlagen AG	16.551	512.860	0,04 %	Maxar Technologies Ltd.	13.044	841.359	0,06 %
IMMOFINANZ AG	180.456	465.237	0,03 %	Toromont Industries Ltd.	17.406	765.450	0,05 %
Lenzing AG	3.020	383.856	0,03 %	Stantec, Inc.	26.722	749.867	0,05 %
Telekom Austria AG Klasse A	38.472	357.058	0,02 %	Ritchie Bros Auctioneers, Inc.	24.308	730.239	0,05 %
Oesterreichische Post AG	7.504	337.184	0,02 %	Enbridge Income Fund Holdings, Inc.	30.032	714.517	0,05 %
UNIQA Insurance Group AG	28.806	305.086	0,02 %	Quebecor, Inc. Klasse B	37.456	708.494	0,05 %
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe	8.865	274.271	0,02 %	B2Gold Corp.	223.377	691.730	0,05 %
Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	2.371	242.003	0,02 %	Yamana Gold, Inc.	214.245	670.290	0,05 %
S IMMO AG	10.135	196.547	0,01 %	Stars Group, Inc.	27.844	650.016	0,05 %
EVN AG	8.922	178.916	0,01 %	Canadian Western Bank	20.361	637.830	0,04 %
				IAMGOLD Corp.	106.532	623.233	0,04 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Kirkland Lake Gold Ltd.	39.912	613.835	0,04 %	First Majestic Silver Corp.	39.389	266.586	0,02 %
Parkland Fuel Corp.	28.540	611.596	0,04 %	Altus Group Ltd.	8.913	262.706	0,02 %
Whitecap Resources, Inc.	84.423	603.045	0,04 %	Canada Goose Holdings, Inc.	8.148	258.236	0,02 %
Maple Leaf Foods, Inc.	20.478	585.436	0,04 %	North West Co., Inc.	10.630	255.113	0,02 %
Aurora Cannabis, Inc.	73.528	563.365	0,04 %	Enerflex Ltd.	20.132	246.478	0,02 %
Alamos Gold, Inc. Klasse A	85.947	561.799	0,04 %	Westshore Terminals Investment Corp.	11.714	245.789	0,02 %
Pan American Silver Corp.	35.354	552.481	0,04 %	Morneau Shepell, Inc.	13.751	244.740	0,02 %
New Flyer Industries, Inc.	12.271	528.859	0,04 %	Paramount Resources Ltd. Klasse A	15.593	241.682	0,02 %
Hudbay Minerals, Inc.	59.256	526.373	0,04 %	SSR Mining, Inc.	27.236	240.634	0,02 %
Northland Power, Inc.	28.236	526.207	0,04 %	Spin Master Corp.	5.545	239.069	0,02 %
Cott Corp.	31.328	524.571	0,04 %	Spartan Energy Corp.	41.545	238.404	0,02 %
FirstService Corp.	7.413	520.232	0,04 %	Enghouse Systems Ltd.	4.787	234.928	0,02 %
Enerplus Corp.	52.708	517.846	0,04 %	Centerra Gold ,Inc.	45.433	233.520	0,02 %
Descartes Systems Group, Inc.	18.092	516.069	0,04 %	Corus Entertainment, Inc. Klasse B	25.001	233.458	0,02 %
TFI International, Inc.	19.388	508.472	0,04 %	Gran Tierra Energy, Inc.	85.954	232.076	0,02 %
Parex Resources, Inc.	35.055	508.080	0,04 %	Innervex Renewable Energy, Inc.	20.192	232.064	0,02 %
TMX Group Ltd.	8.890	499.790	0,03 %	ATS Automation Tooling Systems, Inc.	18.273	226.781	0,02 %
Gibson Energy, Inc.	34.122	495.102	0,03 %	Intertape Polymer Group, Inc.	13.175	225.971	0,02 %
Detour Gold Corp.	41.924	494.542	0,03 %	Killam Apartment REIT	19.815	224.885	0,02 %
Colliers International Group, Inc.	8.124	491.933	0,03 %	Secure Energy Services, Inc.	31.932	223.253	0,02 %
Ivanhoe Mines Ltd. Klasse A	142.042	480.672	0,03 %	Fortuna Silver Mines, Inc.	42.594	223.007	0,02 %
Canadian Apartment Properties REIT	16.083	479.044	0,03 %	Pason Systems, Inc.	15.327	222.513	0,02 %
Premium Brands Holdings Corp.	5.740	472.595	0,03 %	Cominar REIT	19.282	221.606	0,02 %
Peyto Exploration & Development Corp.	37.729	452.585	0,03 %	Sleep Country Canada Holdings, Inc.	8.125	216.589	0,02 %
Capital Power Corp.	22.723	444.141	0,03 %	MEG Energy Corp.	52.651	215.991	0,01 %
New Gold, Inc.	132.804	437.751	0,03 %	Novagold Resources, Inc.	54.735	215.803	0,01 %
Cineplex, Inc.	13.935	415.175	0,03 %	TORC Oil & Gas Ltd.	35.602	214.246	0,01 %
Aphria, Inc.	27.803	414.954	0,03 %	Advantage Oil & Gas Ltd.	49.426	213.018	0,01 %
Stella-Jones, Inc.	10.165	409.699	0,03 %	Aecon Group, Inc.	13.214	210.293	0,01 %
Pretium Resources, Inc.	34.752	397.736	0,03 %	SEMAFO, Inc.	73.799	210.274	0,01 %
Enercare, Inc.	22.915	375.104	0,03 %	Freehold Royalties Ltd.	18.654	209.177	0,01 %
Laurentian Bank of Canada	8.094	365.181	0,03 %	Precision Drilling Corp.	68.740	209.026	0,01 %
TransAlta Corp.	61.401	365.088	0,03 %	Trican Well Service Ltd.	63.850	207.916	0,01 %
Endeavour Mining Corp.	17.366	355.234	0,02 %	Sienna Senior Living, Inc.	13.994	203.496	0,01 %
OceanaGold Corp.	136.642	352.252	0,02 %	Uni-Select, Inc.	8.501	192.756	0,01 %
ShawCor Ltd.	15.951	349.077	0,02 %	Home Capital Group, Inc. Klasse B	13.646	188.525	0,01 %
Kinder Morgan Canada Ltd.	24.591	333.846	0,02 %	MAG Silver Corp.	15.185	188.093	0,01 %
Mullen Group Ltd.	26.486	332.726	0,02 %	Western Forest Products, Inc.	95.226	186.204	0,01 %
Russel Metals, Inc.	14.281	332.477	0,02 %	Granite REIT	4.702	184.823	0,01 %
Superior Plus Corp.	34.513	326.964	0,02 %	Pure Industrial Real Estate Trust REIT	33.922	183.289	0,01 %
Great Canadian Gaming Corp.	12.055	325.104	0,02 %	Artis REIT	16.090	181.068	0,01 %
Tahoe Resources, Inc.	67.333	324.050	0,02 %	NexGen Energy Ltd.	70.490	180.592	0,01 %
Genworth MI Canada, Inc.	9.268	321.767	0,02 %	Trevali Mining Corp.	148.765	180.472	0,01 %
Raging River Exploration, Inc.	50.366	321.583	0,02 %	Kelt Exploration Ltd.	31.186	178.960	0,01 %
BRP, Inc.	8.614	319.755	0,02 %	Sierra Wireless, Inc.	8.659	177.610	0,01 %
Canfor Corp.	16.161	319.621	0,02 %	Nevsun Resources Ltd.	72.307	176.591	0,01 %
Allied Properties REIT	9.504	319.189	0,02 %	Badger Daylighting Ltd.	7.773	168.618	0,01 %
Celestica, Inc.	29.509	310.410	0,02 %	Dream Global REIT	17.285	168.580	0,01 %
Norbord, Inc.	9.104	309.171	0,02 %	Birchcliff Energy Ltd.	46.721	164.071	0,01 %
Labrador Iron Ore Royalty Corp.	14.098	306.050	0,02 %	Knight Therapeutics, Inc.	24.588	163.076	0,01 %
Cogeco Communications, Inc.	4.308	297.343	0,02 %	Baytex Energy Corp.	53.987	162.441	0,01 %
ECN Capital Corp.	93.375	292.880	0,02 %	Jamieson Wellness, Inc.	8.906	158.793	0,01 %
TransAlta Renewables, Inc.	27.108	289.697	0,02 %	Ballard Power Systems, Inc.	35.578	157.878	0,01 %
Tricon Capital Group, Inc.	31.199	287.600	0,02 %	Boardwalk REIT	4.544	156.272	0,01 %
Canadian REIT	7.769	287.086	0,02 %	AG Growth International, Inc.	3.668	156.152	0,01 %
Kinaxis, Inc.	4.657	285.415	0,02 %	MTY Food Group, Inc.	3.483	155.949	0,01 %
Osisko Gold Royalties Ltd.	24.428	283.088	0,02 %	Timbercreek Financial Corp.	20.118	154.464	0,01 %
NuVista Energy Ltd.	43.713	279.802	0,02 %	Torex Gold Resources, Inc.	16.100	153.297	0,01 %
Eldorado Gold Corp.	191.784	278.580	0,02 %	Valener, Inc.	8.428	152.759	0,01 %
Transcontinental, Inc. Klasse A	13.946	276.482	0,02 %	Equitable Group, Inc.	2.652	151.337	0,01 %
Boralex, Inc. Klasse A	14.709	275.878	0,02 %	Cascades, Inc.	13.766	149.641	0,01 %
Martinrea International, Inc.	21.021	269.106	0,02 %	Extencare, Inc.	20.483	149.583	0,01 %
Winpak Ltd.	7.162	267.514	0,02 %				
Interfor Corp.	15.859	267.323	0,02 %				
CES Energy Solutions Corp.	51.280	267.256	0,02 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Lucara Diamond Corp.	65.693	147.330	0,01 %	CT REIT	5.682	65.756	0,00 %
Dorel Industries, Inc. Klasse B	5.812	144.262	0,01 %	Morguard REIT Klasse UTS	5.858	64.520	0,00 %
WestJet Airlines Ltd.	6.784	142.724	0,01 %	Athabasca Oil Corp.	73.422	62.701	0,00 %
Guyana Goldfields, Inc.	34.991	141.869	0,01 %	Corby Spirit and Wine Ltd. Klasse A	3.331	61.439	0,00 %
Nemaska Lithium, Inc.	75.443	141.499	0,01 %	Canfor Pulp Products, Inc.	5.761	61.383	0,00 %
Hudson's Bay Co.	15.587	140.326	0,01 %	Sprott, Inc.	30.722	59.828	0,00 %
Ensign Energy Services, Inc.	26.269	135.648	0,01 %	AGT Food & Ingredients, Inc.	3.694	59.289	0,00 %
Canaccord Genuity Group, Inc.	29.229	135.303	0,01 %	Bonterra Energy Corp.	4.630	56.538	0,00 %
ProMetic Life Sciences, Inc.	129.070	133.917	0,01 %	TMAC Resources, Inc.	7.034	54.231	0,00 %
Choice Properties REIT	12.550	133.718	0,01 %	Endeavour Silver Corp.	22.421	54.042	0,00 %
Alaris Royalty Corp.	7.905	130.409	0,01 %	Chorus Aviation, Inc.	6.400	49.292	0,00 %
Total Energy Services, Inc.	10.746	127.448	0,01 %	Lundin Gold, Inc.	13.535	48.935	0,00 %
Computer Modelling Group Ltd.	16.456	126.085	0,01 %	Exco Technologies Ltd.	6.003	48.582	0,00 %
MedReleaf Corp.	7.267	123.190	0,01 %	Stornoway Diamond Corp.	92.168	48.550	0,00 %
Dream Office REIT	6.961	123.114	0,01 %	Magellan Aerospace Corp.	2.778	46.583	0,00 %
Taseko Mines Ltd.	51.388	120.580	0,01 %	Painted Pony Energy Ltd.	21.705	46.253	0,00 %
Cardinal Energy Ltd.	29.036	117.956	0,01 %	Atlantic Power Corp.	19.160	45.723	0,00 %
Jackpotjoy plc	10.446	117.074	0,01 %	High Liner Foods, Inc.	3.681	43.569	0,00 %
Obsidian Energy Ltd.	93.852	116.852	0,01 %	Clearwater Seafoods, Inc.	6.662	38.974	0,00 %
Avigilon Corp.	6.933	116.698	0,01 %	Dream Industrial REIT	5.548	38.966	0,00 %
Seabridge Gold, Inc.	10.171	115.839	0,01 %	Exchange Income Corp.	1.359	38.657	0,00 %
Arizona Mining, Inc.	41.908	115.728	0,01 %	Imperial Metals Corp.	1.826	4.940	0,00 %
Lithium Americas Corp.	12.706	113.375	0,01 %	Great Basin Gold Ltd.	61.601	117	0,00 %
Northern Dynasty Minerals Ltd.	63.397	113.340	0,01 %	Poseidon Concepts Corp.	9.800	20	0,00 %
Aritzia, Inc.	10.845	109.839	0,01 %	Imperial Metals Corp. - Rights Issue 31.12.2049	3	1	0,00 %
DREAM Unlimited Corp. Klasse A	17.682	109.511	0,01 %				
Premier Gold Mines Ltd.	37.816	108.654	0,01 %			56.865.751	3,95 %
Fiera Capital Corp.	9.975	103.496	0,01 %				
Rogers Sugar, Inc.	19.826	100.004	0,01 %	Kaimaninseln 0,01 % (2016: 0,02 %)			
Silvercorp Metals, Inc.	37.844	99.069	0,01 %	Global Indemnity Ltd.	1.900	79.838	0,01 %
Klondex Mines Ltd.	37.283	97.005	0,01 %			79.838	0,01 %
AGF Management Ltd. Klasse B	14.841	96.891	0,01 %				
Altius Minerals Corp.	8.063	96.206	0,01 %	China 0,11 % (2016: 0,02 %)			
Aimia, Inc.	32.040	95.638	0,01 %	Landing International Development Ltd.	16.640.000	659.870	0,05 %
Alacer Gold Corp.	53.355	94.961	0,01 %	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.	42.500	282.163	0,02 %
First National Financial Corp.	4.098	94.196	0,01 %	Coupa Software, Inc.	6.037	188.475	0,01 %
Northview Apartment REIT	4.646	92.664	0,01 %	K Wah International Holdings Ltd.	324.000	176.977	0,01 %
Cara Operations Ltd.	4.464	92.490	0,01 %	Goodbaby International Holdings Ltd.	206.000	113.049	0,01 %
Canacol Energy Ltd.	25.426	91.115	0,01 %	Leyou Technologies Holdings Ltd.	295.000	67.171	0,01 %
Just Energy Group, Inc.	20.374	87.808	0,01 %	Microport Scientific Corp.	65.000	62.777	0,00 %
NorthWest Healthcare Properties REIT	9.636	87.443	0,01 %	FDG Kinetic Ltd.	322.000	30.893	0,00 %
Major Drilling Group International, Inc.	15.494	87.304	0,01 %	Neo Telemedia Ltd.	884.000	27.140	0,00 %
Osisko Mining, Inc.	32.144	86.969	0,01 %			1.608.515	0,11 %
AutoCanada, Inc.	4.806	86.841	0,01 %				
China Gold International Resources Corp., Ltd.	46.107	86.477	0,01 %	Dänemark 0,68 % (2016: 0,54 %)			
Surge Energy, Inc.	51.643	86.144	0,01 %	GN Store Nord A/S	31.153	1.007.383	0,07 %
DIRTT Environmental Solutions	15.746	84.703	0,01 %	Jyske Bank A/S	14.933	850.644	0,06 %
Savaria Corp.	5.747	83.571	0,01 %	Nets A/S	27.332	719.402	0,05 %
Bonavista Energy Corp.	46.094	82.774	0,01 %	Royal Unibrew A/S	10.668	639.695	0,04 %
Uranium Participation Corp.	24.455	82.561	0,01 %	Sydbank A/S	15.837	638.292	0,04 %
Crombie REIT	7.322	80.645	0,01 %	Ambu A/S Klasse B	6.620	593.626	0,04 %
Cogeco, Inc.	1.086	78.450	0,01 %	Rockwool International Klasse B A/S	1.941	550.645	0,04 %
Pengrowth Energy Corp.	97.777	78.037	0,01 %	Topdanmark A/S	12.532	541.873	0,04 %
WPT Industrial REIT	5.925	75.366	0,01 %	FLSmith & Co. A/S	8.896	518.374	0,04 %
Wajax Corp.	3.677	72.398	0,01 %	SimCorp A/S	8.428	480.229	0,03 %
Bird Construction, Inc.	8.900	72.027	0,00 %	Dfds A/S	7.227	386.153	0,03 %
Evertz Technologies Ltd.	4.923	71.510	0,00 %	Nilfisk Holding A/S	5.997	351.092	0,02 %
Trinidad Drilling Ltd.	52.627	71.404	0,00 %	NKT A/S	5.997	274.007	0,02 %
InterRent REIT	9.726	70.871	0,00 %	Scandinavian Tobacco Group A/S	13.555	262.338	0,02 %
Crew Energy, Inc.	27.733	69.723	0,00 %	Bavarian Nordic A/S	6.698	242.301	0,02 %
Tamarack Valley Energy Ltd.	29.866	68.173	0,00 %	Schouw & Co. AB	2.498	234.273	0,02 %
Gluskin Sheff + Associates, Inc.	5.118	68.011	0,00 %	Spar Nord Bank A/S	19.197	223.228	0,02 %
Aurinia Pharmaceuticals, Inc.	14.771	67.433	0,00 %	ALK-Abello A/S	1.716	204.800	0,01 %
Medical Facilities Corp.	5.865	66.610	0,00 %	Bang & Olufsen A/S	8.298	200.076	0,01 %
				Alm Brand A/S	13.107	171.226	0,01 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens
Per Aarsleff Holding A/S	4.683	147.656	0,01 %	Trigano SA	1.728	305.645	0,02 %
Matas A/S	8.007	101.372	0,01 %	Tarkett SA	6.958	292.264	0,02 %
D/S Norden A/S	5.055	94.979	0,01 %	Technicolor SA	83.231	286.839	0,02 %
Solar A/S Klasse B	1.282	84.358	0,01 %	IPSOS	7.764	286.216	0,02 %
NNIT A/S	2.531	70.006	0,01 %	SOITEC	3.881	277.055	0,02 %
Zealand Pharma A/S	4.874	66.817	0,00 %	Eramet	2.084	247.819	0,02 %
TORM plc	7.294	62.936	0,00 %	Europcar Groupe SA	19.930	245.302	0,02 %
IC Group A/S	1.543	36.208	0,00 %	COFACE SA	21.897	234.384	0,02 %
		9.753.989	0,68 %	Mercialys SA REIT	10.445	231.344	0,02 %
Finnland 0,62 % (2016: 0,60 %)				Neopost SA	7.318	210.899	0,02 %
Huhtamaki OYJ	21.575	906.754	0,06 %	DBV Technologies SA	4.029	202.689	0,01 %
Kesko OYJ Klasse B	14.516	788.744	0,05 %	Beneteau SA	8.416	201.563	0,01 %
Amer Sports OYJ	26.180	725.879	0,05 %	LISI	4.008	192.994	0,01 %
Konecranes OYJ Klasse A	14.784	677.795	0,05 %	Bonduelle SCA	3.438	181.957	0,01 %
Outokumpu OYJ	70.599	656.161	0,05 %	Derichebourg SA	16.265	177.967	0,01 %
Valmet OYJ	28.300	558.675	0,04 %	Kaufman & Broad SA	3.706	176.360	0,01 %
Cargotec OYJ Klasse B	8.649	490.206	0,03 %	FFP	1.361	163.919	0,01 %
Tieto OYJ	12.387	386.434	0,03 %	Gnifit	5.664	162.688	0,01 %
Metsa Board OYJ	41.510	356.144	0,02 %	Cellectis SA	5.549	158.852	0,01 %
Kemira OYJ	22.336	308.442	0,02 %	Metropole Television SA	6.109	157.974	0,01 %
Outotec OYJ	33.046	281.740	0,02 %	X-Fab Silicon Foundries SE	13.492	155.580	0,01 %
Uponor OYJ	12.242	246.669	0,02 %	Naturex	1.394	148.259	0,01 %
DNA OYJ	13.030	244.866	0,02 %	Solutions 30 SE	4.567	139.843	0,01 %
Cramo OYJ	9.207	218.462	0,02 %	Boiron SA	1.516	136.258	0,01 %
Citycon Oyj	84.275	218.384	0,02 %	Mersen SA	2.951	132.317	0,01 %
YIT OYJ	26.945	206.105	0,01 %	Virbac SA	869	128.872	0,01 %
Sanoma OYJ	15.747	205.541	0,01 %	Chargeurs SA	4.219	128.225	0,01 %
Finnair OYJ	13.159	202.573	0,01 %	Television Francaise 1	8.582	126.600	0,01 %
Technopolis OYJ	35.969	180.541	0,01 %	Ste Industrielle d'Aviation			
Tikkurila OYJ	8.131	173.892	0,01 %	Latecoere SA	16.466	112.900	0,01 %
Ramirent OYJ	15.270	143.206	0,01 %	Guerbet	1.175	111.888	0,01 %
Caverion OYJ	18.415	130.244	0,01 %	Solocal Group	110.025	109.658	0,01 %
Tokmanni Group Corp.	11.664	101.544	0,01 %	Interparfums SA	2.599	107.826	0,01 %
F-Secure OYJ	21.215	99.098	0,01 %	Devoteam SA	1.154	103.721	0,01 %
Oriola OYJ Klasse B	27.950	93.975	0,01 %	Jacquet Metal Service	2.976	98.274	0,01 %
Ferratum OYJ	2.353	86.135	0,01 %	Direct Energie	2.047	97.068	0,01 %
Ponsse OYJ	2.385	75.550	0,01 %	Altamir	5.301	97.009	0,01 %
Lehto Group OYJ	4.850	73.730	0,00 %	Synergie SA	1.806	95.171	0,01 %
Stockmann OYJ Abp Klasse B	8.010	41.859	0,00 %	ID Logistics Group	582	94.487	0,01 %
Atria OYJ Klasse A	1.862	27.077	0,00 %	Manitou BF SA	2.427	88.887	0,01 %
		8.906.425	0,62 %	MGI Coutier	2.168	87.758	0,01 %
Frankreich 1,51 % (2016: 1,50 %)				LNA Sante SA	1.208	85.438	0,01 %
Rubis SCA	18.957	1.342.595	0,09 %	Oeneo SA	6.506	80.077	0,01 %
Orpea	9.576	1.130.338	0,08 %	Rallye SA	4.380	77.998	0,01 %
Euronext NV	12.625	785.445	0,06 %	Groupe Guillin	1.797	74.230	0,01 %
Nexity SA	10.522	626.940	0,04 %	Bourbon Corp.	8.801	73.978	0,01 %
SPIE SA	24.039	626.537	0,04 %	Haulotte Group SA	3.785	73.311	0,01 %
Air France-KLM	37.892	617.900	0,04 %	Cie des Alpes	1.863	73.108	0,01 %
Sopra Steria Group	3.222	602.980	0,04 %	Albioma SA (XPAR)	2.814	71.095	0,01 %
Elis SA	21.749	601.064	0,04 %	Aubay	1.649	68.512	0,01 %
Cie Plastic Omnium SA	13.163	598.973	0,04 %	Groupe Crit	681	59.515	0,00 %
Altran Technologies SA	35.503	592.159	0,04 %	Marie Brizard Wine & Spirits SA	3.910	59.065	0,00 %
Euler Hermes Group	3.805	556.555	0,04 %	AB Science SA	5.494	55.021	0,00 %
Alten SA	6.500	543.320	0,04 %	Assystem	1.433	51.485	0,00 %
Elior Group SA	25.331	523.941	0,04 %	Pierre & Vacances SA	928	51.070	0,00 %
Fnac Darty SA	3.911	472.920	0,03 %	Esso SA Francaise	682	46.926	0,00 %
Maisons du Monde SA	10.327	468.125	0,03 %	Innate Pharma SA	7.620	43.463	0,00 %
Sartorius Stedim Biotech	6.192	448.277	0,03 %	GL Events	1.438	42.305	0,00 %
Vallourec SA	73.981	447.291	0,03 %	Plastivaloire	1.825	40.980	0,00 %
Worldline SA	8.884	433.864	0,03 %	ACT (Prime De Fidelite)	1.564	39.514	0,00 %
Nexans SA	6.705	411.505	0,03 %	ABC arbitrage	5.185	39.100	0,00 %
Elis SA (XLON)	14.676	401.539	0,03 %	Parrot SA	3.656	38.721	0,00 %
ALD SA	22.490	348.782	0,02 %	FIGEAC-AERO	1.664	37.745	0,00 %
Korian SA	9.709	343.287	0,02 %	Axway Software SA	1.274	34.880	0,00 %
Gaztransport Et Technigaz SA	5.341	321.315	0,02 %	Etablissements Maurel et Prom	7.273	31.440	0,00 %
Vicat SA	3.993	315.450	0,02 %	Stallergenes Greer plc	660	30.520	0,00 %
				SRP Groupe SA	3.054	23.250	0,00 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens
ANF Immobilien REIT	817	21.407	0,00 %	Koenig & Bauer AG	2.791	210.571	0,01 %
Albioma SA	701	17.711	0,00 %	Heidelberger Druckmaschinen AG	60.684	209.499	0,01 %
		21.698.298	1,51 %	Kloeckner & Co. SE - Vorzugsaktien	15.884	196.266	0,01 %
Deutschland 2,44 % (2016: 2,29 %)				XING SE	608	196.101	0,01 %
LEG Immobilien AG	14.214	1.626.426	0,11 %	S&T AG	8.354	180.416	0,01 %
Rheinmetall AG	9.695	1.232.280	0,09 %	KWS Saat SE	445	178.475	0,01 %
Freenet AG	28.700	1.062.148	0,07 %	SGL Carbon SE	12.819	175.327	0,01 %
Scout24 AG	20.634	843.667	0,06 %	Isra Vision AG	684	174.618	0,01 %
Sartorius AG - Vorzugsaktien	7.856	750.339	0,05 %	Takkt AG	7.618	172.571	0,01 %
Duerr AG	5.679	726.601	0,05 %	VTG AG	2.998	171.936	0,01 %
Siltronic AG	4.805	699.882	0,05 %	ErlingKlinger AG	7.432	166.662	0,01 %
Aurubis AG	7.300	680.054	0,05 %	SLM Solutions Group AG	2.811	161.178	0,01 %
Wacker Chemie AG	3.461	674.098	0,05 %	Diebold Nixdorf AG	1.813	158.925	0,01 %
Software AG	11.048	621.665	0,04 %	Bertrandt AG	1.287	157.093	0,01 %
Ceconomy AG	39.723	601.251	0,04 %	Deutsche Beteiligungs AG	2.697	152.358	0,01 %
STADA Arzneimittel AG	5.671	600.823	0,04 %	Wuestenrot & Wuerttembergische AG	5.424	152.147	0,01 %
Gerresheimer AG	6.994	580.497	0,04 %	Hamburger Hafen und Logistik AG	5.235	148.794	0,01 %
MorphoSys AG	6.309	580.158	0,04 %	Nordex SE	13.803	147.083	0,01 %
GRENKE AG	6.039	574.039	0,04 %	Capital Stage AG	18.519	143.700	0,01 %
Carl Zeiss Meditec AG	9.108	566.093	0,04 %	Grammer AG	2.295	142.890	0,01 %
Grand City Properties SA	23.908	564.126	0,04 %	Aumann AG	1.836	140.922	0,01 %
Aareal Bank AG	12.394	561.525	0,04 %	Phibro Animal Health Corp. Klasse A	4.058	135.943	0,01 %
Bechtle AG	6.653	555.390	0,04 %	Cewe Stiftung & Co. KGAA	1.272	134.489	0,01 %
Dialog Semiconductor plc	16.972	528.860	0,04 %	SMA Solar Technology AG	2.972	128.458	0,01 %
Leoni AG	6.995	524.051	0,04 %	Vossloh AG	2.209	124.140	0,01 %
CTS Eventim AG & Co. KGaA	11.063	515.769	0,04 %	Biotest AG - Vorzugsaktien	5.037	122.178	0,01 %
TAG Immobilien AG	27.021	513.958	0,04 %	Draegerwerk AG & Co. KGaA - Vorzugsaktien	1.366	118.593	0,01 %
Salzgitter AG	8.795	502.653	0,04 %	ADLER Real Estate AG	7.408	118.177	0,01 %
Rational AG	778	501.864	0,03 %	Amadeus Fire AG	1.262	117.005	0,01 %
Krones AG	3.594	494.145	0,03 %	DIC Asset AG	8.672	109.652	0,01 %
TLG Immobilien AG	18.572	493.861	0,03 %	Hypoport AG	622	108.562	0,01 %
Jungheinrich AG - Vorzugsaktien	10.389	490.833	0,03 %	BayWa AG	2.675	103.013	0,01 %
Alstria office-AG REIT	31.600	489.494	0,03 %	JOST Werke AG	2.009	101.804	0,01 %
Norma Group SE	7.105	477.518	0,03 %	Borussia Dortmund GmbH & Co. KGaA	12.292	90.421	0,01 %
Evotec AG	28.149	456.318	0,03 %	Draegerwerk AG & Co. KGaA	1.113	81.646	0,01 %
Stroer SE & Co. KGaA	6.058	448.106	0,03 %	MLP SE	12.008	81.151	0,01 %
Deutsche EuroShop AG	10.394	423.796	0,03 %	comdirect bank AG	5.717	78.638	0,01 %
Nemetschek SE	4.600	413.392	0,03 %	STO SE & Co. KGaA - Vorzugsaktien	512	77.405	0,01 %
Hapag-Lloyd AG	10.142	407.980	0,03 %	Basler AG	327	76.589	0,01 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	24.828	398.308	0,03 %	STRATEC Biomedical AG	974	75.836	0,01 %
Jenoptik AG	11.500	380.374	0,03 %	Bauer AG	2.090	75.290	0,01 %
CompuGroup Medical SE	5.506	361.787	0,03 %	OHB SE	1.367	73.235	0,01 %
Suedzucker AG	16.511	358.462	0,02 %	bet-at-home.com AG	586	73.217	0,01 %
Bilfinger SE	7.280	345.870	0,02 %	Sixt Leasing SE	3.095	70.613	0,00 %
ADO Properties SA	6.724	341.376	0,02 %	Biotest AG	2.565	67.761	0,00 %
AURELIUS Equity Opportunities SE & Co. KGaA	4.963	339.457	0,02 %	ADVA Optical Networking SE	7.999	57.987	0,00 %
Rocket Internet SE	12.880	326.726	0,02 %	Elmos Semiconductor AG	2.054	56.926	0,00 %
Aixtron SE	23.460	326.218	0,02 %	Hornbach Baumarkt AG	1.530	56.835	0,00 %
Indus Holding AG	4.127	294.864	0,02 %	KPS AG	3.321	55.790	0,00 %
CANCOM SE	3.393	282.757	0,02 %	Gerry Weber International AG	4.739	54.300	0,00 %
Pfeiffer Vacuum Technology AG	1.466	274.882	0,02 %	Surteco SE	1.666	53.814	0,00 %
Sixt SE	2.904	259.826	0,02 %	MBB SE	498	52.080	0,00 %
Deutz AG	28.252	257.118	0,02 %	Vapiano SE	1.773	50.884	0,00 %
DMG Mori AG	4.630	255.858	0,02 %	GFT Technologies SE	2.932	45.928	0,00 %
RHOEN-KLINIKUM AG	6.918	248.217	0,02 %	VERBIO Vereinigte BioEnergie AG	4.515	44.186	0,00 %
Washtec AG	2.592	244.952	0,02 %	CENTROTEC Sustainable AG	2.325	43.190	0,00 %
RIB Software SE	7.996	238.312	0,02 %	H&R GmbH & Co. KGaA	2.287	40.095	0,00 %
zooplus AG	1.292	233.181	0,02 %	Manz AG	1.006	38.094	0,00 %
SAF-Holland SA	10.636	229.061	0,02 %			35.185.188	2,44 %
PATRIZIA Immobilien AG	9.675	224.629	0,02 %				
Wacker Neuson SE	6.066	219.068	0,02 %				
Hamborner AG REIT	18.073	214.807	0,02 %				
Sixt SE - Vorzugsaktien	3.367	213.961	0,01 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Griechenland 0,00 % (2016: 0,00 %)							
Cyprus Popular Bank PCL	390.444	5	0,00 %	BOCOM International Holdings Co., Ltd.	231.000	78.307	0,01 %
		5	0,00 %	CK Life Sciences Int'l Holdings, Inc.	983.331	75.473	0,01 %
Guernsey 0,05 % (2016: 0,00 %)				Digital Domain Holdings Ltd.	3.350.000	74.565	0,01 %
Burford Capital Ltd.	41.239	642.655	0,05 %	China Trustful Group Ltd.	172.000	74.368	0,01 %
		642.655	0,05 %	Regal REIT	241.748	73.910	0,01 %
Hongkong 0,78 % (2016: 0,84 %)				Sun Hung Kai & Co., Ltd.	114.500	73.089	0,01 %
Xinyi Glass Holdings Ltd.	418.413	544.874	0,04 %	Emperor International Holdings Ltd.	207.886	69.674	0,01 %
Melco International Development Ltd.	172.000	506.057	0,04 %	Singamas Container Holdings Ltd.	336.000	68.341	0,00 %
Hopewell Holdings Ltd.	135.750	499.253	0,03 %	Regina Miracle International Holdings Ltd.	69.000	67.965	0,00 %
VTech Holdings Ltd.	36.777	481.747	0,03 %	Chong Hing Bank Ltd.	31.000	66.463	0,00 %
Johnson Electric Holdings Ltd.	85.625	358.720	0,03 %	CITIC Telecom International Holdings Ltd.	235.778	62.433	0,00 %
Luk Fook Holdings International Ltd.	76.681	329.097	0,02 %	Nameson Holdings Ltd.	154.000	62.252	0,00 %
Champion REIT	445.394	326.469	0,02 %	Town Health International Medical Group Ltd.	695.000	61.345	0,00 %
Man Wah Holdings Ltd.	334.800	318.213	0,02 %	Liu Chong Hing Investment Ltd.	35.000	60.443	0,00 %
Haitong International Securities Group Ltd.	540.573	308.413	0,02 %	China Oceanwide International Financial Ltd.	430.000	59.407	0,00 %
SITC International Holdings Co., Ltd.	300.025	296.291	0,02 %	Fairwood Holdings Ltd.	14.000	57.309	0,00 %
Great Eagle Holdings Ltd.	53.500	280.253	0,02 %	Regal Hotels International Holdings Ltd.	72.000	56.644	0,00 %
HKBN Ltd.	217.000	274.258	0,02 %	CSI Properties Ltd.	1.083.166	56.117	0,00 %
Value Partners Group Ltd.	241.628	256.548	0,02 %	Emperor Capital Group Ltd.	684.000	49.874	0,00 %
Television Broadcasts Ltd.	69.600	250.184	0,02 %	G-Resources Group Ltd.	3.999.520	49.628	0,00 %
FIH Mobile Ltd.	766.000	233.211	0,02 %	Macau Legend Development Ltd.	325.500	48.717	0,00 %
Esprit Holdings Ltd.	405.500	216.825	0,02 %	Huarong International Financial Holdings Ltd.	141.050	45.650	0,00 %
Dah Sing Financial Holdings Ltd.	33.741	216.026	0,02 %	Bright Smart Securities & Commodities Group Ltd.	139.000	42.497	0,00 %
Cafe de Coral Holdings Ltd.	76.000	208.537	0,01 %	NewOcean Energy Holdings Ltd.	157.000	41.171	0,00 %
Pacific Basin Shipping Ltd.	960.000	207.540	0,01 %	China Financial International Investments Ltd.	1.315.000	39.026	0,00 %
Kerry Logistics Network Ltd.	137.000	194.180	0,01 %	Tai United Holdings Ltd.	290.000	37.468	0,00 %
Pacific Textiles Holdings Ltd.	178.844	188.743	0,01 %	Xin Point Holdings Ltd.	51.000	32.620	0,00 %
Dah Sing Banking Group Ltd.	86.603	187.889	0,01 %	Convoy Global Holdings Ltd.	1.446.000	30.891	0,00 %
Guotai Junan International Holdings Ltd.	582.800	182.654	0,01 %	Emperor Entertainment Hotel Ltd.	97.500	21.452	0,00 %
Sunlight REIT	260.099	178.339	0,01 %	Vision Fame International Holding Ltd.	490.000	19.118	0,00 %
CMBC Capital Holdings Ltd.	2.490.000	168.818	0,01 %	Hsin Chong Group Holdings Ltd.	398.300	17.833	0,00 %
Far East Consortium International Ltd.	269.127	161.807	0,01 %	Good Resources Holdings Ltd.	320.000	14.941	0,00 %
Prosperity REIT	344.920	147.370	0,01 %	Li Bao Ge Group Ltd.	50.000	2.718	0,00 %
Giordano International Ltd.	266.000	141.553	0,01 %			11.236.527	0,78 %
Chow Sang Sang Holdings International Ltd.	56.998	137.659	0,01 %	Irland 0,46 % (2016: 0,40 %)			
OP Financial Investments Ltd.	384.000	136.067	0,01 %	Smurfit Kappa Group plc	53.298	1.804.167	0,13 %
Hutchison Telecommunications Hong Kong Holdings Ltd.	299.191	120.177	0,01 %	Kingspan Group plc	34.358	1.501.964	0,10 %
United Laboratories International Holdings Ltd.	137.836	111.964	0,01 %	Glanbia plc	44.312	792.827	0,06 %
Shun Tak Holdings Ltd.	286.500	111.781	0,01 %	Cairn Homes plc	155.769	353.519	0,02 %
Brightoil Petroleum Holdings Ltd.	571.226	109.608	0,01 %	Prothena Corp. plc	8.210	307.793	0,02 %
SmartOne Telecommunications Holdings Ltd.	89.000	107.247	0,01 %	Dalata Hotel Group plc	40.175	304.167	0,02 %
SUNeVision Holdings Ltd.	141.500	106.795	0,01 %	Hibernia plc REIT	156.971	287.260	0,02 %
VSTECs Holdings Ltd.	156.600	96.557	0,01 %	Green plc REIT	145.313	271.335	0,02 %
Global Brands Group Holding Ltd.	1.107.000	90.630	0,01 %	C&C Group plc	76.979	263.443	0,02 %
Mason Group Holdings Ltd.	5.440.400	89.777	0,01 %	Irish Continental Group plc	35.594	246.190	0,02 %
Freeman FinTech Corp., Ltd.	1.330.000	88.470	0,01 %	Origin Enterprises plc	28.440	216.516	0,01 %
Texwinca Holdings Ltd.	160.000	88.010	0,01 %	Irish Residential Properties plc REIT	81.721	147.196	0,01 %
Lai Sun Development Co., Ltd.	49.385	84.021	0,01 %	Permanent TSB Group Holdings plc	32.837	88.719	0,01 %
Langham Hospitality Investments & Langham Hospitality Investments Ltd.	192.000	83.998	0,01 %			6.585.096	0,46 %
Camsing International Holding Ltd.	96.000	80.805	0,01 %	Israel 0,58 % (2016: 0,46 %)			
China LNG Group Ltd.	485.750	79.536	0,01 %	Israel Discount Bank Ltd. Klasse A	263.274	766.696	0,05 %
Sa Sa International Holdings Ltd.	205.826	79.252	0,01 %	Tower Semiconductor Ltd.	21.071	725.301	0,05 %
O Luxe Holdings Ltd.	384.000	78.595	0,01 %	Mellanox Technologies Ltd.	10.365	670.615	0,05 %
				Orbotech Ltd.	9.983	501.546	0,03 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Paz Oil Co., Ltd.	1.609	279.008	0,02 %	Azimut Holding SpA	25.675	492.364	0,03 %
Alony Hetz Properties & Investments Ltd.	24.245	260.842	0,02 %	Interpump Group SpA	15.518	488.584	0,03 %
First International Bank Of Israel Ltd.	12.068	250.839	0,02 %	DiaSorin SpA	5.063	449.894	0,03 %
Mazor Robotics Ltd.	9.125	248.203	0,02 %	Yoox Net-A-Porter Group SpA	12.371	432.580	0,03 %
Gazit-Globe Ltd.	21.408	227.668	0,02 %	Banca Generali SpA	12.693	422.806	0,03 %
Airport City Ltd.	17.252	216.666	0,02 %	Mediaset SpA	108.503	420.838	0,03 %
Strauss Group Ltd.	10.078	216.559	0,02 %	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	55.337	411.982	0,03 %
Harel Insurance Investments & Financial Services Ltd.	25.231	185.182	0,01 %	de' Longhi SpA	13.321	403.575	0,03 %
Amot Investments Ltd.	29.704	178.396	0,01 %	Autogrill SpA	29.204	403.284	0,03 %
Melison Ltd.	3.724	176.565	0,01 %	Unipol Gruppo SpA	85.302	400.504	0,03 %
Partner Communications Co., Ltd.	28.029	175.280	0,01 %	Buzzi Unicem SpA	14.810	400.137	0,03 %
Delek Group Ltd.	1.067	173.067	0,01 %	Iren SpA	132.571	397.978	0,03 %
Reit 1 Ltd. REIT	37.395	162.758	0,01 %	Banca Popolare di Sondrio SCPA	99.266	362.841	0,03 %
Oil Refineries Ltd.	336.596	161.431	0,01 %	Societa Cattolica di Assicurazioni SC	33.053	359.195	0,02 %
Nova Measuring Instruments Ltd.	5.671	149.581	0,01 %	Anima Holding SpA	49.958	357.538	0,02 %
Ituran Location & Control Ltd.	4.328	148.018	0,01 %	Societa Iniziative Autostradali e Servizi SpA	18.335	341.699	0,02 %
Cellcom Israel Ltd.	12.868	133.030	0,01 %	Enav SpA	61.030	330.515	0,02 %
Israel Corp., Ltd.	733	124.340	0,01 %	Amplifon SpA	20.965	323.244	0,02 %
Brack Capital Properties NV	1.024	118.515	0,01 %	Industria Macchine Automatiche SpA	3.817	310.758	0,02 %
Jerusalem Oil Exploration	1.910	116.636	0,01 %	Salvatore Ferragamo SpA	11.569	307.709	0,02 %
Kornit Digital Ltd.	6.855	110.708	0,01 %	ASTM SpA	10.401	302.621	0,02 %
Jerusalem Economy Ltd.	39.121	108.247	0,01 %	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	63.156	296.829	0,02 %
IDI Insurance Co., Ltd.	1.608	107.736	0,01 %	OVS SpA	44.312	295.581	0,02 %
Electra Ltd.	406	98.236	0,01 %	Saras SpA	107.437	258.537	0,02 %
Shikun & Binui Ltd.	43.765	97.687	0,01 %	ERG SpA	13.687	253.104	0,02 %
Bayside Land Corp.	195	97.454	0,01 %	Ei Towers SpA	3.882	249.390	0,02 %
Migdal Insurance & Financial Holding Ltd.	84.248	94.619	0,01 %	Brunello Cucinelli SpA	7.050	228.657	0,02 %
Shufersal Ltd.	14.181	94.359	0,01 %	Banca IFIS SpA	4.646	227.452	0,02 %
Matrix IT Ltd.	6.776	85.489	0,01 %	ACEA SpA	12.047	222.777	0,02 %
Shapir Engineering & Industry Ltd.	19.795	79.598	0,01 %	Reply SpA	3.980	220.655	0,02 %
Rami Levy Chain Stores Hashikma Marketing 2006 Ltd.	1.486	79.016	0,01 %	Technogym SpA	21.373	207.242	0,01 %
Big Shopping Centers Ltd.	1.133	78.783	0,01 %	Beni Stabili SpA SIIQ REIT	215.540	199.550	0,01 %
Kenon Holdings Ltd.	3.646	77.916	0,01 %	MARR SpA	7.449	192.491	0,01 %
Clal Insurance Enterprises Holdings Ltd.	4.010	72.365	0,00 %	Buzzi Unicem SpA-RSP	12.288	187.837	0,01 %
Phoenix Holdings Ltd.	12.138	66.675	0,00 %	Datalogic SpA	4.753	175.902	0,01 %
Delta-Galil Industries Ltd.	1.907	66.356	0,00 %	Tod's SpA	2.390	174.778	0,01 %
Africa Israel Properties Ltd.	2.596	64.226	0,00 %	Fincantieri SpA	111.859	168.169	0,01 %
Formula Systems 1985 Ltd.	1.492	62.230	0,00 %	Biesse SpA	3.256	165.385	0,01 %
Menora Mivtachim Holdings Ltd.	4.901	62.116	0,00 %	Salini Impregilo SpA	38.768	149.806	0,01 %
Blue Square Real Estate Ltd.	1.454	60.855	0,00 %	doBank SpA	9.116	148.325	0,01 %
Sapiens International Corp. NV	5.149	59.563	0,00 %	Credito Emiliano SpA	16.971	144.180	0,01 %
Delek Automotive Systems Ltd.	7.267	54.424	0,00 %	Maire Tecnimont SpA	26.727	138.581	0,01 %
Norstar Holdings, Inc.	2.203	45.181	0,00 %	RAI Way SpA	22.227	135.453	0,01 %
B Communications Ltd.	2.425	44.467	0,00 %	Banca Farmafactoring SpA	16.223	124.676	0,01 %
Naphtha Israel Petroleum Corp., Ltd.	5.959	42.397	0,00 %	Danieli & C Officine Meccaniche SpA - RSP	7.248	120.629	0,01 %
El Al Israel Airlines	67.653	28.198	0,00 %	Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA REIT	98.332	113.826	0,01 %
		8.305.643	0,58 %	Italmobiliare SpA	3.619	103.645	0,01 %
Italien 1,63 % (2016: 1,40 %)				Piaggio & C SpA	36.774	101.564	0,01 %
Moncler SpA	36.960	1.157.471	0,08 %	Fila SpA	4.109	97.103	0,01 %
Banco BPM SpA	349.585	1.099.828	0,08 %	Tamburi Investment Partners SpA	14.481	96.595	0,01 %
Unione di Banche Italiane SpA	229.345	1.004.099	0,07 %	CIR-Compagnie Industriali Riunite SpA	65.460	91.574	0,01 %
FinecoBank Banca Fineco SpA	88.547	907.503	0,06 %	Danieli & C Officine Meccaniche SpA	3.818	90.822	0,01 %
Italgas SpA	106.569	651.357	0,05 %	Juventus Football Club SpA	98.731	90.636	0,01 %
A2A SpA	351.174	650.246	0,05 %	Cementir Holding SpA	9.460	85.765	0,01 %
Saipem SpA	134.684	615.539	0,04 %	Vittoria Assicurazioni SpA	5.927	84.836	0,01 %
Hera SpA	164.018	573.133	0,04 %	Ascopiave SpA	18.773	79.936	0,01 %
Cerved Information Solutions SpA	43.960	559.544	0,04 %	Cairo Communication SpA	17.296	77.053	0,01 %
BPER Banca	108.838	550.216	0,04 %	Banca Carige SpA	7.666.114	74.564	0,01 %
Banca Mediolanum SpA	57.448	497.716	0,03 %	Arnoldo Mondadori Editore SpA	29.182	72.957	0,01 %
Brembo SpA	32.481	494.170	0,03 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens
Falck Renewables SpA	25.139	65.506	0,00 %	Dowa Holdings Co., Ltd.	12.500	510.431	0,04 %
El.En. SpA	2.063	64.483	0,00 %	Seria Co., Ltd.	8.400	507.057	0,04 %
La Doria SpA	3.232	63.609	0,00 %	Chugoku Bank Ltd.	37.900	507.016	0,04 %
Bio On SpA	1.750	60.962	0,00 %	Glory Ltd.	13.400	506.143	0,04 %
Geox SpA	16.554	57.487	0,00 %	Kenedix Office Investment Corp.			
Aeroporto Guglielmo Marconi Di Bologna SpA	2.729	52.563	0,00 %	REIT Klasse A	89	505.637	0,04 %
Zignago Vetro SpA	4.848	47.387	0,00 %	Sankyu, Inc.	11.692	504.941	0,04 %
Sogefi SpA	8.793	42.340	0,00 %	Tokyo Century Corp.	10.339	502.036	0,03 %
Prima Industrie SpA	983	39.897	0,00 %	Izumi Co., Ltd.	8.050	501.651	0,03 %
Safilo Group SpA	6.528	37.360	0,00 %	Horiba Ltd.	8.321	501.550	0,03 %
Credito Valtellinese SpA	22.352	32.557	0,00 %	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd.	19.400	494.084	0,03 %
GEDI Gruppo Editoriale SpA	36.216	30.507	0,00 %	SCSK Corp.	10.686	493.273	0,03 %
DeA Capital SpA	15.600	25.270	0,00 %	Gunma Bank Ltd.	81.300	492.202	0,03 %
Astaldi SpA	9.155	23.306	0,00 %	Kinden Corp.	29.900	487.849	0,03 %
				Topcon Corp.	22.476	486.232	0,03 %
		23.471.564	1,63 %	Fujikura Ltd.	54.800	483.544	0,03 %
Japan 12,50 % (2016: 11,60 %)				Kyowa Exeo Corp.	18.599	481.609	0,03 %
Showa Denko KK	30.400	1.299.387	0,09 %	Sotetsu Holdings, Inc.	18.300	481.015	0,03 %
Pigeon Corp.	25.958	988.547	0,07 %	Nipro Corp.	32.300	479.411	0,03 %
Haseko Corp.	60.300	937.286	0,07 %	Zenkoku Hoshu Co., Ltd.	11.050	475.253	0,03 %
Square Enix Holdings Co., Ltd.	19.400	923.071	0,06 %	Tokuyama Corp.	14.500	472.392	0,03 %
CyberAgent, Inc.	23.000	898.358	0,06 %	DMG Mori Co., Ltd.	22.750	470.752	0,03 %
Sojitz Corp.	283.900	871.988	0,06 %	Nippon Kayaku Co., Ltd.	31.500	467.537	0,03 %
Nippon Shinyaku Co., Ltd.	11.132	831.071	0,06 %	Citizen Watch Co., Ltd.	63.600	466.908	0,03 %
Ebara Corp.	21.400	815.917	0,06 %	Itochu Techno-Solutions Corp.	10.700	464.474	0,03 %
Orix JREIT, Inc. REIT	573	794.011	0,06 %	Kyudenko Corp.	9.599	464.399	0,03 %
SCREEN Holdings Co., Ltd.	9.300	761.172	0,05 %	Welcia Holdings Co., Ltd.	10.690	462.142	0,03 %
Furukawa Electric Co., Ltd.	15.350	757.621	0,05 %	Toyo Tire & Rubber Co., Ltd.	22.195	458.677	0,03 %
Denka Co., Ltd.	18.500	741.478	0,05 %	NTN Corp.	92.000	456.529	0,03 %
Mitsui Mining & Smelting Co., Ltd.	12.600	737.097	0,05 %	House Foods Group, Inc.	13.750	456.502	0,03 %
Kobayashi Pharmaceutical Co., Ltd.	11.200	727.776	0,05 %	Penta-Ocean Construction Co., Ltd.	60.947	454.465	0,03 %
Matsumotokiyoshi Holdings Co., Ltd.	17.300	712.579	0,05 %	MonotaRO Co., Ltd.	14.200	453.795	0,03 %
Advance Residence Investment Corp. REIT	288	708.431	0,05 %	Cosmo Energy Holdings Co., Ltd.	12.000	453.262	0,03 %
NIHON M&A Center, Inc.	14.700	700.746	0,05 %	Japan Steel Works Ltd.	14.000	450.510	0,03 %
COMSYS Holdings Corp.	24.150	699.953	0,05 %	Ito En Ltd.	11.400	449.321	0,03 %
Asahi Intecc Co., Ltd.	20.200	695.748	0,05 %	Iyo Bank Ltd.	55.700	446.490	0,03 %
DIC Corp.	18.150	686.365	0,05 %	TS Tech Co., Ltd.	10.848	446.342	0,03 %
Nichirei Corp.	24.750	684.388	0,05 %	Sugi Holdings Co., Ltd.	8.645	441.267	0,03 %
Ube Industries Ltd.	23.050	678.302	0,05 %	Sapporo Holdings Ltd.	14.400	441.012	0,03 %
Nifco, Inc.	9.645	658.411	0,05 %	Jafco Co., Ltd.	7.600	440.550	0,03 %
Advantest Corp.	35.100	651.523	0,05 %	Hokuhoku Financial Group, Inc.	28.100	439.522	0,03 %
Relo Group, Inc.	23.600	643.160	0,04 %	Nippon Paper Industries Co., Ltd.	23.050	438.288	0,03 %
Sanwa Holdings Corp.	46.550	641.328	0,04 %	Nisshinbo Holdings, Inc.	32.331	438.255	0,03 %
GLP J-Reit REIT	585	633.036	0,04 %	Morinaga & Co., Ltd.	8.630	437.437	0,03 %
Kewpie Corp.	23.550	628.209	0,04 %	Tsumura & Co.	13.150	437.166	0,03 %
Nankai Electric Railway Co., Ltd.	24.800	614.661	0,04 %	Nagase & Co., Ltd.	24.076	434.287	0,03 %
Kagome Co., Ltd.	16.532	614.172	0,04 %	Leopalace21 Corp.	55.550	431.973	0,03 %
TIS, Inc.	17.529	612.309	0,04 %	Sumitomo Osaka Cement Co., Ltd.	89.500	431.411	0,03 %
Azbil Corp.	14.050	609.893	0,04 %	K's Holdings Corp.	16.698	428.234	0,03 %
Japan Hotel Investment Corp.				Takara Holdings, Inc.	36.350	424.648	0,03 %
REIT Klasse A	875	587.217	0,04 %	Aica Kogyo Co., Ltd.	11.393	423.255	0,03 %
PeptiDream, Inc.	17.000	582.512	0,04 %	NOF Corp.	15.711	421.889	0,03 %
Miraca Holdings, Inc.	13.500	578.229	0,04 %	Shikoku Electric Power Co., Inc.	38.500	419.689	0,03 %
Activia Properties, Inc. REIT	138	578.216	0,04 %	Maeda Corp.	30.244	417.214	0,03 %
Rohto Pharmaceutical Co., Ltd.	21.067	562.909	0,04 %	Resorttrust, Inc.	18.194	413.625	0,03 %
Ulvac, Inc.	8.850	557.790	0,04 %	Cosmos Pharmaceutical Corp.	1.978	413.159	0,03 %
Zeon Corp.	38.500	557.421	0,04 %	Nippon Accommodations Fund, Inc. REIT	100	412.783	0,03 %
Miura Co., Ltd.	20.495	551.264	0,04 %	Daido Steel Co., Ltd.	6.700	412.765	0,03 %
Sumitomo Forestry Co., Ltd.	30.750	550.306	0,04 %	Nihon Kohden Corp.	17.769	412.481	0,03 %
Hiroshima Bank Ltd.	62.400	543.403	0,04 %	H2O Retailing Corp.	19.507	408.495	0,03 %
Tokai Carbon Co., Ltd.	43.234	535.388	0,04 %	Daiwa Office Investment Corp. REIT	77	406.019	0,03 %
NHK Spring Co., Ltd.	48.000	528.362	0,04 %	Nishi-Nippon Railroad Co., Ltd.	15.000	404.794	0,03 %
Seino Holdings Co., Ltd.	32.850	521.984	0,04 %	Frontier Real Estate Investment Corp. REIT	104	404.368	0,03 %
Ezaki Glico Co., Ltd.	10.400	518.846	0,04 %	TechnoPro Holdings, Inc.	7.400	402.024	0,03 %
				Fuji Oil Holdings, Inc.	13.631	398.705	0,03 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Nippon Shokubai Co., Ltd.	5.900	398.571	0,03 %	Yamato Kogyo Co., Ltd.	10.550	306.713	0,02 %
Invincible Investment Corp. REIT	934	397.561	0,03 %	Toagosei Co., Ltd.	24.052	306.388	0,02 %
Toda Corp.	49.500	397.230	0,03 %	Capcom Co., Ltd.	9.609	304.946	0,02 %
Mori Hills Investment Corp. REIT	326	394.152	0,03 %	Fujitsu General Ltd.	13.824	303.600	0,02 %
Sosei Group Corp.	4.050	393.316	0,03 %	Nippon Gas Co., Ltd.	8.350	303.535	0,02 %
Daiichikoshō Co., Ltd.	7.878	393.026	0,03 %	Outsourcing, Inc.	16.500	300.852	0,02 %
Open House Co., Ltd.	7.250	390.013	0,03 %	Premier Investment Corp. REIT	317	299.975	0,02 %
77 Bank Ltd.	15.400	389.067	0,03 %	Hokuriku Electric Power Co.	37.100	298.710	0,02 %
GS Yuasa Corp.	78.000	388.442	0,03 %	Maruha Nichiro Corp.	9.877	298.107	0,02 %
Pilot Corp.	8.000	386.329	0,03 %	Meitec Corp.	5.650	296.920	0,02 %
Nishi-Nippon Financial Holdings, Inc.	32.200	385.886	0,03 %	Ci:z Holdings Co., Ltd.	5.800	296.050	0,02 %
Nippon Light Metal Holdings Co., Ltd.	134.250	382.550	0,03 %	Trusco Nakayama Corp.	10.142	295.752	0,02 %
Morinaga Milk Industry Co., Ltd.	8.403	380.429	0,03 %	Hitachi Capital Corp.	11.750	295.706	0,02 %
Tadano Ltd.	22.745	377.771	0,03 %	Mitsui Engineering & Shipbuilding Co., Ltd.	19.600	293.696	0,02 %
OSG Corp.	17.250	373.635	0,03 %	Japan Excellent, Inc. REIT	252	293.273	0,02 %
ADEKA Corp.	21.188	373.353	0,03 %	San-In Godo Bank Ltd.	30.300	292.644	0,02 %
Anritsu Corp.	32.600	368.685	0,03 %	Nishimatsu Construction Co., Ltd.	10.400	291.735	0,02 %
Harmonic Drive Systems, Inc.	6.300	368.549	0,03 %	Mandom Corp.	8.838	289.893	0,02 %
Zensho Holdings Co., Ltd.	21.398	367.935	0,03 %	Kyoritsu Maintenance Co., Ltd.	7.084	286.441	0,02 %
Hanwa Co., Ltd.	7.939	367.174	0,03 %	Daishi Bank Ltd.	6.250	284.621	0,02 %
Ushio, Inc.	25.650	366.819	0,03 %	NET One Systems Co., Ltd.	18.500	284.439	0,02 %
Sawai Pharmaceutical Co., Ltd.	8.195	366.647	0,03 %	Japan Rental Housing Investments, Inc. REIT	387	282.391	0,02 %
Aoyama Trading Co., Ltd.	9.800	366.249	0,03 %	PALTAC Corp.	6.175	281.753	0,02 %
Nihon Parkerizing Co., Ltd.	21.673	365.738	0,03 %	NTT Urban Development Corp.	23.800	275.501	0,02 %
OKUMA Corp.	5.500	365.690	0,03 %	Rengo Co., Ltd.	37.481	273.829	0,02 %
Mitsubishi Logistics Corp.	14.000	363.515	0,03 %	en-japan, Inc.	5.800	273.395	0,02 %
Wacoal Holdings Corp.	11.500	363.427	0,03 %	Chiyo-da Corp.	37.100	273.351	0,02 %
Taiyo Yuden Co., Ltd.	23.250	362.423	0,03 %	Noevir Holdings Co., Ltd.	3.650	270.874	0,02 %
Ain Holdings, Inc.	6.055	361.741	0,03 %	Inaba Denki Sangyo Co., Ltd.	5.776	269.701	0,02 %
Shochiku Co., Ltd.	2.103	358.994	0,03 %	Oki Electric Industry Co., Ltd.	19.150	268.763	0,02 %
Ibiden Co., Ltd.	23.900	357.917	0,02 %	Itoham Yonekyu Holdings, Inc.	29.355	268.664	0,02 %
Toyobo Co., Ltd.	19.650	357.067	0,02 %	Nichiha Corp.	6.349	266.303	0,02 %
Kokuyo Co., Ltd.	19.150	355.801	0,02 %	Nippo Corp.	11.376	266.298	0,02 %
Nihon Unisys Ltd.	17.078	355.659	0,02 %	LaSalle Logiport REIT	259	265.093	0,02 %
Nihon Corp.	26.520	353.365	0,02 %	GMO internet, Inc.	15.539	264.432	0,02 %
Nikkon Holdings Co., Ltd.	12.529	353.125	0,02 %	Lintec Corp.	9.400	262.432	0,02 %
Amano Corp.	13.450	351.861	0,02 %	Shimachu Co., Ltd.	9.100	262.135	0,02 %
AEON Investment Corp. REIT	334	351.345	0,02 %	CKD Corp.	11.623	261.866	0,02 %
Maeda Road Construction Co., Ltd.	15.276	350.541	0,02 %	cocokara fine, Inc.	4.036	260.826	0,02 %
Tokyo Ohka Kogyo Co., Ltd.	8.070	348.518	0,02 %	Sekisui House Reit, Inc. REIT	223	260.513	0,02 %
Skylark Co., Ltd.	24.450	347.921	0,02 %	Fuji Machine Manufacturing Co., Ltd.	13.527	259.973	0,02 %
Japan Logistics Fund, Inc. REIT	186	343.105	0,02 %	Hokkaido Electric Power Co., Inc.	39.200	258.202	0,02 %
Ariake Japan Co., Ltd.	4.000	341.589	0,02 %	Okumura Corp.	6.200	255.375	0,02 %
Kaken Pharmaceutical Co., Ltd.	6.600	340.985	0,02 %	Hyakugo Bank Ltd.	53.500	255.033	0,02 %
Hulic Reit, Inc. REIT	232	337.754	0,02 %	Tomy Co., Ltd.	18.650	253.633	0,02 %
HIS Co., Ltd.	9.301	337.280	0,02 %	Sangetsu Corp.	13.736	253.259	0,02 %
Sumitomo Bakelite Co., Ltd.	40.000	336.618	0,02 %	Sekisui House Residential Investment Corp. REIT	253	252.888	0,02 %
Tokai Tokyo Financial Holdings, Inc.	51.814	334.388	0,02 %	Toho Holdings Co., Ltd.	11.139	251.950	0,02 %
Megmilk Snow Brand Co., Ltd.	11.283	334.033	0,02 %	Tsubakimoto Chain Co.	31.171	251.803	0,02 %
Toyota Boshoku Corp.	15.850	331.914	0,02 %	Fuyo General Lease Co., Ltd.	3.791	251.387	0,02 %
Shima Seiki Manufacturing Ltd.	5.250	331.824	0,02 %	Iriso Electronics Co., Ltd.	4.200	250.919	0,02 %
Canon Marketing Japan, Inc.	12.250	331.125	0,02 %	Colowide Co., Ltd.	12.276	248.244	0,02 %
Ship Healthcare Holdings, Inc.	9.950	329.900	0,02 %	Round One Corp.	14.730	247.919	0,02 %
Kenedix, Inc.	53.850	329.840	0,02 %	Hitachi Transport System Ltd.	9.493	247.501	0,02 %
Tokyo Seimitsu Co., Ltd.	8.300	328.611	0,02 %	KYB Corp.	4.225	247.162	0,02 %
Hazama Ando Corp.	41.750	326.884	0,02 %	Fukuyama Transporting Co., Ltd.	6.500	245.806	0,02 %
Nippon Suisan Kaisha Ltd.	62.312	325.804	0,02 %	Tokyu, Inc. REIT	197	244.829	0,02 %
SHO-BOND Holdings Co., Ltd.	4.568	325.620	0,02 %	Aiful Corp.	70.350	241.682	0,02 %
Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp. REIT	75	322.237	0,02 %	NIPPON Investment Corp. REIT	84	241.225	0,02 %
Fuji Seal International, Inc.	9.754	319.072	0,02 %	SMS Co., Ltd.	7.600	239.503	0,02 %
FP Corp.	5.854	314.396	0,02 %	Sakata Seed Corp.	6.871	238.487	0,02 %
GMO Payment Gateway, Inc.	3.800	314.390	0,02 %	Kureha Corp.	3.282	238.320	0,02 %
Autobacs Seven Co., Ltd.	16.240	311.681	0,02 %	Iwatani Corp.	7.383	237.908	0,02 %
Bic Camera, Inc.	21.350	307.978	0,02 %	Awa Bank Ltd.	37.000	236.156	0,02 %
Mori Trust Sogo Reit, Inc. REIT	221	307.615	0,02 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Yoshinoya Holdings Co., Ltd.	13.800	234.349	0,02 %	Nippon Soda Co., Ltd.	29.521	197.069	0,01 %
Fancl Corp.	7.920	234.120	0,02 %	Token Corp.	1.666	196.992	0,01 %
Nachi-Fujikoshi Corp.	34.836	233.786	0,02 %	Alpine Electronics, Inc.	9.491	196.560	0,01 %
Hoshino Resorts, Inc. REIT	48	233.076	0,02 %	Topre Corp.	6.924	196.380	0,01 %
Makino Milling Machine Co., Ltd.	22.957	232.525	0,02 %	Sanrio Co., Ltd.	11.700	195.883	0,01 %
Sumitomo Mitsui Construction Co., Ltd.	41.440	231.387	0,02 %	Mochida Pharmaceutical Co., Ltd.	2.550	195.353	0,01 %
Nakanishi, Inc.	4.400	229.667	0,02 %	Komori Corp.	13.850	194.994	0,01 %
Kenedix Residential Investment Corp. REIT	79	229.321	0,02 %	Matsui Securities Co., Ltd.	23.000	194.168	0,01 %
Duskin Co., Ltd.	8.686	229.236	0,02 %	Obara Group, Inc.	2.826	193.919	0,01 %
GungHo Online Entertainment, Inc.	83.300	229.232	0,02 %	Starts Corp., Inc.	7.350	192.477	0,01 %
Kotobuki Spirits Co., Ltd.	4.100	228.566	0,02 %	Kanamoto Co., Ltd.	6.200	192.357	0,01 %
Kumagai Gumi Co., Ltd.	8.150	227.896	0,02 %	Asahi Holdings, Inc.	10.211	191.892	0,01 %
Tokai Rika Co., Ltd.	10.800	227.409	0,02 %	Yaoko Co., Ltd.	3.900	190.413	0,01 %
Comforia Residential, Inc. REIT	106	226.679	0,02 %	United Arrows Ltd.	4.681	190.107	0,01 %
Toyo Ink SC Holdings Co., Ltd.	37.734	223.423	0,02 %	DCM Holdings Co., Ltd.	20.367	189.839	0,01 %
Kenedix Retail Corp. REIT	108	223.382	0,02 %	Ichigo, Inc.	49.900	189.146	0,01 %
Tsubaki Nakashima Co., Ltd.	9.362	223.142	0,02 %	Aeon Delight Co., Ltd.	5.036	188.654	0,01 %
Kanematsu Corp.	16.070	222.255	0,02 %	As One Corp.	3.000	188.016	0,01 %
Nissha Co., Ltd.	7.600	221.287	0,02 %	Seiko Holdings Corp.	6.447	187.716	0,01 %
Shiga Bank Ltd.	43.000	220.249	0,02 %	Sanken Electric Co., Ltd.	26.000	187.643	0,01 %
Nissin Kogyo Co., Ltd.	10.977	217.591	0,02 %	Bank of Okinawa Ltd.	4.600	187.430	0,01 %
Prima Meat Packers Ltd.	29.606	217.347	0,02 %	Exedy Corp.	6.040	186.857	0,01 %
MCUBS MidCity Investment Corp. REIT	325	216.378	0,02 %	Meidensha Corp.	45.138	186.723	0,01 %
Okamura Corp.	14.758	215.769	0,02 %	San-A Co., Ltd.	3.856	186.553	0,01 %
Unipres Corp.	8.002	215.589	0,02 %	Hirata Corp.	1.800	186.152	0,01 %
Lasertec Corp.	8.500	214.745	0,02 %	Nomura Co., Ltd.	8.100	185.081	0,01 %
Nippon Seiki Co., Ltd.	9.954	213.748	0,01 %	Ai Holdings Corp.	7.650	184.917	0,01 %
Nisshin Steel Co., Ltd.	13.000	213.724	0,01 %	Keihin Corp.	9.080	184.905	0,01 %
Nippon Steel & Sumikin Bussan Corp.	3.516	213.488	0,01 %	Ogaki Kyoritsu Bank Ltd.	7.300	184.622	0,01 %
Heiwa Corp.	11.350	213.197	0,01 %	Global One Real Estate Investment Corp. REIT	52	184.412	0,01 %
Hokkoku Bank Ltd.	5.350	213.003	0,01 %	Fujitec Co., Ltd.	12.763	184.336	0,01 %
Keiyo Bank Ltd.	46.500	212.996	0,01 %	Kato Sangyo Co., Ltd.	5.021	184.081	0,01 %
Mitsubishi Pencil Co., Ltd.	9.692	212.338	0,01 %	Toshiba Plant Systems & Services Corp.	9.841	183.629	0,01 %
Onward Holdings Co., Ltd.	24.500	212.268	0,01 %	Paramount Bed Holdings Co., Ltd.	3.698	183.177	0,01 %
Joyful Honda Co., Ltd.	6.800	211.576	0,01 %	Piolax, Inc.	6.150	182.890	0,01 %
Optex Group Co., Ltd.	4.000	211.274	0,01 %	Tokyo Dome Corp.	17.967	181.823	0,01 %
Okinawa Electric Power Co., Inc.	8.095	210.980	0,01 %	Nitto Boseki Co., Ltd.	6.286	181.354	0,01 %
Kandenko Co., Ltd.	20.000	210.564	0,01 %	Toshiba Machine Co., Ltd.	24.253	181.063	0,01 %
Japan Lifeline Co., Ltd.	10.000	209.143	0,01 %	Senshu Ikeda Holdings, Inc.	49.030	181.061	0,01 %
Saizeriya Co., Ltd.	6.239	208.797	0,01 %	Hokuetsu Kishu Paper Co., Ltd.	30.306	181.056	0,01 %
Ryosan Co., Ltd.	5.419	208.294	0,01 %	Komeri Co., Ltd.	6.250	180.870	0,01 %
North Pacific Bank Ltd.	62.050	208.210	0,01 %	Toridoll Holdings Corp.	4.850	180.826	0,01 %
NS Solutions Corp.	7.600	208.131	0,01 %	Central Glass Co., Ltd.	8.500	180.790	0,01 %
Arcs Co., Ltd.	8.865	206.811	0,01 %	Wacom Co., Ltd.	33.350	180.590	0,01 %
Takuma Co., Ltd.	14.700	205.917	0,01 %	EDION Corp.	15.450	179.941	0,01 %
Daiseki Co., Ltd.	7.390	205.660	0,01 %	Hogy Medical Co., Ltd.	2.362	179.063	0,01 %
Daio Paper Corp.	15.389	203.547	0,01 %	Ichigo Office Investment REIT	260	178.411	0,01 %
Kiyo Bank Ltd.	12.214	203.296	0,01 %	Tokyo Steel Manufacturing Co., Ltd.	19.850	178.324	0,01 %
Daihen Corp.	21.440	203.266	0,01 %	Chudenko Corp.	6.094	177.437	0,01 %
Heiwa Real Estate, Inc. REIT Klasse Series C	244	202.738	0,01 %	Eiken Chemical Co., Ltd.	3.700	177.364	0,01 %
Seiren Co., Ltd.	10.321	202.205	0,01 %	Musashino Bank Ltd.	5.300	177.137	0,01 %
Hitachi Zosen Corp.	38.245	201.325	0,01 %	KOMEDA Holdings Co., Ltd.	9.600	176.746	0,01 %
Financial Products Group Co., Ltd.	16.550	201.127	0,01 %	Hosiden Corp.	11.963	176.710	0,01 %
Tokyo Broadcasting System Holdings, Inc.	8.050	201.089	0,01 %	Nitta Corp.	4.584	176.605	0,01 %
Digital Garage, Inc.	7.600	200.913	0,01 %	Sushiro Global Holdings Ltd.	4.400	176.352	0,01 %
Gunze Ltd.	3.500	200.399	0,01 %	Mirait Holdings Corp.	11.843	176.305	0,01 %
Takasago Thermal Engineering Co., Ltd.	10.863	199.131	0,01 %	Totetsu Kogyo Co., Ltd.	5.300	175.961	0,01 %
Fukuoka Corp. REIT	133	198.585	0,01 %	Nippon Sheet Glass Co., Ltd.	19.350	175.894	0,01 %
Toshiba TEC Corp.	31.500	198.535	0,01 %	Takeuchi Manufacturing Co., Ltd.	7.400	175.853	0,01 %
Okasan Securities Group, Inc.	32.000	198.278	0,01 %	Valor Holdings Co., Ltd.	7.491	175.156	0,01 %
Sumitomo Warehouse Co., Ltd.	27.341	198.049	0,01 %	MOS Food Services, Inc.	5.720	174.672	0,01 %
				Nissan Shatai Co., Ltd.	17.037	174.227	0,01 %
				NSD Co., Ltd.	8.159	174.117	0,01 %
				Funai Soken Holdings, Inc.	7.770	174.092	0,01 %
				Japan Aviation Electronics Industry Ltd.	10.217	172.959	0,01 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
UACJ Corp.	6.600	172.543	0,01 %	Toei Co., Ltd.	1.466	148.227	0,01 %
FCC Co., Ltd.	6.540	172.020	0,01 %	Sanyo Chemical Industries Ltd.	2.829	148.168	0,01 %
Belc Co., Ltd.	2.850	171.784	0,01 %	Heiwa Real Estate Co., Ltd.	8.200	147.913	0,01 %
Senko Group Holdings Co., Ltd.	23.696	171.225	0,01 %	Daibiru Corp.	11.702	147.509	0,01 %
Fuji Soft, Inc.	5.300	170.315	0,01 %	Takara Bio, Inc.	10.550	147.410	0,01 %
Pacific Industrial Co., Ltd.	10.950	170.204	0,01 %	Idec Corp.	6.182	147.292	0,01 %
Kissei Pharmaceutical Co., Ltd.	6.000	170.173	0,01 %	Hyakujushi Bank Ltd.	44.000	146.081	0,01 %
Nisshin Oil Group Ltd.	5.606	169.947	0,01 %	DTS Corp.	4.480	145.953	0,01 %
Juroku Bank Ltd.	5.750	169.463	0,01 %	V Technology Co., Ltd.	900	145.886	0,01 %
Zenrin Co., Ltd.	5.027	169.352	0,01 %	Yamagata Bank Ltd.	6.665	145.547	0,01 %
Invesco Office J-Reit, Inc. REIT	174	169.135	0,01 %	Dexerials Corp.	11.200	145.058	0,01 %
KYORIN Holdings, Inc.	9.007	168.866	0,01 %	JINS, Inc.	2.750	145.007	0,01 %
Royal Holdings Co., Ltd.	6.110	168.411	0,01 %	Kumiai Chemical Industry Co., Ltd.	21.458	144.577	0,01 %
San-Ai Oil Co., Ltd.	11.546	168.193	0,01 %	Kameda Seika Co., Ltd.	3.150	144.567	0,01 %
Atom Corp.	20.200	167.840	0,01 %	Pioneer Corp.	71.150	144.005	0,01 %
Ferrotec Holdings Corp.	8.200	167.421	0,01 %	Siix Corp.	3.350	143.784	0,01 %
Tokyu Construction Co., Ltd.	17.175	167.405	0,01 %	Yamazen Corp.	12.163	143.494	0,01 %
Nippon Flour Mills Co., Ltd.	10.912	167.385	0,01 %	NEC Networks & System Integration Corp.	5.449	143.420	0,01 %
Mani, Inc.	5.495	167.313	0,01 %	Nichicon Corp.	10.950	143.376	0,01 %
Japan Material Co., Ltd.	4.600	167.013	0,01 %	Iino Kaiun Kaisha Ltd.	25.409	143.229	0,01 %
Taikisha Ltd.	4.926	166.605	0,01 %	Sakata INX Corp.	8.950	143.089	0,01 %
Kintetsu World Express, Inc.	8.026	166.434	0,01 %	Justsystems Corp.	7.500	142.876	0,01 %
Tsugami Corp.	12.912	166.200	0,01 %	Tokyo-tokeiba Co., Ltd.	3.769	142.697	0,01 %
Yokogawa Bridge Holdings Corp.	7.085	165.788	0,01 %	Benefit One, Inc.	6.800	142.399	0,01 %
JCR Pharmaceuticals Co., Ltd.	3.500	164.980	0,01 %	Gree, Inc.	22.550	141.726	0,01 %
Doutor Nichires Holdings Co., Ltd.	6.675	164.905	0,01 %	Ryobi Ltd.	4.983	141.550	0,01 %
Milbon Co., Ltd.	4.900	164.856	0,01 %	Futaba Corp.	6.750	140.932	0,01 %
Orient Corp.	102.900	164.421	0,01 %	Yuasa Trading Co., Ltd.	3.867	140.571	0,01 %
Yodogawa Steel Works Ltd.	5.281	163.610	0,01 %	Koa Corp.	6.775	140.011	0,01 %
Maxell Holdings Ltd.	7.650	163.458	0,01 %	Mitsui Fudosan Logistics Park, Inc. REIT	44	139.831	0,01 %
Universal Entertainment Corp.	4.437	163.458	0,01 %	Maruwa Co., Ltd.	2.078	139.271	0,01 %
Hitachi Kokusai Electric, Inc.	5.916	163.327	0,01 %	Daikyonishikawa Corp.	8.600	139.249	0,01 %
Japan Petroleum Exploration Co., Ltd.	6.150	163.127	0,01 %	Geo Holdings Corp.	7.150	138.684	0,01 %
Dip Corp.	6.300	162.855	0,01 %	Toho Bank Ltd.	39.419	138.570	0,01 %
EPS Holdings, Inc.	7.200	162.727	0,01 %	Musashi Seimitsu Industry Co., Ltd.	4.335	138.535	0,01 %
Descente Ltd.	9.414	162.708	0,01 %	Bunka Shutter Co., Ltd.	14.362	138.329	0,01 %
KH Neochem Co., Ltd.	6.300	161.345	0,01 %	Press Kogyo Co., Ltd.	22.787	138.158	0,01 %
Macnica Fuji Electronics Holdings, Inc.	7.386	161.095	0,01 %	Ricoh Leasing Co., Ltd.	3.986	137.997	0,01 %
Mitsui Sugar Co., Ltd.	3.809	160.948	0,01 %	Furukawa Co., Ltd.	6.715	137.817	0,01 %
Taiyo Holdings Co., Ltd.	3.582	159.624	0,01 %	Kurabo Industries Ltd.	42.413	137.800	0,01 %
ASKUL Corp.	5.600	158.828	0,01 %	IBJ Leasing Co., Ltd.	5.387	137.771	0,01 %
Eizo Corp.	3.351	157.957	0,01 %	OBIC Business Consultants Co., Ltd.	2.350	137.057	0,01 %
Shinmaywa Industries Ltd.	16.486	157.177	0,01 %	Fukushima Industries Corp.	3.100	136.906	0,01 %
Tokyo TY Financial Group, Inc.	5.411	156.830	0,01 %	Showa Corp.	10.991	136.692	0,01 %
Asahi Diamond Industrial Co., Ltd.	13.704	156.565	0,01 %	Heiwado Co., Ltd.	6.567	136.587	0,01 %
Sato Holdings Corp.	5.113	155.455	0,01 %	TOKAI Holdings Corp.	16.024	136.272	0,01 %
Nojima Corp.	6.500	155.446	0,01 %	Kitz Corp.	17.583	136.262	0,01 %
Nanto Bank Ltd.	5.750	154.660	0,01 %	Foster Electric Co., Ltd.	5.482	136.162	0,01 %
TOMONY Holdings, Inc.	29.978	154.347	0,01 %	Nippon Densetsu Kogyo Co., Ltd.	6.273	136.040	0,01 %
UT Group Co., Ltd.	5.300	154.083	0,01 %	Kadokawa Dwango Corp.	10.975	135.519	0,01 %
Create SD Holdings Co., Ltd.	5.698	153.009	0,01 %	Sanyo Denki Co., Ltd.	1.881	134.918	0,01 %
Daiwabo Holdings Co., Ltd.	3.711	152.690	0,01 %	SKY Perfect JSAT Holdings, Inc.	29.300	134.210	0,01 %
GNI Group Ltd.	29.000	152.659	0,01 %	Hankyu Reit, Inc. REIT	116	134.175	0,01 %
TPR Co., Ltd.	4.599	152.484	0,01 %	Prestige International, Inc.	10.500	133.941	0,01 %
Toppan Forms Co., Ltd.	13.450	152.350	0,01 %	T Hasegawa Co., Ltd.	6.400	133.511	0,01 %
Koei Tecmo Holdings Co., Ltd.	7.497	151.537	0,01 %	Shindengen Electric Manufacturing Co., Ltd.	1.682	133.037	0,01 %
Fuji Kyuko Co., Ltd.	5.250	151.232	0,01 %	Nissin Electric Co., Ltd.	11.358	132.182	0,01 %
Kusuri no Aoki Holdings Co., Ltd.	2.850	151.039	0,01 %	Xebio Holdings Co., Ltd.	6.932	131.994	0,01 %
Joshin Denki Co., Ltd.	4.232	150.646	0,01 %	TKC Corp.	3.600	131.824	0,01 %
Japan Display, Inc.	74.400	150.583	0,01 %	JVC Kenwood Corp.	38.342	131.721	0,01 %
Menicon Co., Ltd.	5.400	150.519	0,01 %	Nishimatsuya Chain Co., Ltd.	11.830	131.584	0,01 %
Sanki Engineering Co., Ltd.	12.345	150.244	0,01 %	Nittoku Engineering Co., Ltd.	3.100	131.403	0,01 %
Toho Zinc Co., Ltd.	2.754	149.618	0,01 %	Daikyo, Inc.	6.766	131.176	0,01 %
Kura Corp.	2.550	149.401	0,01 %	Arata Corp.	2.400	130.812	0,01 %
Earth Chemical Co., Ltd.	2.948	148.643	0,01 %				
Ishihara Sangyo Kaisha Ltd.	7.850	148.498	0,01 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
ZERIA Pharmaceutical Co., Ltd.	6.829	130.700	0,01 %	CMK Corp.	12.500	113.293	0,01 %
Nikkiso Co., Ltd.	11.885	129.875	0,01 %	LIFULL Co., Ltd.	12.600	112.746	0,01 %
Star Micronics Co., Ltd.	7.498	129.526	0,01 %	IDOM, Inc.	15.850	112.561	0,01 %
Fuji Co., Ltd.	5.994	129.245	0,01 %	Trancom Co., Ltd.	1.600	112.490	0,01 %
Ohsho Food Service Corp.	2.700	129.188	0,01 %	Kisoji Co., Ltd.	4.551	112.391	0,01 %
Koshidaka Holdings Co., Ltd.	2.750	128.895	0,01 %	Sanyo Special Steel Co., Ltd.	4.373	112.071	0,01 %
Chugoku Marine Paints Ltd.	15.357	128.554	0,01 %	Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co., Ltd.	6.350	111.949	0,01 %
Shibuya Corp.	3.100	128.513	0,01 %	United Super Markets Holdings, Inc.	11.021	111.922	0,01 %
Arcland Sakamoto Co., Ltd.	7.928	128.509	0,01 %	Noritake Co., Ltd.	2.201	111.564	0,01 %
Hiday Hidaka Corp.	4.168	127.648	0,01 %	Japan Securities Finance Co., Ltd.	19.663	111.537	0,01 %
YAMABIKO Corp.	8.000	126.906	0,01 %	Create Restaurants Holdings, Inc.	9.450	111.487	0,01 %
Macromill, Inc.	5.300	126.701	0,01 %	Chubu Shiryo Co., Ltd.	5.000	111.141	0,01 %
Nichi-iko Pharmaceutical Co., Ltd.	8.203	126.631	0,01 %	BML, Inc.	4.442	110.606	0,01 %
Transcosmos, Inc.	4.925	125.956	0,01 %	Wakita & Co., Ltd.	9.000	110.493	0,01 %
Inabata & Co., Ltd.	8.267	125.418	0,01 %	Shoei Foods Corp.	2.600	110.439	0,01 %
W-Scope Corp.	6.000	124.687	0,01 %	Shinko Plantech Co., Ltd.	10.383	110.236	0,01 %
Tocalo Co., Ltd.	2.769	123.640	0,01 %	Plenus Co., Ltd.	5.050	110.190	0,01 %
Infomart Corp.	20.600	123.070	0,01 %	Monex Group, Inc.	38.700	109.933	0,01 %
Sintokogio Ltd.	9.620	122.972	0,01 %	Clarion Co., Ltd.	29.553	109.922	0,01 %
Yamanashi Chuo Bank Ltd.	28.124	122.832	0,01 %	Shin-Etsu Polymer Co., Ltd.	9.711	109.825	0,01 %
Anicom Holdings, Inc.	3.800	122.619	0,01 %	Internet Initiative Japan, Inc.	6.000	109.667	0,01 %
Nagaileben Co., Ltd.	4.876	122.582	0,01 %	Tachi-S Co., Ltd.	5.975	109.422	0,01 %
Bank of the Ryukyus Ltd.	8.099	121.719	0,01 %	Nippon Signal Co., Ltd.	10.207	108.730	0,01 %
Shinko Electric Industries Co., Ltd.	15.000	121.704	0,01 %	Fujimori Kogyo Co., Ltd.	3.050	108.435	0,01 %
Aida Engineering Ltd.	9.903	121.315	0,01 %	Megachips Corp.	3.608	108.256	0,01 %
Oita Bank Ltd.	3.107	120.805	0,01 %	Topy Industries Ltd.	3.502	108.029	0,01 %
Aomori Bank Ltd.	3.800	120.763	0,01 %	Kohnan Shoji Co., Ltd.	4.994	107.815	0,01 %
Pepper Food Service Co., Ltd.	2.700	120.559	0,01 %	Adastria Co., Ltd.	5.310	107.426	0,01 %
TSI Holdings Co., Ltd.	16.350	120.466	0,01 %	Pressance Corp.	8.000	106.880	0,01 %
SanBio Co., Ltd.	4.200	120.240	0,01 %	Konishi Co., Ltd.	5.700	106.866	0,01 %
Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co., Ltd.	2.397	120.010	0,01 %	Kyoei Steel Ltd.	5.591	106.758	0,01 %
Konoike Transport Co., Ltd.	6.750	119.660	0,01 %	Miyazaki Bank Ltd.	3.117	106.390	0,01 %
Sumitomo Seika Chemicals Co., Ltd.	2.148	119.365	0,01 %	AOKI Holdings, Inc.	7.216	106.078	0,01 %
Mitsuboshi Belting Ltd.	8.679	119.264	0,01 %	Minato Bank Ltd.	5.639	106.022	0,01 %
Towa Bank Ltd.	8.786	119.097	0,01 %	Tayca Corp.	3.600	105.619	0,01 %
Chiyoda Co., Ltd.	4.425	119.021	0,01 %	ASKA Pharmaceutical Co., Ltd.	5.945	105.232	0,01 %
Avex, Inc.	8.353	119.011	0,01 %	Yondoshi Holdings, Inc.	3.950	104.737	0,01 %
Relia, Inc.	10.132	118.454	0,01 %	Nissei ASB Machine Co., Ltd.	1.700	103.977	0,01 %
S Foods, Inc.	2.604	118.353	0,01 %	Showa Sangyo Co., Ltd.	3.966	103.296	0,01 %
Takara Standard Co., Ltd.	7.322	118.296	0,01 %	Systema Corp.	3.200	102.264	0,01 %
Sakai Moving Service Co., Ltd.	2.400	118.242	0,01 %	Shikoku Bank Ltd.	7.200	101.625	0,01 %
Eighteenth Bank Ltd.	45.722	117.704	0,01 %	Ringer Hut Co., Ltd.	4.454	101.218	0,01 %
Riken Corp.	2.077	117.448	0,01 %	Okamoto Industries, Inc.	9.944	100.985	0,01 %
euglena Co., Ltd.	12.550	117.423	0,01 %	Marudai Food Co., Ltd.	22.465	100.908	0,01 %
JCU Corp.	2.400	116.964	0,01 %	Matsuya Co., Ltd.	7.319	100.835	0,01 %
Fukuda Denshi Co., Ltd.	1.600	116.893	0,01 %	Mizuno Corp.	3.424	100.760	0,01 %
Unizo Holdings Co., Ltd.	4.300	116.804	0,01 %	Tokai Corp.	4.400	100.733	0,01 %
Axial Retailing, Inc.	3.100	116.680	0,01 %	Kasai Kogyo Co., Ltd.	6.100	100.611	0,01 %
Tosho Co., Ltd.	3.600	116.325	0,01 %	Sodick Co., Ltd.	7.700	100.206	0,01 %
Itochu Enex Co., Ltd.	11.991	115.599	0,01 %	Sogo Medical Co., Ltd.	1.900	100.186	0,01 %
Bank of Iwate Ltd.	2.900	115.588	0,01 %	Ichibanya Co., Ltd.	2.484	100.110	0,01 %
TOC Co., Ltd.	13.512	115.509	0,01 %	Digital Arts, Inc.	2.500	99.978	0,01 %
COLOPL, Inc.	10.600	115.174	0,01 %	Riso Kagaku Corp.	5.247	99.816	0,01 %
T-Gaia Corp.	4.950	115.039	0,01 %	Yokohama Reito Co., Ltd.	9.565	99.174	0,01 %
Jaccs Co., Ltd.	4.914	114.987	0,01 %	DA Consortium Holdings, Inc.	5.000	98.890	0,01 %
NichiiGakkan Co., Ltd.	9.000	114.967	0,01 %	Futaba Industrial Co., Ltd.	10.612	98.819	0,01 %
Noritz Corp.	5.851	114.787	0,01 %	M&A Capital Partners Co., Ltd.	1.500	98.136	0,01 %
Sekisui Jushi Corp.	5.619	114.625	0,01 %	YA-MAN Ltd.	5.800	97.722	0,01 %
Hamakyoex Co., Ltd.	4.000	114.514	0,01 %	Toei Animation Co., Ltd.	1.000	97.648	0,01 %
KLab, Inc.	7.200	114.407	0,01 %	Kanto Denka Kogyo Co., Ltd.	8.000	97.222	0,01 %
Kaga Electronics Co., Ltd.	4.175	113.965	0,01 %	Toho Titanium Co., Ltd.	9.100	96.776	0,01 %
Seikagaku Corp.	7.624	113.700	0,01 %	Sinfonia Technology Co., Ltd.	25.000	96.760	0,01 %
Nishio Rent All Co., Ltd.	3.499	113.683	0,01 %	Nippon Chemi-Con Corp.	3.100	96.591	0,01 %
Shikoku Chemicals Corp.	7.000	113.529	0,01 %	TV Asahi Holdings Corp.	4.800	96.554	0,01 %
Raito Kogyo Co., Ltd.	9.900	113.369	0,01 %	Sanden Holdings Corp.	4.800	96.384	0,01 %
Miroku Jyoho Service Co., Ltd.	4.200	113.342	0,01 %	Eagle Industry Co., Ltd.	5.148	96.334	0,01 %
				Toyco Construction Co., Ltd.	16.441	96.180	0,01 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens
Morita Holdings Corp.	5.100	96.024	0,01 %	Hibiya Engineering Ltd.	3.800	81.094	0,01 %
Modec, Inc.	3.716	95.993	0,01 %	Mitsubishi Steel Manufacturing Co., Ltd.	3.262	81.079	0,01 %
Jeol Ltd.	16.898	95.853	0,01 %	Mori Trust Hotel Reit, Inc. REIT	64	81.016	0,01 %
Aichi Bank Ltd.	2.010	95.459	0,01 %	Fujiho Holdings, Inc.	2.450	81.014	0,01 %
Fuso Chemical Co., Ltd.	3.500	95.073	0,01 %	Marusan Securities Co., Ltd.	9.025	80.997	0,01 %
Nippon Ceramic Co., Ltd.	3.695	95.024	0,01 %	Life Corp.	3.000	80.959	0,01 %
LIXIL VIVA Corp.	5.500	94.669	0,01 %	Bando Chemical Industries Ltd.	6.869	80.611	0,01 %
Mitsuba Corp.	6.280	94.437	0,01 %	Alpen Co., Ltd.	3.717	80.147	0,01 %
Dai-Dan Co., Ltd.	3.500	93.830	0,01 %	PAL GROUP Holdings Co., Ltd.	2.550	80.133	0,01 %
Oiles Corp.	4.683	93.743	0,01 %	Akita Bank Ltd.	2.900	80.062	0,01 %
Shizuoka Gas Co., Ltd.	10.997	93.423	0,01 %	Cawachi Ltd.	3.239	79.990	0,01 %
Towa Pharmaceutical Co., Ltd.	1.705	93.083	0,01 %	Goldcrest Co., Ltd.	3.957	79.948	0,01 %
Takasago International Corp.	2.855	92.632	0,01 %	Aeon Fantasy Co., Ltd.	1.800	79.734	0,01 %
Belluna Co., Ltd.	7.513	92.570	0,01 %	Kenko Mayonnaise Co., Ltd.	2.200	79.583	0,01 %
Riken Keiki Co., Ltd.	4.000	92.215	0,01 %	Goldwin, Inc.	1.000	79.272	0,01 %
Hokuto Corp.	5.060	92.127	0,01 %	Bell System24 Holdings, Inc.	6.300	79.246	0,01 %
Broadleaf Co., Ltd.	9.900	92.101	0,01 %	Pasona Group, Inc.	3.900	79.177	0,01 %
Yume No Machi Souzou linkai Co., Ltd.	5.000	91.567	0,01 %	J Trust Co., Ltd.	12.150	79.166	0,01 %
Doshisha Co., Ltd.	4.300	91.535	0,01 %	Nissin Corp.	2.805	78.933	0,01 %
Tanseisha Co., Ltd.	8.100	91.390	0,01 %	Pacific Metals Co., Ltd.	2.833	78.715	0,01 %
Vector, Inc.	6.200	91.363	0,01 %	Zojirushi Corp.	7.700	78.470	0,01 %
UNITED, Inc.	2.800	91.345	0,01 %	Iseki & Co., Ltd.	3.109	78.463	0,01 %
Tenma Corp.	4.627	90.938	0,01 %	Yonex Co., Ltd.	12.100	77.767	0,01 %
Canon Electronics, Inc.	4.149	90.715	0,01 %	Sakai Chemical Industry Co., Ltd.	2.898	77.692	0,01 %
Hokuetsu Bank Ltd.	3.929	90.613	0,01 %	Nippon Kanzai Co., Ltd.	4.260	77.637	0,01 %
Daiken Corp.	3.470	90.562	0,01 %	Taihei Dengyo Kaisha Ltd.	2.992	77.317	0,01 %
Yorozu Corp.	4.200	90.301	0,01 %	CI Takiron Corp.	10.817	77.203	0,01 %
FULLCAST Holdings Co., Ltd.	4.400	90.265	0,01 %	Nippon Road Co., Ltd.	1.315	76.927	0,01 %
Pack Corp.	2.788	90.087	0,01 %	Yumeshin Holdings Co., Ltd.	8.000	76.911	0,01 %
Enplas Corp.	2.165	89.944	0,01 %	PIA Corp.	1.200	76.804	0,01 %
Japan Wool Textile Co., Ltd.	9.315	89.884	0,01 %	Kobe Bussan Co., Ltd.	2.000	76.698	0,01 %
Istyle, Inc.	11.400	89.055	0,01 %	Sekisui Plastics Co., Ltd.	5.798	76.432	0,01 %
Unitika Ltd.	12.092	88.879	0,01 %	Aichi Steel Corp.	1.900	76.236	0,01 %
Nitto Kogyo Corp.	5.513	88.531	0,01 %	Union Tool Co.	2.068	76.001	0,01 %
Solasto Corp.	3.900	88.421	0,01 %	kabu.com Securities Co., Ltd.	24.300	75.931	0,01 %
Teikoku Sen-I Co., Ltd.	4.400	88.391	0,01 %	Vital KSK Holdings, Inc.	8.274	75.799	0,01 %
St Marc Holdings Co., Ltd.	3.192	88.124	0,01 %	Toa Corp.	2.803	75.642	0,01 %
Warabeya Nichiyō Holdings Co., Ltd.	3.100	87.923	0,01 %	Kansai Urban Banking Corp.	5.800	75.634	0,01 %
Bank of Nagoya Ltd.	2.250	87.783	0,01 %	Tamron Co., Ltd.	3.507	75.401	0,01 %
Yellow Hat Ltd.	2.900	87.656	0,01 %	Aisan Industry Co., Ltd.	6.387	75.011	0,01 %
Nippon Thompson Co., Ltd.	10.940	87.501	0,01 %	Itoki Corp.	10.100	74.865	0,01 %
VT Holdings Co., Ltd.	17.400	86.652	0,01 %	Daiho Corp.	15.000	74.700	0,01 %
Nohmi Bosai Ltd.	4.739	86.450	0,01 %	Nippon Koei Co., Ltd.	2.400	74.567	0,01 %
MCJ Co., Ltd.	8.200	85.894	0,01 %	Tekken Corp.	2.450	74.381	0,01 %
JSP Corp.	2.500	85.664	0,01 %	Investors Cloud Co., Ltd.	5.000	74.301	0,01 %
Fujicco Co., Ltd.	3.830	85.440	0,01 %	Hodogaya Chemical Co., Ltd.	1.400	74.070	0,01 %
Elecom Co., Ltd.	3.700	85.430	0,01 %	Sumitomo Riko Co., Ltd.	6.900	73.870	0,01 %
Mitsui High-Tec, Inc.	4.700	85.238	0,01 %	Kyokuto Securities Co., Ltd.	5.000	73.680	0,01 %
Arcland Service Holdings Co., Ltd.	3.600	85.230	0,01 %	Sinko Industries Ltd.	3.800	73.403	0,01 %
DyDo Group Holdings, Inc.	1.588	83.876	0,01 %	Sun Frontier Fudousan Co., Ltd.	6.450	73.346	0,01 %
Key Coffee, Inc.	4.341	83.853	0,01 %	Infocom Corp.	3.000	73.023	0,01 %
Tsukui Corp.	9.300	83.712	0,01 %	Ehime Bank Ltd.	6.100	72.940	0,01 %
Mitsubishi Shokuhin Co., Ltd.	2.850	83.615	0,01 %	Kamei Corp.	4.200	72.740	0,01 %
Maruwa Unyu Kikan Co., Ltd.	2.600	83.551	0,01 %	Nittetsu Mining Co., Ltd.	990	72.503	0,01 %
Ichiyoshi Securities Co., Ltd.	7.302	83.359	0,01 %	Giken Ltd.	2.750	72.040	0,01 %
Nippon Denko Co., Ltd.	19.783	82.715	0,01 %	ST Corp.	3.000	71.931	0,01 %
Stella Chemifa Corp.	2.500	82.446	0,01 %	Riken Vitamin Co., Ltd.	1.800	71.744	0,01 %
Gunosy, Inc.	2.700	82.330	0,01 %	Qol Co., Ltd.	3.800	71.379	0,01 %
Cosel Co., Ltd.	4.998	82.124	0,01 %	Tochigi Bank Ltd.	17.686	71.278	0,01 %
CMIC Holdings Co., Ltd.	4.580	82.086	0,01 %	Gurunavi, Inc.	6.000	71.265	0,01 %
Toyo Tanso Co., Ltd.	2.605	81.977	0,01 %	Hochiki Corp.	3.300	71.068	0,01 %
Neturen Co., Ltd.	7.405	81.248	0,01 %	Rock Field Co., Ltd.	3.900	70.730	0,00 %
Maeda Kosen Co., Ltd.	4.400	81.243	0,01 %	Fujimi, Inc.	3.354	70.653	0,00 %
Takamatsu Construction Group Co., Ltd.	2.882	81.228	0,01 %	CONEXIO Corp.	3.400	70.626	0,00 %
PC Depot Corp.	10.600	81.206	0,01 %	Roland DG Corp.	2.624	70.579	0,00 %
Chofu Seisakusho Co., Ltd.	3.513	81.112	0,01 %	Sumitomo Densetsu Co., Ltd.	3.300	70.306	0,00 %
				OSJB Holdings Corp.	23.550	70.242	0,00 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Max Co., Ltd.	4.892	70.090	0,00 %	Nippon Beet Sugar Manufacturing Co., Ltd.	2.315	56.061	0,00 %
Japan Investment Adviser Co., Ltd.	2.500	70.018	0,00 %	Parco Co., Ltd.	4.050	55.870	0,00 %
eRex Co., Ltd.	7.400	69.763	0,00 %	Rokko Butter Co., Ltd.	2.300	55.739	0,00 %
Japan Tissue Engineering Co., Ltd.	6.400	69.653	0,00 %	Yurtec Corp.	6.456	55.190	0,00 %
Bank of Saga Ltd.	3.042	69.508	0,00 %	Yushin Precision Equipment Co., Ltd.	1.924	54.910	0,00 %
Nichiden Corp.	3.382	69.471	0,00 %	Mimasu Semiconductor Industry Co., Ltd.	2.855	54.743	0,00 %
F@N Communications, Inc.	8.700	69.353	0,00 %	Link And Motivation, Inc.	6.700	54.718	0,00 %
Sankyo Tateyama, Inc.	4.516	68.351	0,00 %	Jamco Corp.	2.300	54.249	0,00 %
Feed One Co., Ltd.	28.900	67.985	0,00 %	World Holdings Co., Ltd.	1.700	54.101	0,00 %
Takara Leben Co., Ltd.	15.300	67.638	0,00 %	Chori Co., Ltd.	2.900	53.907	0,00 %
Torii Pharmaceutical Co., Ltd.	2.516	67.562	0,00 %	Chukyo Bank Ltd.	2.600	53.800	0,00 %
AOI Electronics Co., Ltd.	1.300	66.933	0,00 %	Jimoto Holdings, Inc.	31.200	53.454	0,00 %
Japan Pulp & Paper Co., Ltd.	1.739	66.766	0,00 %	Starzen Co., Ltd.	1.100	53.316	0,00 %
Information Services International- Dentsu Ltd.	2.939	66.633	0,00 %	Marvelous, Inc.	5.750	53.085	0,00 %
Achilles Corp.	3.135	66.346	0,00 %	Kappa Create Co., Ltd.	4.673	53.056	0,00 %
Fukuda Corp.	1.100	66.205	0,00 %	Tokyo Base Co., Ltd.	1.200	52.836	0,00 %
Nihon Nohyaku Co., Ltd.	11.099	65.717	0,00 %	Okuwa Co., Ltd.	5.089	52.629	0,00 %
Genky DrugStores Co., Ltd.	1.800	65.593	0,00 %	Osaka Steel Co., Ltd.	2.492	52.185	0,00 %
Mitsui-Soko Holdings Co., Ltd.	19.096	65.264	0,00 %	Ministop Co., Ltd.	2.407	52.029	0,00 %
Tsukishima Kikai Co., Ltd.	4.871	65.163	0,00 %	Mitsui Home Co., Ltd.	7.420	51.377	0,00 %
Micronics Japan Co., Ltd.	6.300	65.097	0,00 %	ZIGEXN Co., Ltd.	6.400	51.245	0,00 %
Icom, Inc.	2.777	65.031	0,00 %	Denki Kogyo Co., Ltd.	1.803	51.137	0,00 %
Daiwa Industries Ltd.	5.661	64.977	0,00 %	Halows Co., Ltd.	2.200	50.835	0,00 %
Oyo Corp.	5.030	64.477	0,00 %	Osaki Electric Co., Ltd.	7.000	50.644	0,00 %
Tokushu Tokai Paper Co., Ltd.	1.700	64.288	0,00 %	Namura Shipbuilding Co., Ltd.	8.204	50.615	0,00 %
Katakura Industries Co., Ltd.	4.681	63.909	0,00 %	Studio Alice Co., Ltd.	2.000	50.581	0,00 %
Daido Metal Co., Ltd.	6.450	63.842	0,00 %	Keiyo Co., Ltd.	8.251	50.026	0,00 %
Tsurumi Manufacturing Co., Ltd.	3.450	63.763	0,00 %	METAWATER Co., Ltd.	1.900	49.250	0,00 %
G-Tekt Corp.	3.100	63.761	0,00 %	SMK Corp.	8.671	48.955	0,00 %
Okabe Co., Ltd.	6.650	63.519	0,00 %	Kato Works Co., Ltd.	1.600	48.646	0,00 %
Melco Holdings, Inc.	1.845	63.465	0,00 %	Denyo Co., Ltd.	2.700	48.320	0,00 %
Nagatanien Holdings Co., Ltd.	5.000	63.249	0,00 %	Ateam, Inc.	2.000	48.114	0,00 %
Kanematsu Electronics Ltd.	2.100	63.009	0,00 %	NuFlare Technology, Inc.	800	48.007	0,00 %
Osaka Soda Co., Ltd.	2.458	62.906	0,00 %	Nitto Kohki Co., Ltd.	1.892	47.917	0,00 %
Itochu-Shokuhin Co., Ltd.	1.144	62.862	0,00 %	Akebono Brake Industry Co., Ltd.	17.503	47.856	0,00 %
Toyo Kanetsu KK	1.544	62.843	0,00 %	Toenec Corp.	1.562	47.422	0,00 %
Anest Iwata Corp.	5.600	62.736	0,00 %	Ines Corp.	4.491	46.604	0,00 %
COOKPAD, Inc.	11.612	62.570	0,00 %	Hiramatsu, Inc.	9.200	46.551	0,00 %
BRONCO BILLY Co., Ltd.	2.100	62.543	0,00 %	Tsukuba Bank Ltd.	13.577	46.522	0,00 %
WATAMI Co., Ltd.	4.265	62.394	0,00 %	Fuji Pharma Co., Ltd.	1.200	46.285	0,00 %
Future Corp.	5.750	62.222	0,00 %	Chiyoda Integre Co., Ltd.	1.880	45.811	0,00 %
Tatsuta Electric Wire and Cable Co., Ltd.	7.800	62.109	0,00 %	Mitsubishi Research Institute, Inc.	1.300	45.584	0,00 %
Nakayama Steel Works Ltd.	9.600	61.870	0,00 %	Fudo Tetra Corp.	28.050	45.567	0,00 %
Septeni Holdings Co., Ltd.	19.900	61.652	0,00 %	Tosho Printing Co., Ltd.	5.000	45.273	0,00 %
Ryoyo Electro Corp.	3.351	61.457	0,00 %	Sparx Group Co., Ltd.	16.300	45.145	0,00 %
Matsuya Foods Co., Ltd.	1.658	61.375	0,00 %	France Bed Holdings Co., Ltd.	4.681	44.213	0,00 %
Yakuodo Co., Ltd.	2.200	61.323	0,00 %	Matsuda Sangyo Co., Ltd.	2.673	44.016	0,00 %
Toyo Engineering Corp.	5.238	60.447	0,00 %	Mars Engineering Corp.	1.975	43.988	0,00 %
K&O Energy Group, Inc.	3.584	60.226	0,00 %	OncoTherapy Science, Inc.	21.350	43.401	0,00 %
Amuse, Inc.	2.100	59.654	0,00 %	Asahi Co., Ltd.	3.700	43.093	0,00 %
UKC Holdings Corp.	2.700	59.561	0,00 %	Fujiya Co., Ltd.	1.852	43.057	0,00 %
Tosei Corp.	6.100	59.457	0,00 %	Shinnihon Corp.	4.900	42.976	0,00 %
J-Oil Mills, Inc.	1.698	59.313	0,00 %	Nihon Chouzai Co., Ltd.	1.400	42.690	0,00 %
Nihon Trim Co., Ltd.	1.300	59.086	0,00 %	Chiba Kogyo Bank Ltd.	8.550	42.579	0,00 %
Ichikoh Industries Ltd.	6.600	58.764	0,00 %	Daiichi Jitsugyo Co., Ltd.	1.399	42.287	0,00 %
Kintetsu Department Store Co., Ltd.	1.600	58.589	0,00 %	Kyodo Printing Co., Ltd.	1.286	41.383	0,00 %
Mitsubishi Logisnext Co., Ltd.	6.600	58.471	0,00 %	Akatsuki, Inc.	700	41.198	0,00 %
OSAKA Titanium Technologies Co., Ltd.	3.150	58.023	0,00 %	NS United Kaiun Kaisha Ltd.	1.683	41.011	0,00 %
Trust Tech, Inc.	1.900	57.177	0,00 %	Koatsu Gas Kogyo Co., Ltd.	4.838	40.929	0,00 %
Fujita Kanko, Inc.	1.809	56.767	0,00 %	Meiko Network Japan Co., Ltd.	3.400	40.323	0,00 %
Nippon Parking Development Co., Ltd.	33.050	56.330	0,00 %	Elematec Corp.	1.750	40.297	0,00 %
Daikokutenbussan Co., Ltd.	1.269	56.325	0,00 %	Taiho Kogyo Co., Ltd. Klasse A	2.700	40.194	0,00 %
Sac's Bar Holdings, Inc.	4.550	56.304	0,00 %	FDK Corp.	21.000	39.894	0,00 %
JAC Recruitment Co., Ltd.	2.900	56.249	0,00 %	CROOZ, Inc.	1.800	39.627	0,00 %
				Tanaka Chemical Corp.	2.300	39.548	0,00 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Proto Corp.	2.750	39.498	0,00 %	AMG Advanced Metallurgical Group NV	5.831	293.483	0,02 %
Hisaka Works Ltd.	3.651	38.795	0,00 %	TomTom NV	28.355	281.072	0,02 %
Aichi Corp.	5.238	38.779	0,00 %	Fugro NV	17.318	270.133	0,02 %
Hearts United Group Co., Ltd.	2.500	37.905	0,00 %	Intertrust NV	14.372	269.741	0,02 %
NanoCarrier Co., Ltd.	6.600	37.790	0,00 %	Takeaway.com NV	3.969	242.493	0,02 %
Advan Co., Ltd.	3.900	37.736	0,00 %	Koninklijke BAM Groep NV	52.030	239.352	0,02 %
Maruzen Showa Unyu Co., Ltd.	8.391	37.691	0,00 %	Koninklijke Volkerwessels NV	7.460	212.707	0,02 %
Mie Bank Ltd.	1.669	37.528	0,00 %	Vastned Retail NV REIT	3.804	188.652	0,01 %
Funai Electric Co., Ltd.	4.800	37.156	0,00 %	Basic-Fit NV	7.229	174.567	0,01 %
Yahagi Construction Co., Ltd.	4.132	36.020	0,00 %	Flow Traders	7.164	172.051	0,01 %
Fukui Computer Holdings, Inc.	1.200	34.407	0,00 %	NSI NV REIT	3.850	160.721	0,01 %
Wowow, Inc.	1.150	33.893	0,00 %	Accell Group	5.411	152.237	0,01 %
KNT-CT Holdings Co., Ltd.	2.100	33.779	0,00 %	Kendrion NV	2.821	136.040	0,01 %
Toyo Kohan Co., Ltd.	7.528	32.611	0,00 %	Brunel International NV	4.142	75.600	0,01 %
JIG-SAW, Inc.	700	31.940	0,00 %	BinckBank NV	11.630	61.922	0,00 %
FFRI, Inc.	900	31.638	0,00 %	ForFarmers NV	4.051	50.785	0,00 %
Fields Corp.	2.900	31.098	0,00 %	SIF Holding NV	2.019	42.209	0,00 %
Senshukai Co., Ltd.	5.334	30.730	0,00 %	SRH NV	17.962	—	0,00 %
Organo Corp.	1.041	30.449	0,00 %			14.557.496	1,01 %
Gecoss Corp.	2.450	30.340	0,00 %				
Corona Corp. Klasse A	2.399	30.304	0,00 %	Neuseeland 0,40 % (2016: 0,39 %)			
Misawa Homes Co., Ltd.	3.400	29.941	0,00 %	a2 Milk Co., Ltd.	146.791	842.490	0,06 %
Nippon Sharyo Ltd.	9.784	29.443	0,00 %	Contact Energy Ltd.	163.699	647.310	0,05 %
NEC Capital Solutions Ltd.	1.411	29.034	0,00 %	SKYCITY Entertainment Group Ltd.	152.473	450.021	0,03 %
Japan Asset Marketing Co., Ltd.	25.700	28.746	0,00 %	Z Energy Ltd.	79.273	432.427	0,03 %
Kansai Super Market Ltd.	2.600	28.435	0,00 %	Xero Ltd.	17.869	400.316	0,03 %
Cleanup Corp.	3.598	28.394	0,00 %	Trade Me Group Ltd.	93.543	321.994	0,02 %
Godo Steel Ltd.	1.292	27.136	0,00 %	Kiwi Property Group Ltd.	299.331	299.102	0,02 %
Japan Cash Machine Co., Ltd.	2.673	26.979	0,00 %	Air New Zealand Ltd.	123.774	280.809	0,02 %
Yomiuri Land Co., Ltd.	601	26.462	0,00 %	Infratil Ltd.	118.099	278.853	0,02 %
Laox Co., Ltd.	5.050	26.180	0,00 %	Chorus Ltd.	91.922	274.575	0,02 %
Daisyoy Corp.	1.654	25.856	0,00 %	Precinct Properties New Zealand Ltd.	250.755	242.538	0,02 %
MTI Ltd.	4.300	24.582	0,00 %	Goodman Property Trust REIT	197.102	193.447	0,01 %
Linical Co., Ltd.	1.600	22.825	0,00 %	Genesis Energy Ltd.	105.452	188.994	0,01 %
Japan Drilling Co., Ltd.	1.000	21.198	0,00 %	Freightways Ltd.	34.363	187.447	0,01 %
Sinanen Holdings Co., Ltd.	846	20.217	0,00 %	Metlifecare Ltd.	42.587	184.756	0,01 %
HEALIOS KK	1.100	18.934	0,00 %	Summerset Group Holdings Ltd.	43.346	169.552	0,01 %
Tsutsumi Jewelry Co., Ltd.	930	18.146	0,00 %	Sky Network Television Ltd.	80.715	161.307	0,01 %
Ardepro Co., Ltd.	20.650	16.131	0,00 %	Argosy Property Ltd.	175.492	135.419	0,01 %
		179.940.270	12,50 %	New Zealand Refining Co., Ltd.	46.037	86.765	0,01 %
Luxemburg 0,00 % (2016: 0,01 %)						5.778.122	0,40 %
Senvion SA	5.197	64.278	0,00 %				
		64.278	0,00 %	Norwegen 0,70 % (2016: 0,64 %)			
Malta 0,01 % (2016: 0,01 %)				Subsea 7 SA	61.446	924.017	0,06 %
Catena Media plc	6.582	83.405	0,01 %	Storebrand A.S.A	100.642	823.164	0,06 %
		83.405	0,01 %	Aker BP A.S.A	24.315	600.194	0,04 %
Niederlande 1,01 % (2016: 0,79 %)				TGS NOPEC Geophysical Co. A.S.A	23.037	546.961	0,04 %
ASR Nederland NV	32.876	1.354.276	0,09 %	Bakkafrøst P/F	8.958	380.800	0,03 %
Aalberts Industries NV	22.072	1.123.639	0,08 %	Entra A.S.A	24.026	358.363	0,02 %
Gemalto NV	18.073	1.074.252	0,08 %	Leroy Seafood Group A.S.A	65.605	352.755	0,02 %
Philips Lighting NV	21.014	772.148	0,05 %	Salmar A.S.A	11.387	343.586	0,02 %
IMCD Group NV	11.858	746.555	0,05 %	Borr Drilling Ltd.	74.818	316.493	0,02 %
ASM International NV	10.591	716.895	0,05 %	Norwegian Finans Holding A.S.A	25.431	286.044	0,02 %
BE Semiconductor Industries NV	8.216	689.716	0,05 %	SpareBank 1 SMN	26.613	267.615	0,02 %
SBM Offshore NV	38.451	677.343	0,05 %	Aker A.S.A Klasse A	5.308	261.527	0,02 %
APERAM SA	11.224	578.534	0,04 %	Atea A.S.A	18.364	259.317	0,02 %
TKH Group NV	8.635	548.826	0,04 %	Aker Solutions A.S.A	39.815	224.841	0,02 %
PostNL NV	99.288	485.961	0,03 %	XXL A.S.A	21.615	224.624	0,02 %
Eurocommercial Properties NV	11.092	483.623	0,03 %	Borregaard A.S.A	22.476	223.954	0,02 %
Wereldhave NV REIT	9.299	446.650	0,03 %	Wallenius Wilhelmsen Logistics Klasse B	25.783	186.768	0,01 %
Corbion NV	13.570	439.961	0,03 %	Sbanken A.S.A	18.325	181.472	0,01 %
OCI NV	15.978	403.490	0,03 %	SpareBank 1 Nord Norge	22.502	171.254	0,01 %
Arcadis NV	15.451	353.538	0,03 %	DNO A.S.A	136.925	159.033	0,01 %
Wessanen	16.493	340.246	0,02 %	Austevoll Seafood A.S.A	18.861	157.380	0,01 %
Refresco Group NV	12.537	298.078	0,02 %	Petroleum Geo-Services A.S.A	76.603	155.934	0,01 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Evry A.S.	37979	150.907	0,01 %	First Resources Ltd.	124.400	174.071	0,01 %
Protector Forsikring A.S.A	13.381	147.235	0,01 %	Yanlord Land Group Ltd.	141.650	171.710	0,01 %
Golden Ocean Group Ltd.	18.008	146.740	0,01 %	Starhill Global REIT	289.581	167.933	0,01 %
Nordic Semiconductor A.S.A	27.729	142.385	0,01 %	Parkway Life REIT	73.645	164.770	0,01 %
Songa Offshore	18.464	136.008	0,01 %	Raffles Medical Group Ltd.	184.505	154.629	0,01 %
Kongsberg Automotive A.S.A	92.620	133.053	0,01 %	CapitaLand Retail China Trust REIT	124.715	151.181	0,01 %
Europris A.S.A	31.845	130.038	0,01 %	Frasers Commercial Trust REIT	134.824	150.320	0,01 %
Norwegian Air Shuttle A.S.A	5.791	124.608	0,01 %	M1 Ltd.	110.050	146.580	0,01 %
Axactor AB	296.589	104.068	0,01 %	OUE Hospitality Trust	225.191	143.230	0,01 %
BW LPG Ltd.	21.982	103.845	0,01 %	Yoma Strategic Holdings Ltd.	352.954	142.618	0,01 %
Ocean Yield A.S.A	11.489	97.622	0,01 %	Cache Logistics Trust REIT	219.194	140.236	0,01 %
B2Holding A.S.A	38.187	97.576	0,01 %	Asian Pay Television Trust	306.700	135.403	0,01 %
Akastor A.S.A	46.002	92.236	0,01 %	First REIT	115.000	119.612	0,01 %
Grieg Seafood A.S.A	10.287	90.867	0,01 %	Lippo Malls Indonesia Retail Trust REIT	378.770	113.370	0,01 %
Scatec Solar A.S.A	13.574	82.977	0,01 %	Soilbuild Business Space REIT	206.280	103.418	0,01 %
Opera Software A.S.A	25.762	82.521	0,01 %	SPH REIT	123.850	97.308	0,01 %
Sparebank 1 Oestlandet	7.431	82.220	0,01 %	Ascendas Hospitality Trust	144.300	92.860	0,01 %
Nordic Nanovector A.S.A	7.852	77.758	0,01 %	RHT Health Trust	141.400	88.878	0,01 %
Stolt-Nielsen Ltd.	5.683	75.733	0,01 %	ESR-REIT REIT	210.192	88.865	0,01 %
Hoegh LNG Holdings Ltd.	9.071	72.086	0,00 %	Far East Hospitality Trust	162.300	87.441	0,01 %
BW Offshore Ltd.	16.420	71.868	0,00 %	Sheng Siong Group Ltd.	117.900	81.605	0,01 %
Frontline Ltd.	14.755	68.730	0,00 %	OUE Ltd.	53.900	75.421	0,01 %
Hexagon Composites A.S.A	19.063	64.092	0,00 %	Silverlake Axis Ltd.	173.580	75.334	0,01 %
REC Silicon A.S.A	378.133	63.798	0,00 %	WaVe Life Sciences Ltd.	2.138	75.044	0,01 %
IDEX A.S.A	100.870	63.635	0,00 %	Accordia Golf Trust	139.300	71.401	0,01 %
Odfjell Drilling Ltd.	13.044	58.208	0,00 %	SIIC Environment Holdings Ltd.	178.070	68.622	0,01 %
Norwegian Property A.S.A	34.842	45.153	0,00 %	COSCO Shipping International Singapore Co., Ltd.	239.300	67.149	0,00 %
Norway Royal Salmon A.S.A	2.583	42.475	0,00 %	Bumitama Agri Ltd.	117.850	65.698	0,00 %
Gaming Innovation Group, Inc.	61.427	37.024	0,00 %	China Aviation Oil Singapore Corp., Ltd.	49.800	60.368	0,00 %
Selvaag Bolig A.S.A	6.597	27.342	0,00 %	Viva Industrial Trust	80.400	56.251	0,00 %
		10.118.904	0,70 %	Best World International Ltd.	51.300	50.670	0,00 %
Portugal 0,16 % (2016: 0,13 %)				Ezion Holdings Ltd.	330.157	48.669	0,00 %
Banco Comercial Portugues SA				Sabana Shari'ah Compliant Industrial REIT	154.941	45.796	0,00 %
Klasse R	2.242.721	732.512	0,05 %	Chip Eng Seng Corp., Ltd.	60.100	43.847	0,00 %
NOS SGPS SA	54.899	361.322	0,03 %	Japfa Ltd.	93.000	35.491	0,00 %
REN-Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	71.502	212.846	0,01 %	Riverstone Holdings Ltd.	40.900	33.053	0,00 %
Sonae SGPS SA	150.359	203.301	0,01 %	Boustead Singapore Ltd.	49.550	31.886	0,00 %
Navigator Co., SA	37.633	192.147	0,01 %	Noble Group Ltd.	196.250	29.370	0,00 %
CTT-Correios de Portugal SA	29.861	125.751	0,01 %	QAF Ltd.	34.100	28.578	0,00 %
Semapa-Sociedade de Investimento e Gestao	5.820	124.363	0,01 %	Indofood Agri Resources Ltd.	48.273	14.087	0,00 %
Corticeira Amorim SGPS SA	9.620	118.982	0,01 %			9.667.604	0,67 %
Altri SGPS SA	15.826	98.269	0,01 %				
Mota-Engil SGPS SA	21.617	95.083	0,01 %				
		2.264.576	0,16 %				
Singapur 0,67 % (2016: 0,64 %)				Spanien 1,04 % (2016: 0,92 %)			
Venture Corp., Ltd.	60.650	928.992	0,06 %	Merlin Properties Socimi SA REIT	77.564	1.052.469	0,07 %
Mapletree Commercial Trust REIT	422.708	512.412	0,04 %	Cellnex Telecom SA	33.182	850.690	0,06 %
Mapletree Logistics Trust REIT	455.446	449.857	0,03 %	Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	137.168	708.753	0,05 %
NetLink NBN Trust	718.600	448.991	0,03 %	Inmobiliaria Colonial Socimi SA REIT	68.174	678.074	0,05 %
Mapletree Industrial Trust REIT	279.240	424.167	0,03 %	Viscofan SA	8.904	588.163	0,04 %
Keppel REIT	414.450	390.757	0,03 %	Acerinox SA	38.300	547.978	0,04 %
Mapletree Greater China Commercial Trust REIT	409.400	376.805	0,03 %	Bolsas y Mercados Espanoles SHMSF SA	16.913	539.207	0,04 %
Singapore Post Ltd.	314.850	292.139	0,02 %	Acciona SA	6.453	527.226	0,04 %
Keppel Infrastructure Trust	615.700	264.911	0,02 %	Hispania Activos Inmobiliarios SOCIMI SA REIT	25.734	485.152	0,03 %
Sembcorp Marine Ltd.	176.700	243.286	0,02 %	Prosegur Compania de Seguridad SA	61.220	481.510	0,03 %
Ascott Residence Trust REIT	260.305	237.633	0,02 %	Zardoya Otis SA	40.300	441.337	0,03 %
CDL Hospitality Trusts	180.558	228.332	0,02 %	Applus Services SA	30.380	411.315	0,03 %
Frasers Centrepoint Trust REIT	119.398	200.128	0,01 %	Grupo Catalana Occidente SA	9.185	407.424	0,03 %
Frasers Logistics & Industrial Trust REIT	230.300	199.901	0,01 %	Mediaset Espana Comunicacion SA	36.107	405.781	0,03 %
Keppel DC REIT	185.651	198.654	0,01 %	Ebro Foods SA	15.947	373.792	0,03 %
Manulife US REIT	217.986	197.277	0,01 %	Indra Sistemas SA	27.127	371.508	0,03 %
United Engineers Ltd.	97.400	192.409	0,01 %	CIE Automotive SA	12.493	363.189	0,03 %
Wing Tai Holdings Ltd.	110.300	188.180	0,01 %	Melia Hotels International SA	26.159	361.235	0,02 %
				Neinor Homes SA	16.075	353.242	0,02 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Axiare Patrimonio SOCIMI SA REIT	15.148	335.055	0,02 %	Sweco AB Klasse B	16.844	374.014	0,03 %
NH Hotel Group SA	45.849	330.333	0,02 %	Peab AB	41.961	361.826	0,03 %
Gestamp Automocion SA	38.897	278.190	0,02 %	Wihlborgs Fastigheter AB	15.061	361.096	0,03 %
Unicaja Banco SA	172.965	272.913	0,02 %	NCC AB Klasse B	18.565	356.675	0,02 %
Tecnicas Reunidas SA	7.682	244.081	0,02 %	AF AB Klasse B	14.991	331.221	0,02 %
Lar Espana Real Estate Socimi SA REIT	21.365	228.074	0,02 %	Pandex AB Klasse B	16.806	325.344	0,02 %
Faes Farma SA	64.369	227.245	0,02 %	Kungsleden AB	44.102	320.497	0,02 %
Sacyr SA	76.510	216.729	0,01 %	Evolution Gaming Group AB	4.443	315.012	0,02 %
Construcciones y Auxiliar de Ferrocarriles SA	5.271	216.339	0,01 %	Nolato AB Klasse B	4.348	286.238	0,02 %
Compania de Distribucion Integral Logista Holdings SA	9.143	210.466	0,01 %	Bravida Holding AB	42.384	283.940	0,02 %
Atresmedia Corp. de Medios de Comunicacion SA	19.780	206.641	0,01 %	NetEnt AB	40.430	278.998	0,02 %
Ence Energia y Celulosa SA	30.717	202.867	0,01 %	Attendo AB	24.419	262.309	0,02 %
Fomento de Construcciones y Contratas SA	18.987	196.669	0,01 %	Bonava AB Klasse B	18.555	259.713	0,02 %
Corp. Financiera Alba SA	3.197	183.195	0,01 %	SSAB AB Klasse A	47.209	258.893	0,02 %
Liberbank SA	297.047	157.659	0,01 %	Scandic Hotels Group AB	16.797	241.569	0,02 %
Almirall SA	14.450	144.886	0,01 %	Avanza Bank Holding AB	5.532	232.496	0,02 %
Euskaltel SA	16.860	137.629	0,01 %	Nobia AB	25.157	213.239	0,01 %
Papeles y Cartones de Europa SA	9.909	134.634	0,01 %	Ratos AB Klasse B	48.216	211.061	0,01 %
Obrascon Huarte Lain SA	22.031	131.772	0,01 %	Vitrolife AB	2.751	209.328	0,01 %
Miquel y Costas & Miquel SA	2.944	127.301	0,01 %	Hoist Finance AB	18.395	207.260	0,01 %
Telepizza Group SA	21.551	121.629	0,01 %	Cloetta AB Klasse B	54.001	195.888	0,01 %
Pharma Mar SA	40.358	120.185	0,01 %	Bilia AB Klasse A	19.622	191.726	0,01 %
Saeta Yield SA	10.192	120.060	0,01 %	Betsson AB	25.352	187.334	0,01 %
Talgo SA	23.150	118.394	0,01 %	Klovern AB Klasse B	139.441	182.572	0,01 %
Codere SA	11.636	111.640	0,01 %	Mycronic AB	15.585	161.798	0,01 %
Tubacex SA	23.592	94.903	0,01 %	Granges AB	15.707	161.626	0,01 %
Realia Business SA	56.121	74.129	0,01 %	LeoVegas AB	15.577	159.337	0,01 %
Global Dominion Access SA	10.704	55.462	0,00 %	Arjo AB	50.662	144.855	0,01 %
Faes Farma SA - Rights Issue 24.1.2018	64.369	7.961	0,00 %	Capio AB	26.551	142.686	0,01 %
Let's GOWEX SA	3.759	—	0,00 %	Hansa Medical AB	4.568	139.202	0,01 %
		14.955.086	1,04 %	AcadeMedia AB	17.404	137.638	0,01 %
				Biotage AB	13.177	135.190	0,01 %
Schweden 2,05 % (2016: 1,90 %)				Dios Fastigheter AB	19.615	133.562	0,01 %
Svenska Cellulosa AB SCA Klasse B	135.481	1.399.074	0,10 %	Fingerprint Cards AB Klasse B	68.597	132.460	0,01 %
Trelleborg AB Klasse B	56.274	1.305.900	0,09 %	Nordax Group AB	20.438	132.301	0,01 %
Castellum AB	57.643	974.387	0,07 %	BioGaia AB Klasse B	3.312	131.873	0,01 %
Nibe Industrier AB Klasse B	80.131	769.258	0,05 %	Resurs Holding AB	18.422	131.063	0,01 %
Kindred Group plc	48.626	697.245	0,05 %	Lindab International AB	15.561	129.620	0,01 %
Saab AB Klasse B	14.182	691.129	0,05 %	Nobina AB	18.594	122.635	0,01 %
Loomis AB Klasse B	16.170	680.572	0,05 %	Bure Equity AB	10.199	122.388	0,01 %
BillerudKorsnas AB	39.398	676.082	0,05 %	Inwido AB	11.928	122.012	0,01 %
Elekta AB Klasse B	81.211	672.006	0,05 %	Alimak Group AB	7.746	121.098	0,01 %
Dometic Group AB	65.735	670.798	0,05 %	Recipharm AB Klasse B	9.293	112.084	0,01 %
Intrum Justitia AB	17.821	660.166	0,05 %	Eitel AB	30.340	107.464	0,01 %
Fabege AB	29.016	618.772	0,04 %	Clas Ohlson AB Klasse B	7.741	106.365	0,01 %
Fastighets AB Balder Klasse B	22.807	611.158	0,04 %	D Carnegie & Co. AB Klasse B	7.054	105.325	0,01 %
Hexpol AB	58.424	593.338	0,04 %	Dustin Group AB	10.411	103.633	0,01 %
Holmen AB Klasse B	11.069	589.445	0,04 %	RaySearch Laboratories AB	4.936	103.091	0,01 %
SSAB AB Klasse B	130.062	581.566	0,04 %	Munters Group AB	15.036	101.464	0,01 %
AAK AB	6.626	568.521	0,04 %	SkiStar AB	5.197	100.290	0,01 %
Indutrade AB	20.545	561.082	0,04 %	Haldex AB	8.699	92.701	0,01 %
Thule Group AB	22.938	518.014	0,04 %	Byggmax Group AB	13.302	89.357	0,01 %
Com Hem Holding AB	31.778	486.713	0,03 %	Investment AB Oresund	5.481	88.198	0,01 %
Ahlsell AB	75.406	486.282	0,03 %	Bufab AB	6.659	86.414	0,01 %
Modern Times Group MTG AB Klasse B	11.539	485.942	0,03 %	Scandi Standard AB	10.463	81.148	0,01 %
Swedish Orphan Biovitrum AB	34.750	476.632	0,03 %	Mekonomen AB	4.451	81.137	0,01 %
Hemfosa Fastigheter AB	34.378	461.452	0,03 %	KappAhl AB	14.588	80.713	0,01 %
Axfood AB	23.475	453.300	0,03 %	Cherry AB	12.225	73.611	0,01 %
Hufvudstaden AB Klasse A	25.011	401.398	0,03 %	Victoria Park AB Klasse B	18.958	68.075	0,00 %
Wallenstam AB Klasse B	40.414	389.455	0,03 %	Collector AB	6.781	67.292	0,00 %
Oriflame Holding AG	9.154	378.235	0,03 %	Tobii AB	15.551	67.237	0,00 %
JM AB	16.417	374.759	0,03 %	Probi AB	1.387	57.598	0,00 %
				Bergman & Beving AB Klasse B	5.473	57.487	0,00 %
				New Wave Group AB Klasse B	8.222	54.730	0,00 %
				ITAB Shop Concept AB Klasse B	8.545	54.010	0,00 %
				Starbreeze AB	47.209	48.434	0,00 %
				Camurus AB	2.844	47.241	0,00 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Paradox Interactive AB	4.139	47.140	0,00 %	Huber + Suhner AG	3.230	168.543	0,01 %
SAS AB	17.421	45.321	0,00 %	ALSO Holding AG	1.211	166.520	0,01 %
Arcam AB	1.055	44.455	0,00 %	Kardex AG	1.317	161.635	0,01 %
Elanders AB Klasse B	3.939	39.450	0,00 %	APG SGA SA	335	156.500	0,01 %
Gunnebo AB	9.252	38.081	0,00 %	Bachem Holding AG Klasse B	965	152.499	0,01 %
Volati AB	4.873	37.645	0,00 %	Zur Rose Group AG	1.065	143.166	0,01 %
Humana AB	4.209	28.274	0,00 %	Bell Food Group AG	313	137.951	0,01 %
Rezidor Hotel Group AB	8.554	26.746	0,00 %	Ypsomed Holding AG	787	129.700	0,01 %
Industrial & Financial NPV	618	1.972	0,00 %	Orior AG	1.487	117.724	0,01 %
		29.486.457	2,05 %	Leonteq AG	1.815	117.337	0,01 %
Schweiz 2,02 % (2016: 1,79 %)				Burkhalter Holding AG	830	108.083	0,01 %
Temenos Group AG	13.477	1.728.707	0,12 %	Intershop Holding AG	213	106.445	0,01 %
ams AG	14.310	1.298.840	0,09 %	Kudelski SA	8.301	102.644	0,01 %
Georg Fischer AG	915	1.209.359	0,08 %	Gurit Holding AG	71	76.719	0,01 %
Logitech International SA	35.621	1.202.597	0,08 %	Zehnder Group AG	1.851	75.882	0,01 %
Flughafen Zurich AG	4.656	1.064.979	0,07 %	Feintool International Holding AG	602	72.895	0,01 %
Transocean Ltd.	88.780	948.170	0,07 %	Schmolz + Bickenbach AG	82.120	70.786	0,01 %
PSP Swiss Property AG	9.027	855.458	0,06 %	Mobilezone Holding AG	4.542	59.892	0,00 %
Helvetia Holding AG	1.465	824.579	0,06 %	Swissquote Group Holding SA	1.512	59.192	0,00 %
Aryzta AG	20.595	816.826	0,06 %	Molecular Partners AG	1.698	45.826	0,00 %
OC Oerlikon Corp.AG	45.201	763.013	0,05 %	Investis Holding SA	701	45.067	0,00 %
VAT Group AG	4.668	691.698	0,05 %	EDAG Engineering Group AG	1.959	34.580	0,00 %
Sunrise Communications Group AG	7.409	676.656	0,05 %	Walter Meier AG	778	31.056	0,00 %
dormakaba Holding AG	702	653.735	0,05 %			29.102.333	2,02 %
Idorsia Ltd.	23.881	623.675	0,04 %	Vereinigtes Königreich 7,59 % (2016: 6,50 %)			
Cembra Money Bank AG	6.500	605.977	0,04 %	Informa plc	184.100	1.798.078	0,12 %
Bucher Industries AG	1.464	594.914	0,04 %	Rentokil Initial plc	408.692	1.758.089	0,12 %
GAM Holding AG	35.865	579.655	0,04 %	DS Smith plc	238.146	1.667.137	0,12 %
Galenica AG	11.234	576.975	0,04 %	Halma plc	84.054	1.432.671	0,10 %
Banque Cantonale Vaudoise	713	537.768	0,04 %	Bellway plc	27.312	1.316.397	0,09 %
Tecan Group AG	2.572	534.987	0,04 %	Spirax-Sarco Engineering plc	16.864	1.282.078	0,09 %
Allreal Holding AG	3.006	508.352	0,04 %	Hiscox Ltd.	64.637	1.280.088	0,09 %
Landis+Gyr Group AG	6.063	482.800	0,03 %	Just Eat plc	121.119	1.279.619	0,09 %
SFS Group AG	3.617	420.158	0,03 %	Melrose Industries plc	434.969	1.248.594	0,09 %
Valiant Holding AG	3.717	402.023	0,03 %	Rightmove plc	20.129	1.225.328	0,08 %
Sulzer AG	3.259	395.294	0,03 %	Booker Group plc	376.658	1.166.810	0,08 %
Forbo Holding AG	251	387.640	0,03 %	BBA Aviation plc	235.968	1.116.262	0,08 %
Panalpina Welttransport Holding AG	2.472	383.293	0,03 %	RPC Group plc	92.418	1.102.038	0,08 %
Mobimo Holding AG	1.346	361.189	0,03 %	ASOS plc	12.087	1.097.949	0,08 %
Vontobel Holding AG	5.673	358.019	0,02 %	B&M European Value Retail SA	189.795	1.087.573	0,08 %
Emmi AG	487	350.570	0,02 %	Intermediate Capital Group plc	66.699	1.034.002	0,07 %
Bossard Holding AG	1.383	326.414	0,02 %	Man Group plc	366.146	1.024.289	0,07 %
Daetwyler Holding AG	1.661	321.121	0,02 %	Derwent London plc REIT	23.431	988.290	0,07 %
Conzzeta AG	300	312.776	0,02 %	Tate & Lyle plc	103.831	987.415	0,07 %
Schweiter Technologies AG	241	312.595	0,02 %	SSP Group plc	106.354	982.635	0,07 %
COSMO Pharmaceuticals NV	1.964	295.053	0,02 %	Pennon Group plc	92.747	982.379	0,07 %
St Galler Kantonalbank AG	582	289.059	0,02 %	Inchcape plc	92.188	975.835	0,07 %
u-blox Holding AG	1.427	280.861	0,02 %	TP ICAP plc	127.696	918.981	0,06 %
Comet Holding AG	1.698	267.289	0,02 %	BTG plc	88.036	908.067	0,06 %
Inficon Holding AG	392	244.774	0,02 %	CYBG plc	197.024	905.383	0,06 %
Implenia AG	3.615	244.462	0,02 %	Indivior plc	163.502	902.846	0,06 %
Bobst Group SA	1.836	244.172	0,02 %	Spectris plc	26.352	886.557	0,06 %
Komax Holding AG	744	243.928	0,02 %	Howden Joinery Group plc	138.814	876.560	0,06 %
Valora Holding AG	724	241.457	0,02 %	UBM plc	86.535	874.440	0,06 %
Siegfried Holding AG	706	234.730	0,02 %	Tullow Oil plc	310.732	868.428	0,06 %
Burckhardt Compression Holding AG	641	207.856	0,01 %	Phoenix Group Holdings	81.462	861.746	0,06 %
EFG International AG	18.998	200.800	0,01 %	Beazley plc	117.401	848.862	0,06 %
VZ Holding AG	584	198.063	0,01 %	Electrocomponents plc	99.376	842.209	0,06 %
Meyer Burger Technology AG	114.517	196.248	0,01 %	Ladbroke's Coral Group plc	340.195	837.102	0,06 %
BKW AG	3.216	191.244	0,01 %	William Hill plc	191.447	833.915	0,06 %
Arbonia AG	11.421	190.448	0,01 %	Jupiter Fund Management plc	95.403	811.119	0,06 %
Ascom Holding AG	6.983	180.576	0,01 %	Metro Bank plc	16.653	807.380	0,06 %
Basilea Pharmaceutica AG	2.294	178.671	0,01 %	GVC Holdings plc	64.193	803.243	0,06 %
LEM Holding SA	105	177.999	0,01 %	IG Group Holdings plc	81.157	787.708	0,05 %
Rieter Holding AG	711	173.500	0,01 %	Playtech plc	67.209	782.341	0,05 %
Autoneum Holding AG	589	169.689	0,01 %	Capital & Counties Properties plc	178.683	772.758	0,05 %
				WH Smith plc	24.143	766.517	0,05 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Hays plc	302.123	747.507	0,05 %	Workspace Group plc REIT	27.539	373.279	0,03 %
Rotork plc	206.421	745.281	0,05 %	JRP Group plc	157.700	363.512	0,03 %
Shaftesbury plc REIT	50.988	720.089	0,05 %	Cineworld Group plc	44.015	357.843	0,02 %
NMC Health plc	18.001	702.522	0,05 %	Grainger plc	90.696	355.185	0,02 %
Intu Properties plc REIT	202.780	694.006	0,05 %	Evraz plc	76.894	353.662	0,02 %
Great Portland Estates plc REIT	74.293	691.941	0,05 %	Senior plc	99.275	350.105	0,02 %
Close Brothers Group plc	34.919	683.987	0,05 %	Serco Group plc	259.005	346.515	0,02 %
KAZ Minerals plc	56.370	682.097	0,05 %	Galliford Try plc	19.890	346.014	0,02 %
HomeServe plc	62.108	680.114	0,05 %	Countryside Properties plc	71.833	343.017	0,02 %
Inmarsat plc	102.333	679.419	0,05 %	John Laing Group plc	86.103	342.439	0,02 %
Victrex plc	18.836	672.173	0,05 %	Entertainment One Ltd.	76.736	337.884	0,02 %
UDG Healthcare plc	57.349	655.541	0,05 %	Safestore Holdings plc REIT	49.543	334.828	0,02 %
Fevertree Drinks plc	20.963	645.705	0,04 %	Clinigen Group plc	23.793	331.516	0,02 %
Britvic plc	58.521	645.189	0,04 %	Brewin Dolphin Holdings plc	62.380	329.100	0,02 %
Ocado Group plc	119.486	641.851	0,04 %	Drax Group plc	89.527	327.717	0,02 %
Aggreko plc	57.570	622.244	0,04 %	AA plc	141.936	326.407	0,02 %
Tritax Big Box plc REIT	308.248	620.887	0,04 %	Kier Group plc	21.868	321.851	0,02 %
Abcam plc	42.849	611.520	0,04 %	Equiniti Group plc	82.552	318.601	0,02 %
Balfour Beatty plc	150.021	602.734	0,04 %	lbstock plc	86.920	313.353	0,02 %
NEX Group plc	73.274	601.171	0,04 %	SuperGroup plc	11.665	311.967	0,02 %
Dechra Pharmaceuticals plc	21.133	599.197	0,04 %	OM Asset Management plc	18.329	307.011	0,02 %
Moneysupermarket.com Group plc	124.302	598.949	0,04 %	Ultra Electronics Holdings plc	16.832	306.705	0,02 %
Dixons Carphone plc	220.362	593.208	0,04 %	NewRiver plc REIT	67.753	306.487	0,02 %
UNITE Group plc REIT	54.293	591.231	0,04 %	888 Holdings plc	80.262	305.854	0,02 %
Renishaw plc	7.990	564.743	0,04 %	Sirius Minerals plc	951.124	302.359	0,02 %
Thomas Cook Group plc	333.220	553.988	0,04 %	Morgan Advanced Materials plc	65.416	298.482	0,02 %
Grafton Group plc	50.934	552.586	0,04 %	SIG plc	123.720	294.892	0,02 %
Daily Mail & General Trust plc	67.305	543.094	0,04 %	Hill & Smith Holdings plc	16.139	292.331	0,02 %
IWG plc	155.153	540.239	0,04 %	Card Factory plc	72.632	289.944	0,02 %
Bodycote plc	42.945	530.397	0,04 %	J D Wetherspoon plc	17.016	289.341	0,02 %
AVEVA Group plc	14.178	530.307	0,04 %	ZPG plc	64.594	288.877	0,02 %
National Express Group plc	101.250	521.703	0,04 %	IQE plc	154.875	287.025	0,02 %
Centamin plc	243.538	521.513	0,04 %	Sports Direct International plc	54.583	278.366	0,02 %
Greene King plc	67.596	507.495	0,04 %	Hastings Group Holdings plc	64.078	277.381	0,02 %
Domino's Pizza Group plc	108.512	507.452	0,04 %	Rhi Magnesita NV (XWBO)	5.295	277.251	0,02 %
Greencore Group plc	160.957	500.136	0,03 %	Purplebricks Group plc	49.100	276.473	0,02 %
Hikma Pharmaceuticals plc	32.556	499.415	0,03 %	Dignity plc	11.092	273.086	0,02 %
Bovis Homes Group plc	31.371	497.363	0,03 %	Smart Metering Systems plc	22.481	265.946	0,02 %
Genus plc	14.417	493.611	0,03 %	Marshalls plc	43.007	264.650	0,02 %
Ascential plc	93.341	486.507	0,03 %	Stobart Group Ltd.	69.287	263.844	0,02 %
Ashmore Group plc	87.200	477.855	0,03 %	PZ Cussons plc	59.580	260.731	0,02 %
Savills plc	35.027	470.511	0,03 %	Virgin Money Holdings UK plc	67.238	258.498	0,02 %
Sophos Group plc	60.746	468.393	0,03 %	Renewi plc	182.608	255.175	0,02 %
Pagegroup plc	73.957	467.712	0,03 %	Keywords Studios plc	11.787	255.118	0,02 %
Assura plc REIT	526.256	454.899	0,03 %	Aldermore Group plc	58.837	246.973	0,02 %
Redrow plc	51.289	454.100	0,03 %	Marston's plc	161.657	246.017	0,02 %
JD Sports Fashion plc	98.740	449.064	0,03 %	Dairy Crest Group plc	31.451	245.274	0,02 %
Elementis plc	114.820	447.485	0,03 %	OneSavings Bank plc	43.701	243.915	0,02 %
Firstgroup plc	292.127	436.668	0,03 %	McCarthy & Stone plc	113.641	242.583	0,02 %
BGEO Group plc	9.032	434.596	0,03 %	Ferrexpo plc	60.322	239.171	0,02 %
Essentra plc	60.271	431.710	0,03 %	Telecom Plus plc	14.686	238.596	0,02 %
Saga plc	252.530	430.429	0,03 %	Hunting plc	28.839	236.022	0,02 %
Diploma plc	25.420	428.805	0,03 %	TalkTalk Telecom Group plc	114.283	234.832	0,02 %
Greggs plc	22.494	425.698	0,03 %	Polypipe Group plc	43.732	232.611	0,02 %
Big Yellow Group plc REIT	35.681	419.686	0,03 %	St Modwen Properties plc	41.866	229.822	0,02 %
Lancashire Holdings Ltd.	45.422	419.052	0,03 %	esure Group plc	68.076	228.843	0,02 %
Londonmetric Property plc REIT	166.152	418.058	0,03 %	Halfords Group plc	48.357	228.821	0,02 %
Crest Nicholson Holdings plc	56.318	415.204	0,03 %	Pets at Home Group plc	95.775	228.543	0,02 %
QinetiQ Group plc	131.887	412.306	0,03 %	P2P Global Investments plc	20.660	227.775	0,02 %
Provident Financial plc	32.850	399.052	0,03 %	Biffa plc	64.041	226.974	0,02 %
Synthomer plc	59.771	397.323	0,03 %	Fenner plc	41.841	226.260	0,02 %
Rathbone Brothers plc	11.480	396.625	0,03 %	Plus500 Ltd.	18.163	223.218	0,02 %
Cairn Energy plc	136.531	394.872	0,03 %	Stagecoach Group plc	99.918	222.615	0,02 %
Paragon Banking Group plc	59.026	391.811	0,03 %	Victoria plc	19.711	220.645	0,02 %
boohoo.com plc	152.342	388.462	0,03 %	Ted Baker plc	5.996	219.892	0,02 %
Petrofac Ltd.	55.932	385.876	0,03 %	El Group plc	114.728	219.218	0,02 %
Vesuvius plc	48.734	385.001	0,03 %	Vectura Group plc	136.250	216.935	0,01 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
NCC Group plc	64.596	204.474	0,01 %	Faroe Petroleum plc	57.729	81.998	0,01 %
Spire Healthcare Group plc	59.237	203.217	0,01 %	EnQuest plc	212.279	81.841	0,01 %
Keller Group plc	15.439	203.212	0,01 %	Nostrum Oil & Gas plc	18.056	79.626	0,01 %
Conviviality plc	37.094	202.597	0,01 %	Majestic Wine plc	12.709	77.193	0,01 %
CVS Group plc	14.245	200.600	0,01 %	iomart Group plc	14.488	76.435	0,01 %
Hochschild Mining plc	55.503	198.216	0,01 %	Soco International plc	49.545	74.730	0,01 %
Dunelm Group plc	21.090	197.567	0,01 %	Pan African Resources plc	403.594	72.340	0,00 %
Mitie Group plc	75.441	197.166	0,01 %	Lonmin plc	63.266	71.462	0,00 %
de La Rue plc	22.555	195.730	0,01 %	CMC Markets plc	31.345	63.603	0,00 %
Primary Health Properties plc REIT	122.384	193.699	0,01 %	Staffline Group plc	4.058	57.090	0,00 %
Northgate plc	36.999	190.817	0,01 %	SafeCharge International Group Ltd.	13.715	54.917	0,00 %
Go-Ahead Group plc	9.455	190.447	0,01 %	Kainos Group plc	11.730	53.871	0,00 %
Laird plc	101.951	189.632	0,01 %	SolGold plc	121.226	48.377	0,00 %
Dart Group plc	20.525	188.942	0,01 %	Countrywide plc	28.607	46.534	0,00 %
Arrow Global Group plc	34.883	187.218	0,01 %	Telit Communications plc	20.599	41.798	0,00 %
Scapa Group plc	30.953	183.607	0,01 %	Amerisur Resources plc	161.340	40.377	0,00 %
Mitchells & Butlers plc	4.780	183.064	0,01 %	Hotel Chocolat Group Ltd.	7.845	39.266	0,00 %
Restore plc	22.945	182.664	0,01 %	Dialight plc	4.198	31.234	0,00 %
Softcat plc	25.966	182.653	0,01 %	Rhi Magnesia NV (XLON)	563	29.740	0,00 %
RPS Group plc	49.290	181.528	0,01 %	Luceco plc	16.402	24.628	0,00 %
Forterra plc	44.317	178.800	0,01 %				
Vedanta Resources plc	16.336	177.783	0,01 %			109.297.616	7,59 %
GB Group plc	30.023	176.771	0,01 %				
Advanced Medical Solutions Group plc	40.728	175.064	0,01 %	USA 54,18 % (2016: 57,98 %)			
Restaurant Group plc	41.664	169.647	0,01 %	XPO Logistics, Inc.	26.300	2.408.817	0,17 %
KCOM Group plc	137.748	169.102	0,01 %	Alcoa Corp.	41.168	2.217.720	0,15 %
Empiric Student Property plc REIT	134.323	168.532	0,01 %	Nektar Therapeutics Klasse A	35.134	2.098.202	0,15 %
Hanstee Holdings plc REIT	82.706	159.989	0,01 %	NRG Energy, Inc.	71.163	2.026.722	0,14 %
Photo-Me International plc	61.399	152.826	0,01 %	Exelixis, Inc.	66.496	2.021.478	0,14 %
EMIS Group plc	11.155	152.559	0,01 %	Copart, Inc.	46.467	2.006.910	0,14 %
Redde plc	64.327	152.500	0,01 %	WellCare Health Plans, Inc.	9.911	1.993.201	0,14 %
On the Beach Group plc	23.894	151.916	0,01 %	ON Semiconductor Corp.	95.073	1.990.829	0,14 %
Alfa Financial Software Holdings plc	20.823	150.700	0,01 %	Bluebird Bio, Inc.	10.986	1.956.607	0,14 %
Stock Spirits Group plc	41.065	149.292	0,01 %	Burlington Stores, Inc.	15.557	1.913.978	0,13 %
Civitas Social Housing plc REIT	96.438	147.742	0,01 %	Teradyne, Inc.	44.458	1.861.456	0,13 %
Blue Prism Group plc	8.337	141.988	0,01 %	Thor Industries, Inc.	11.908	1.794.774	0,12 %
Chemring Group plc	56.884	141.395	0,01 %	PerkinElmer, Inc.	24.451	1.787.857	0,12 %
RDI plc REIT	278.515	138.723	0,01 %	ABIOMED, Inc.	9.484	1.777.396	0,12 %
John Menzies plc	15.068	138.708	0,01 %	Lamb Weston Holdings, Inc.	30.857	1.741.878	0,12 %
Rank Group plc	42.448	138.673	0,01 %	MarketAxess Holdings, Inc.	8.535	1.721.936	0,12 %
ITE Group plc	56.163	138.084	0,01 %	Berry Global Group, Inc.	29.330	1.720.791	0,12 %
Central Asia Metals plc	33.230	137.553	0,01 %	Keysight Technologies, Inc.	41.113	1.710.301	0,12 %
Ophir Energy plc	146.160	134.448	0,01 %	Nordson Corp.	11.636	1.703.510	0,12 %
Costain Group plc	21.052	133.206	0,01 %	Orbital ATK, Inc.	12.897	1.695.956	0,12 %
Premier Oil plc	127.869	131.893	0,01 %	Graco, Inc.	37.155	1.680.149	0,12 %
N Brown Group plc	34.783	127.372	0,01 %	FactSet Research Systems, Inc.	8.703	1.677.590	0,12 %
International Personal Finance plc	47.502	126.910	0,01 %	Equity LifeStyle Properties, Inc. REIT	18.796	1.673.220	0,12 %
Oxford Instruments plc	10.988	126.493	0,01 %	Gaming and Leisure Properties, Inc. REIT	44.968	1.663.816	0,12 %
Hurricane Energy plc	301.344	126.369	0,01 %	Kilroy Realty Corp. REIT	22.190	1.656.484	0,12 %
Pendragon plc	323.726	124.807	0,01 %	STERIS plc	18.911	1.654.145	0,11 %
Watkin Jones plc	41.124	122.109	0,01 %	WP Carey, Inc. REIT	23.949	1.650.086	0,11 %
Debenhams plc	251.352	118.156	0,01 %	West Pharmaceutical Services, Inc.	16.610	1.638.909	0,11 %
Allied Minds plc	52.219	116.555	0,01 %	Adient plc	20.774	1.634.914	0,11 %
Petra Diamonds Ltd.	109.781	115.835	0,01 %	Universal Display Corp.	9.425	1.627.226	0,11 %
DFS Furniture plc	43.617	115.646	0,01 %	Janus Henderson Group plc	42.312	1.618.857	0,11 %
Sound Energy plc Klasse A	162.095	111.830	0,01 %	Carlisle Cos, Inc.	14.101	1.602.579	0,11 %
Lookers plc	78.624	109.549	0,01 %	PTC, Inc.	26.003	1.580.202	0,11 %
Standard Life Investment Property Income Trust Ltd. REIT	85.918	108.380	0,01 %	Coherent, Inc.	5.574	1.573.094	0,11 %
Hostelworld Group plc	20.487	106.144	0,01 %	Aqua America, Inc.	40.057	1.571.436	0,11 %
AO World plc	64.438	95.885	0,01 %	Toro Co.	24.048	1.568.651	0,11 %
Acacia Mining plc	34.900	93.714	0,01 %	Pinnacle Foods, Inc.	26.263	1.561.861	0,11 %
Gocompare.Com Group plc	63.476	91.663	0,01 %	Hubbell, Inc. Klasse B	11.538	1.561.553	0,11 %
Premier Foods plc	155.018	89.647	0,01 %	Great Plains Energy, Inc.	48.392	1.560.158	0,11 %
Helical plc	19.318	88.850	0,01 %	RPM International, Inc.	29.636	1.553.519	0,11 %
Telford Homes plc	15.536	88.163	0,01 %	Service Corp. International	41.559	1.550.982	0,11 %
Schroder Ltd. REIT	104.196	85.275	0,01 %	Neurocrine Biosciences, Inc.	19.977	1.550.015	0,11 %
				KAR Auction Services, Inc.	30.480	1.539.545	0,11 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Apartment Investment & Management Co. REIT Klasse A	35.158	1.536.756	0,11 %	EPAM Systems, Inc.	11.234	1.206.869	0,08 %
ServiceMaster Global Holdings, Inc.	29.960	1.536.049	0,11 %	Old Republic International Corp.	56.216	1.201.898	0,08 %
Sun Communities, Inc. REIT	16.418	1.523.262	0,11 %	Pool Corp.	9.263	1.200.948	0,08 %
US Foods Holding Corp.	47.499	1.516.643	0,11 %	athenahealth, Inc.	9.026	1.200.819	0,08 %
Oshkosh Corp.	16.644	1.512.773	0,11 %	Sterling Bancorp	48.750	1.199.250	0,08 %
Huntsman Corp.	45.296	1.507.904	0,10 %	Royal Gold, Inc.	14.588	1.197.967	0,08 %
PacWest Bancorp	28.608	1.441.843	0,10 %	First Solar, Inc.	17.517	1.182.748	0,08 %
Douglas Emmett, Inc. REIT	34.924	1.433.979	0,10 %	Charles River Laboratories International, Inc.	10.787	1.180.637	0,08 %
Sage Therapeutics, Inc.	8.669	1.427.871	0,10 %	Commerce Bancshares, Inc.	21.100	1.178.224	0,08 %
Ionis Pharmaceuticals, Inc.	27.826	1.399.648	0,10 %	CyrusOne, Inc. REIT	19.749	1.175.658	0,08 %
United States Steel Corp.	39.685	1.396.515	0,10 %	Sonoco Products Co.	22.054	1.171.950	0,08 %
Tyler Technologies, Inc.	7.834	1.387.010	0,10 %	MGIC Investment Corp.	83.017	1.171.370	0,08 %
Exact Sciences Corp.	26.355	1.384.692	0,10 %	Post Holdings, Inc.	14.741	1.167.929	0,08 %
Reliance Steel & Aluminum Co.	16.132	1.383.964	0,10 %	Bright Horizons Family Solutions, Inc.	12.383	1.164.002	0,08 %
Lamar Advertising Co. REIT Klasse A	18.596	1.380.567	0,10 %	CubeSmart REIT	40.105	1.159.837	0,08 %
First American Financial Corp.	24.632	1.380.377	0,10 %	Valvoline, Inc.	46.182	1.157.321	0,08 %
Ultimate Software Group, Inc.	6.314	1.377.904	0,10 %	Black Knight, Inc.	26.072	1.151.079	0,08 %
Donaldson Co., Inc.	28.035	1.372.313	0,10 %	Watsco, Inc.	6.756	1.148.790	0,08 %
Teledyne Technologies, Inc.	7.557	1.368.951	0,10 %	Forest City Realty Trust, Inc. REIT Klasse A	47.352	1.141.183	0,08 %
Quanta Services, Inc.	34.968	1.367.598	0,09 %	American Homes 4 Rent REIT Klasse A	52.228	1.140.660	0,08 %
Brown & Brown, Inc.	26.508	1.364.102	0,09 %	MKS Instruments, Inc.	12.039	1.137.686	0,08 %
Healthcare Trust of America, Inc. REIT Klasse A	45.069	1.353.873	0,09 %	Trinity Industries, Inc.	30.370	1.137.660	0,08 %
Bank of the Ozarks	27.914	1.352.433	0,09 %	Webster Financial Corp.	20.256	1.137.577	0,08 %
LogMeIn, Inc.	11.765	1.347.093	0,09 %	Cypress Semiconductor Corp.	74.383	1.133.597	0,08 %
First Horizon National Corp.	67.261	1.344.547	0,09 %	Murphy Oil Corp.	36.489	1.132.983	0,08 %
Microsemi Corp.	25.931	1.339.336	0,09 %	Skechers U.S.A., Inc. Klasse A	29.926	1.132.400	0,08 %
Genlex Corp.	63.761	1.335.793	0,09 %	CSRA, Inc.	37.655	1.126.638	0,08 %
Cullen/Frost Bankers, Inc.	14.078	1.332.483	0,09 %	Bio-Rad Laboratories, Inc. Klasse A	4.713	1.124.852	0,08 %
Dunkin' Brands Group, Inc.	20.516	1.322.667	0,09 %	DexCom, Inc.	19.596	1.124.614	0,08 %
Synovus Financial Corp.	27.572	1.321.802	0,09 %	Bio-Techne Corp.	8.671	1.123.328	0,08 %
GoDaddy, Inc. Klasse A	26.242	1.319.448	0,09 %	Curtiss-Wright Corp.	9.193	1.120.167	0,08 %
Olin Corp.	36.914	1.313.400	0,09 %	Medical Properties Trust, Inc. REIT	81.061	1.117.021	0,08 %
Foot Locker, Inc.	28.010	1.313.109	0,09 %	Brunswick Corp.	20.206	1.115.775	0,08 %
GrubHub, Inc.	18.213	1.307.693	0,09 %	MDU Resources Group, Inc.	41.422	1.113.423	0,08 %
Cavium, Inc.	15.559	1.304.311	0,09 %	MEDNAX, Inc.	20.785	1.110.750	0,08 %
AECOM	35.001	1.300.287	0,09 %	Teradata Corp.	28.823	1.108.533	0,08 %
Allison Transmission Holdings, Inc.	30.125	1.297.484	0,09 %	HealthSouth Corp.	22.360	1.104.808	0,08 %
Bioerativ, Inc.	23.758	1.281.031	0,09 %	Howard Hughes Corp.	8.410	1.103.981	0,08 %
Carter's, Inc.	10.802	1.269.127	0,09 %	Hospitality Properties Trust REIT	36.964	1.103.375	0,08 %
Western Alliance Bancorp	22.395	1.268.005	0,09 %	EMCOR Group, Inc.	13.384	1.094.142	0,08 %
Starwood Property Trust, Inc. REIT	58.937	1.258.305	0,09 %	Genesee & Wyoming, Inc. Klasse A	13.750	1.082.537	0,08 %
Hexcel Corp.	20.329	1.257.349	0,09 %	Six Flags Entertainment Corp.	16.206	1.078.833	0,07 %
American Campus Communities, Inc. REIT	30.640	1.257.159	0,09 %	National Instruments Corp.	25.902	1.078.300	0,07 %
Energen Corp.	21.826	1.256.523	0,09 %	Pinnacle Financial Partners, Inc.	16.229	1.075.983	0,07 %
Booz Allen Hamilton Holding Corp. Klasse A	32.936	1.255.850	0,09 %	EPR Properties REIT	16.436	1.075.901	0,07 %
Hill-Rom Holdings, Inc.	14.712	1.240.074	0,09 %	Graphic Packaging Holdings Co.	69.448	1.072.972	0,07 %
DCT Industrial Trust, Inc. REIT	21.093	1.239.847	0,09 %	RSP Permian, Inc.	26.350	1.071.918	0,07 %
WPX Energy, Inc.	88.118	1.239.820	0,09 %	Aspen Technology, Inc.	16.130	1.067.806	0,07 %
Catalent, Inc.	30.028	1.233.550	0,09 %	Core Laboratories NV	9.733	1.066.250	0,07 %
New Residential Investment Corp. REIT	68.776	1.229.715	0,09 %	Patterson-UTI Energy, Inc.	46.287	1.065.064	0,07 %
Calpine Corp.	81.212	1.228.738	0,09 %	Nuance Communications, Inc.	65.001	1.062.766	0,07 %
Vectren Corp.	18.863	1.226.472	0,09 %	Air Lease Corp. Klasse A	21.673	1.042.255	0,07 %
AptarGroup, Inc.	14.211	1.226.125	0,09 %	Scotts Miracle-Gro Co. Klasse A	9.731	1.041.120	0,07 %
Eagle Materials, Inc.	10.809	1.224.660	0,08 %	ITT, Inc.	19.472	1.039.221	0,07 %
Guidewire Software, Inc.	16.479	1.223.731	0,08 %	IDACORP, Inc.	11.357	1.037.576	0,07 %
Zebra Technologies Corp. Klasse A	11.778	1.222.556	0,08 %	Fair Isaac Corp.	6.766	1.036.551	0,07 %
WEX, Inc.	8.651	1.221.781	0,08 %	Hanover Insurance Group, Inc.	9.590	1.036.487	0,07 %
Highwoods Properties, Inc. REIT	23.919	1.217.716	0,08 %	Delphi Technologies plc	19.697	1.033.502	0,07 %
Omega Healthcare Investors, Inc. REIT	44.177	1.216.635	0,08 %	Dana, Inc.	32.283	1.033.379	0,07 %
Hudson Pacific Properties, Inc. REIT	35.513	1.216.320	0,08 %	Prosperity Bancshares, Inc.	14.736	1.032.552	0,07 %
BWX Technologies, Inc.	20.063	1.213.611	0,08 %	MAXIMUS, Inc.	14.417	1.031.969	0,07 %
Lincoln Electric Holdings, Inc.	13.191	1.208.032	0,08 %	ARRIS International plc	40.073	1.029.475	0,07 %
				Primerica, Inc.	10.126	1.028.295	0,07 %
				LPL Financial Holdings, Inc.	17.993	1.028.120	0,07 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Park Hotels & Resorts, Inc. REIT	35.706	1.026.548	0,07 %	CoreSite Realty Corp. REIT	7.722	879.536	0,06 %
Senior Housing Properties Trust REIT	53.535	1.025.195	0,07 %	CoreLogic, Inc.	19.004	878.175	0,06 %
Wintrust Financial Corp.	12.444	1.025.012	0,07 %	Chemed Corp.	3.605	876.087	0,06 %
WGL Holdings, Inc.	11.898	1.021.324	0,07 %	Snyder's-Lance, Inc.	17.458	874.297	0,06 %
Umpqua Holdings Corp.	48.942	1.017.994	0,07 %	PBF Energy, Inc. Klasse A	24.611	872.460	0,06 %
Texas Capital Bancshares, Inc.	11.420	1.015.238	0,07 %	Kennametal, Inc.	17.999	871.332	0,06 %
FNB Corp.	72.626	1.003.691	0,07 %	ONE Gas, Inc.	11.861	868.937	0,06 %
PRA Health Sciences, Inc.	10.995	1.001.315	0,07 %	Southwest Gas Holdings, Inc.	10.788	868.218	0,06 %
Blackbaud, Inc.	10.590	1.000.649	0,07 %	Cantel Medical Corp.	8.435	867.708	0,06 %
Ryder System, Inc.	11.854	997.751	0,07 %	Cousins Properties, Inc. REIT	93.640	866.170	0,06 %
Littelfuse, Inc.	5.035	996.024	0,07 %	First Industrial Realty Trust, Inc. REIT	27.433	863.317	0,06 %
Landstar System, Inc.	9.522	991.240	0,07 %	Associated Banc-Corp.	33.955	862.457	0,06 %
STORE Capital Corp. REIT	37.984	989.103	0,07 %	RLJ Lodging Trust REIT	39.241	862.125	0,06 %
Dun & Bradstreet Corp.	8.343	987.895	0,07 %	ALLETE, Inc.	11.574	860.643	0,06 %
Ashland Global Holdings, Inc.	13.863	987.046	0,07 %	Cabot Corp.	13.967	860.228	0,06 %
Monolithic Power Systems, Inc.	8.774	985.847	0,07 %	Louisiana-Pacific Corp.	32.673	857.993	0,06 %
Liberty Ventures	18.119	982.775	0,07 %	Healthcare Services Group, Inc.	16.195	853.800	0,06 %
CalAtlantic Group, Inc.	17.417	982.145	0,07 %	Visteon Corp.	6.810	852.203	0,06 %
BankUnited, Inc.	24.093	981.067	0,07 %	Paycom Software, Inc.	10.586	850.373	0,06 %
Bemis Co., Inc.	20.509	980.125	0,07 %	National Fuel Gas Co.	15.433	847.426	0,06 %
Radian Group, Inc.	47.543	979.861	0,07 %	Silicon Laboratories, Inc.	9.534	841.852	0,06 %
MSC Industrial Direct Co., Inc. Klasse A	10.014	967.953	0,07 %	Chemical Financial Corp.	15.710	840.014	0,06 %
Crane Co.	10.835	966.699	0,07 %	DST Systems, Inc.	13.522	839.311	0,06 %
Tableau Software, Inc. Klasse A	13.909	962.503	0,07 %	Legg Mason, Inc.	19.958	837.837	0,06 %
Terex Corp.	19.939	961.459	0,07 %	Equity Commonwealth REIT	27.449	837.469	0,06 %
Casey's General Stores, Inc.	8.578	960.221	0,07 %	Validus Holdings Ltd.	17.811	835.692	0,06 %
Entegris, Inc.	31.466	958.140	0,07 %	Deluxe Corp.	10.875	835.635	0,06 %
Williams-Sonoma, Inc.	18.511	957.019	0,07 %	NewMarket Corp.	2.097	833.327	0,06 %
Jabil, Inc.	36.170	949.463	0,07 %	Valmont Industries, Inc.	5.018	832.235	0,06 %
Woodward, Inc.	12.380	947.565	0,07 %	Sunstone Hotel Investors, Inc. REIT	50.262	830.831	0,06 %
ViaSat, Inc.	12.640	946.104	0,07 %	Cree, Inc.	22.291	827.888	0,06 %
Life Storage, Inc. REIT	10.619	945.834	0,07 %	USG Corp.	21.442	826.804	0,06 %
Beacon Roofing Supply, Inc.	14.740	939.822	0,07 %	Five Below, Inc.	12.464	826.612	0,06 %
Stifel Financial Corp.	15.685	934.199	0,06 %	Tech Data Corp.	8.414	824.320	0,06 %
Euronet Worldwide, Inc.	11.083	933.964	0,06 %	Extended Stay America, Inc.	43.246	821.674	0,06 %
Apple Hospitality, Inc. REIT	47.618	933.789	0,06 %	Bank of Hawaii Corp.	9.581	821.092	0,06 %
IBERIABANK Corp.	12.048	933.720	0,06 %	Juno Therapeutics, Inc.	17.960	820.952	0,06 %
Hancock Holding Co.	18.862	933.669	0,06 %	Popular, Inc.	23.072	818.825	0,06 %
SYNNEX Corp.	6.858	932.345	0,06 %	Navient Corp.	61.473	818.820	0,06 %
Masimo Corp.	10.990	931.952	0,06 %	Dolby Laboratories, Inc. Klasse A	13.205	818.710	0,06 %
Herbalife Ltd. - CVR & RR	13.754	931.421	0,06 %	Spire, Inc.	10.888	818.233	0,06 %
NCR Corp.	27.352	929.694	0,06 %	Cinemark Holdings, Inc.	23.486	817.783	0,06 %
InterXion Holding NV	15.748	928.030	0,06 %	Colfax Corp.	20.611	816.608	0,06 %
CNO Financial Group, Inc.	37.261	919.974	0,06 %	PolyOne Corp.	18.722	814.407	0,06 %
Assured Guaranty Ltd.	27.114	918.351	0,06 %	Home BancShares, Inc.	34.957	812.750	0,06 %
Versum Materials, Inc.	24.195	915.781	0,06 %	Medidata Solutions, Inc.	12.819	812.340	0,06 %
Grand Canyon Education, Inc.	10.210	914.101	0,06 %	Flowers Foods, Inc.	42.060	812.179	0,06 %
Weatherford International plc	218.283	910.240	0,06 %	Essent Group Ltd.	18.611	808.090	0,06 %
Interactive Brokers Group, Inc. Klasse A	15.370	910.058	0,06 %	j2 Global, Inc.	10.749	806.497	0,06 %
Portland General Electric Co.	19.926	908.227	0,06 %	Texas Roadhouse, Inc. Klasse A	15.243	803.001	0,06 %
Rayonier, Inc. REIT	28.655	906.358	0,06 %	Nu Skin Enterprises, Inc. Klasse A	11.757	802.180	0,06 %
Spirit Realty Capital, Inc. REIT	105.535	905.490	0,06 %	KLX, Inc.	11.713	799.412	0,06 %
Insulet Corp.	13.111	904.659	0,06 %	Brink's Co.	10.145	798.411	0,06 %
Healthcare Realty Trust, Inc. REIT	28.060	901.287	0,06 %	Chesapeake Energy Corp.	201.389	797.500	0,06 %
SLM Corp.	79.748	901.152	0,06 %	Realogy Holdings Corp.	30.093	797.465	0,06 %
Weingarten Realty Investors REIT	27.350	898.995	0,06 %	MB Financial, Inc.	17.910	797.353	0,06 %
Hawaiian Electric Industries, Inc.	24.847	898.219	0,06 %	Peabody Energy Corp.	20.173	794.211	0,06 %
Gramercy Property Trust REIT	33.673	897.722	0,06 %	Evercore, Inc. Klasse A	8.816	793.440	0,06 %
HEICO Corp. Klasse A	11.344	896.743	0,06 %	Investors Bancorp, Inc.	56.953	790.508	0,05 %
Taubman Centers, Inc. REIT	13.699	896.326	0,06 %	Summit Materials, Inc. Klasse A	25.080	788.515	0,05 %
Proofpoint, Inc.	10.018	889.699	0,06 %	New Jersey Resources Corp.	19.598	787.840	0,05 %
Madison Square Garden Co. Klasse A	4.216	888.944	0,06 %	Sarepta Therapeutics, Inc.	14.156	787.640	0,05 %
Integrated Device Technology, Inc.	29.765	884.913	0,06 %	United Bankshares, Inc.	22.546	783.474	0,05 %
Bruker Corp.	25.776	884.632	0,06 %	ICU Medical, Inc.	3.613	780.408	0,05 %
Hain Celestial Group, Inc.	20.804	881.882	0,06 %	John Bean Technologies Corp.	7.023	778.148	0,05 %
				TCF Financial Corp.	37.754	773.957	0,05 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Dycom Industries, Inc.	6.930	772.210	0,05 %	Welbilt, Inc.	29.902	702.996	0,05 %
Timken Co.	15.703	771.802	0,05 %	Tupperware Brands Corp.	11.208	702.742	0,05 %
Univar, Inc.	24.919	771.492	0,05 %	Sprouts Farmers Market, Inc.	28.839	702.230	0,05 %
Zendesk, Inc.	22.753	769.962	0,05 %	Domtar Corp.	14.173	701.847	0,05 %
Manhattan Associates, Inc.	15.483	767.028	0,05 %	Neogen Corp.	8.535	701.662	0,05 %
Owens-Illinois, Inc.	34.454	763.845	0,05 %	UMB Financial Corp.	9.756	701.652	0,05 %
Tribune Media Co. Klasse A	17.977	763.483	0,05 %	Wolverine World Wide, Inc.	21.940	699.447	0,05 %
Performance Food Group Co.	23.061	763.319	0,05 %	Bed Bath & Beyond, Inc.	31.807	699.436	0,05 %
Nexstar Media Group, Inc. Klasse A	9.747	762.215	0,05 %	Allegheny Technologies, Inc.	28.900	697.646	0,05 %
South State Corp.	8.718	759.774	0,05 %	Ellie Mae, Inc.	7.795	696.873	0,05 %
Selective Insurance Group, Inc.	12.913	757.993	0,05 %	Matador Resources Co.	22.317	694.728	0,05 %
Avista Corp.	14.678	755.770	0,05 %	Zynga, Inc. Klasse A	173.673	694.692	0,05 %
Cirrus Logic, Inc.	14.489	751.400	0,05 %	Portola Pharmaceuticals, Inc.	14.249	693.641	0,05 %
2U, Inc.	11.636	750.638	0,05 %	Glacier Bancorp, Inc.	17.591	692.909	0,05 %
Columbia Banking System, Inc.	17.245	749.123	0,05 %	National Health Investors, Inc. REIT	9.187	692.516	0,05 %
Regal Beloit Corp.	9.758	747.463	0,05 %	ProAssurance Corp.	12.088	690.829	0,05 %
Science Applications International Corp.	9.747	746.328	0,05 %	Cracker Barrel Old Country Store, Inc.	4.340	689.583	0,05 %
Molina Healthcare, Inc.	9.729	746.020	0,05 %	SiteOne Landscape Supply, Inc.	8.978	688.613	0,05 %
PNM Resources, Inc.	18.393	743.997	0,05 %	EnerSys	9.878	687.805	0,05 %
White Mountains Insurance Group Ltd.	873	743.167	0,05 %	Washington Federal, Inc.	20.034	686.165	0,05 %
Yelp, Inc. Klasse A	17.707	742.986	0,05 %	First Citizens BancShares, Inc. Klasse A	1.701	685.503	0,05 %
Sabra Health Care, Inc. REIT	39.576	742.842	0,05 %	Retail Properties of America, Inc. REIT Klasse A	50.986	685.252	0,05 %
LivaNova plc	9.282	741.817	0,05 %	Hilton Grand Vacations, Inc.	16.298	683.701	0,05 %
Federated Investors, Inc. Klasse B	20.475	738.738	0,05 %	RBC Bearings, Inc.	5.386	680.790	0,05 %
Belden, Inc.	9.569	738.440	0,05 %	Generac Holdings, Inc.	13.738	680.306	0,05 %
FirstCash, Inc.	10.933	737.431	0,05 %	Uniti Group, Inc. REIT	38.219	679.916	0,05 %
Outfront Media, Inc. REIT	31.588	732.842	0,05 %	Liberty Global plc LiLAC Klasse C	34.180	679.840	0,05 %
CACI International, Inc. Klasse A	5.513	729.646	0,05 %	Wayfair, Inc. Klasse A	8.464	679.405	0,05 %
Paramount Group, Inc. REIT	45.929	727.975	0,05 %	Cable One, Inc.	965	678.733	0,05 %
LCI Industries	5.597	727.610	0,05 %	EastGroup Properties, Inc. REIT	7.670	677.875	0,05 %
Cathay General Bancorp	17.223	726.294	0,05 %	Haemonetics Corp.	11.670	677.794	0,05 %
Barnes Group, Inc.	11.469	725.644	0,05 %	Integra LifeSciences Holdings Corp.	14.148	677.123	0,05 %
JBG SMITH Properties REIT	20.867	724.711	0,05 %	Conduent, Inc.	41.814	675.714	0,05 %
Chimera Investment Corp. REIT	39.102	722.605	0,05 %	ACADIA Pharmaceuticals, Inc.	22.440	675.668	0,05 %
Avis Budget Group, Inc.	16.443	721.519	0,05 %	TEGNA, Inc.	47.974	675.474	0,05 %
Wendy's Co.	43.875	720.428	0,05 %	Stamps.com, Inc.	3.578	672.664	0,05 %
ILG, Inc.	25.245	718.978	0,05 %	John Wiley & Sons, Inc. Klasse A	10.194	670.256	0,05 %
Churchill Downs, Inc.	3.088	718.578	0,05 %	Valley National Bancorp	59.697	669.800	0,05 %
Signet Jewelers Ltd.	12.667	716.319	0,05 %	Akorn, Inc.	20.781	669.772	0,05 %
Blue Buffalo Pet Products, Inc.	21.837	716.035	0,05 %	Lions Gate Entertainment Corp. Klasse B	21.068	668.698	0,05 %
Blackstone Mortgage Trust, Inc. REIT Klasse A	22.237	715.587	0,05 %	NuVasive, Inc.	11.413	667.546	0,05 %
WESCO International, Inc.	10.498	715.439	0,05 %	Lumentum Holdings, Inc.	13.634	666.703	0,05 %
On Assignment, Inc.	11.128	715.197	0,05 %	Energizer Holdings, Inc.	13.840	664.043	0,05 %
Sensient Technologies Corp.	9.773	714.895	0,05 %	Ingevity Corp.	9.416	663.546	0,05 %
Brandywine Realty Trust REIT	39.287	714.631	0,05 %	Clean Harbors, Inc.	12.214	661.999	0,05 %
Physicians Realty Trust REIT	39.717	714.509	0,05 %	Globus Medical, Inc. Klasse A	16.075	660.682	0,05 %
Clovis Oncology, Inc.	10.505	714.340	0,05 %	Sinclair Broadcast Group, Inc. Klasse A	17.432	659.801	0,05 %
BGC Partners, Inc. Klasse A	47.231	713.660	0,05 %	Southwestern Energy Co.	118.238	659.768	0,05 %
MasTec, Inc.	14.558	712.614	0,05 %	Puma Biotechnology, Inc.	6.674	659.725	0,05 %
Black Hills Corp.	11.849	712.243	0,05 %	PDC Energy, Inc.	12.773	658.320	0,05 %
MFA Financial, Inc. REIT	89.926	712.214	0,05 %	HubSpot, Inc.	7.447	658.315	0,05 %
Edgewell Personal Care Co.	11.992	712.205	0,05 %	Darling Ingredients, Inc.	36.275	657.666	0,05 %
Trinseo SA	9.791	710.827	0,05 %	Rogers Corp.	4.058	657.071	0,05 %
American Eagle Outfitters, Inc.	37.795	710.546	0,05 %	Ciena Corp.	31.305	655.214	0,05 %
LaSalle Hotel Properties REIT	25.309	710.424	0,05 %	Planet Fitness, Inc. Klasse A	18.873	653.572	0,05 %
Ryman Hospitality Properties, Inc. REIT	10.290	710.216	0,05 %	NorthWestern Corp.	10.947	653.536	0,05 %
Trex Co., Inc.	6.536	708.437	0,05 %	Boyd Gaming Corp.	18.579	651.194	0,05 %
Tenneco, Inc.	12.089	707.690	0,05 %	Corporate Office Properties Trust REIT	22.299	651.131	0,05 %
Patterson Cos, Inc.	19.586	707.642	0,05 %	Ligand Pharmaceuticals, Inc.	4.744	649.596	0,05 %
Fulton Financial Corp.	39.483	706.746	0,05 %	Urban Edge Properties REIT	25.434	648.313	0,04 %
Erie Indemnity Co. Klasse A	5.787	705.088	0,05 %	EchoStar Corp. Klasse A	10.811	647.579	0,04 %
FibroGen, Inc.	14.870	704.838	0,05 %				
Marriott Vacations Worldwide Corp.	5.202	703.362	0,05 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
TreeHouse Foods, Inc.	13.069	646.393	0,04 %	Aaron's, Inc.	14.508	578.144	0,04 %
Avexis, Inc.	5.838	646.091	0,04 %	South Jersey Industries, Inc.	18.511	578.099	0,04 %
Tempur Sealy International, Inc.	10.304	645.958	0,04 %	STAG Industrial, Inc. REIT	21.138	577.702	0,04 %
Kemper Corp.	9.359	644.835	0,04 %	Regal Entertainment Group Klasse A	25.101	577.574	0,04 %
Sanderson Farms, Inc.	4.644	644.494	0,04 %	Big Lots, Inc.	10.264	576.324	0,04 %
Jack in the Box, Inc.	6.566	644.190	0,04 %	RealPage, Inc.	13.007	576.210	0,04 %
GEO Group, Inc. REIT	27.290	644.044	0,04 %	UniFirst Corp.	3.476	573.192	0,04 %
Blueprint Medicines Corp.	8.538	643.851	0,04 %	Proto Labs, Inc.	5.538	570.414	0,04 %
AMC Networks, Inc. Klasse A	11.887	642.849	0,04 %	Balchem Corp.	7.068	569.681	0,04 %
Piedmont Office Realty Trust, Inc. REIT Klasse A	32.767	642.561	0,04 %	PS Business Parks, Inc. REIT	4.554	569.660	0,04 %
Two Harbors Investment Corp. REIT	39.286	638.790	0,04 %	WageWorks, Inc.	9.186	569.532	0,04 %
DDR Corp. REIT	71.218	638.113	0,04 %	Commercial Metals Co.	26.621	567.560	0,04 %
Telephone & Data Systems, Inc.	22.718	631.560	0,04 %	Adtalem Global Education, Inc.	13.481	566.876	0,04 %
RingCentral, Inc. Klasse A	13.044	631.330	0,04 %	Allscripts Healthcare Solutions, Inc.	38.835	565.049	0,04 %
US Silica Holdings, Inc.	19.348	629.971	0,04 %	NetScout Systems, Inc.	18.534	564.360	0,04 %
Choice Hotels International, Inc.	8.083	627.241	0,04 %	Pebblebrook Hotel Trust REIT	15.163	563.609	0,04 %
Texas Pacific Land Trust	1.404	627.069	0,04 %	Education Realty Trust, Inc. REIT	16.120	562.910	0,04 %
Michaels Cos, Inc.	25.871	625.819	0,04 %	Steven Madden Ltd.	12.044	562.455	0,04 %
Vishay Intertechnology, Inc.	30.098	624.534	0,04 %	Granite Construction, Inc.	8.861	562.053	0,04 %
Cimpress NV	5.205	623.975	0,04 %	Lancaster Colony Corp.	4.323	558.575	0,04 %
Hillenbrand, Inc.	13.944	623.297	0,04 %	Sanmina Corp.	16.921	558.393	0,04 %
Columbia Property Trust, Inc. REIT	27.146	623.001	0,04 %	Kennedy-Wilson Holdings, Inc.	32.166	558.080	0,04 %
JELD-WEN Holding, Inc.	15.793	621.770	0,04 %	United Natural Foods, Inc.	11.321	557.786	0,04 %
Scientific Games Corp. Klasse A	12.059	618.627	0,04 %	Delek US Holdings, Inc.	15.893	555.301	0,04 %
TopBuild Corp.	8.145	616.902	0,04 %	Mercury Systems, Inc.	10.789	554.015	0,04 %
TRI Pointe Group, Inc.	34.394	616.340	0,04 %	Herman Miller, Inc.	13.799	552.650	0,04 %
RH	7.149	616.315	0,04 %	First Midwest Bancorp, Inc.	23.016	552.614	0,04 %
Empire State Realty Trust, Inc. REIT Klasse A	29.879	613.416	0,04 %	Carpenter Technology Corp.	10.831	552.273	0,04 %
Verint Systems, Inc.	14.621	611.889	0,04 %	Minerals Technologies, Inc.	8.019	552.108	0,04 %
Lithia Motors, Inc. Klasse A	5.385	611.682	0,04 %	Green Dot Corp. Klasse A	9.125	549.872	0,04 %
Penn National Gaming, Inc.	19.522	611.624	0,04 %	Aspen Insurance Holdings Ltd.	13.495	547.897	0,04 %
KBR, Inc.	30.653	607.849	0,04 %	INC Research Holdings, Inc. Klasse A	12.515	545.654	0,04 %
HB Fuller Co.	11.281	607.707	0,04 %	Sally Beauty Holdings, Inc.	29.016	544.340	0,04 %
Moog, Inc. Klasse A	6.976	605.866	0,04 %	Builders FirstSource, Inc.	24.954	543.748	0,04 %
Advanced Energy Industries, Inc.	8.938	603.136	0,04 %	Liberty Expedia Holdings, Inc. Klasse A	12.261	543.530	0,04 %
Penumbra, Inc.	6.402	602.428	0,04 %	Acadia Healthcare Co., Inc.	16.647	543.192	0,04 %
Urban Outfitters, Inc.	17.166	601.840	0,04 %	Dick's Sporting Goods, Inc.	18.803	540.398	0,04 %
Centennial Resource Development, Inc. Klasse A	30.360	601.128	0,04 %	Horizon Pharma plc	36.973	539.806	0,04 %
LendingTree, Inc.	1.764	600.554	0,04 %	First Financial Bankshares, Inc.	11.950	538.347	0,04 %
InterDigital, Inc.	7.879	599.986	0,04 %	Itron, Inc.	7.864	536.325	0,04 %
Murphy USA, Inc.	7.462	599.646	0,04 %	Callon Petroleum Co.	44.075	535.511	0,04 %
Tanger Factory Outlet Centers, Inc. REIT	22.516	596.899	0,04 %	KB Home	16.723	534.300	0,04 %
Community Bank System, Inc.	11.102	596.732	0,04 %	HEICO Corp.	5.658	533.832	0,04 %
Tetra Tech, Inc.	12.389	596.530	0,04 %	Array BioPharma, Inc.	41.679	533.491	0,04 %
II-VI, Inc.	12.685	595.561	0,04 %	Myriad Genetics, Inc.	15.524	533.172	0,04 %
BancorpSouth Bank	18.823	591.983	0,04 %	Nabors Industries Ltd.	77.962	532.480	0,04 %
Helen of Troy Ltd.	6.139	591.493	0,04 %	CVB Financial Corp.	22.500	530.100	0,04 %
Rexnord Corp.	22.717	591.096	0,04 %	Washington REIT	17.030	529.974	0,04 %
Enscoplc Klasse A	99.949	590.699	0,04 %	Whiting Petroleum Corp.	19.990	529.335	0,04 %
QTS Realty Trust, Inc. REIT Klasse A	10.896	590.127	0,04 %	GATX Corp.	8.514	529.230	0,04 %
Deckers Outdoor Corp.	7.345	589.436	0,04 %	Agios Pharmaceuticals, Inc.	9.217	526.936	0,04 %
Gardner Denver Holdings, Inc.	17.370	589.364	0,04 %	FireEye, Inc.	37.096	526.763	0,04 %
American Equity Investment Life Holding Co.	19.159	588.756	0,04 %	AMN Healthcare Services, Inc.	10.691	526.532	0,04 %
Halozyme Therapeutics, Inc.	29.052	588.594	0,04 %	Universal Forest Products, Inc.	13.982	526.003	0,04 %
Graham Holdings Co. Klasse B	1.050	586.267	0,04 %	Compass Minerals International, Inc.	7.265	524.896	0,04 %
CoreCivic, Inc. REIT	26.049	586.102	0,04 %	QEP Resources, Inc.	54.838	524.800	0,04 %
ACI Worldwide, Inc.	25.852	586.065	0,04 %	Acadia Realty Trust REIT	19.168	524.436	0,04 %
Ollie's Bargain Outlet Holdings, Inc.	10.999	585.697	0,04 %	HealthEquity, Inc.	11.234	524.178	0,04 %
Meredith Corp.	8.861	585.269	0,04 %	Cabot Microelectronics Corp.	5.561	523.179	0,04 %
MSA Safety, Inc.	7.543	584.733	0,04 %	New York Times Co. Klasse A	28.236	522.366	0,04 %
CNX Resources Corp.	39.913	583.927	0,04 %	Xenia Hotels & Resorts, Inc. REIT	24.175	521.938	0,04 %
Children's Place, Inc.	3.997	580.964	0,04 %	Armstrong World Industries, Inc.	8.607	521.154	0,04 %
Applied Industrial Technologies, Inc.	8.529	580.825	0,04 %	Buffalo Wild Wings, Inc.	3.328	520.333	0,04 %
				Wright Medical Group NV	23.419	519.902	0,04 %
				GCP Applied Technologies, Inc.	16.256	518.566	0,04 %
				NextEra Energy Partners LP	12.010	517.751	0,04 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Red Rock Resorts, Inc. Klasse A	15.329	517.200	0,04 %	SPX FLOW, Inc.	9.671	459.856	0,03 %
Convergys Corp.	21.900	514.650	0,04 %	Invesco Mortgage Capital, Inc. REIT	25.759	459.283	0,03 %
Old National Bancorp	29.484	514.496	0,04 %	Renasant Corp.	11.198	457.886	0,03 %
Prestige Brands Holdings, Inc.	11.557	513.246	0,04 %	Potlatch Corp. REIT	9.129	455.537	0,03 %
J&J Snack Foods Corp.	3.374	512.274	0,04 %	Vonage Holdings Corp.	44.783	455.443	0,03 %
CommVault Systems, Inc.	9.731	510.877	0,04 %	Covanta Holding Corp.	26.941	455.303	0,03 %
Finisar Corp.	25.086	510.500	0,04 %	Watts Water Technologies, Inc. Klasse A	5.985	454.561	0,03 %
B&G Foods, Inc.	14.499	509.640	0,04 %	Lexington Realty Trust REIT	47.084	454.361	0,03 %
Vector Group Ltd.	22.745	509.033	0,04 %	Ambarella, Inc.	7.723	453.726	0,03 %
Platform Specialty Products Corp.	51.261	508.509	0,04 %	Esterline Technologies Corp.	6.072	453.578	0,03 %
International Bancshares Corp.	12.803	508.279	0,04 %	Columbia Sportswear Co.	6.308	453.419	0,03 %
Hope Bancorp, Inc.	27.842	508.116	0,04 %	Supernus Pharmaceuticals, Inc.	11.378	453.413	0,03 %
Masonite International Corp.	6.851	508.002	0,04 %	Cogent Communications Holdings, Inc.	10.003	453.136	0,03 %
Great Western Bancorp, Inc.	12.758	507.768	0,04 %	Lions Gate Entertainment Corp. Klasse A	13.402	453.122	0,03 %
Magellan Health, Inc.	5.256	507.467	0,04 %	Cars.com, Inc.	15.710	453.076	0,03 %
Simpson Manufacturing Co., Inc.	8.826	506.701	0,04 %	Aerojet Rocketdyne Holdings, Inc.	14.504	452.525	0,03 %
Credit Acceptance Corp.	1.565	506.246	0,04 %	KapStone Paper & Packaging Corp.	19.940	452.439	0,03 %
Silgan Holdings, Inc.	17.204	505.626	0,04 %	FCB Financial Holdings, Inc. Klasse A	8.884	451.307	0,03 %
Anixter International, Inc.	6.651	505.476	0,04 %	VeriFone Systems, Inc.	25.428	450.330	0,03 %
Insmid, Inc.	16.156	503.744	0,03 %	Medicines Co.	16.460	450.016	0,03 %
First Merchants Corp.	11.954	502.785	0,03 %	Brinker International, Inc.	11.576	449.612	0,03 %
RLI Corp.	8.283	502.447	0,03 %	United Community Banks, Inc.	15.944	448.664	0,03 %
Nutanix, Inc. Klasse A	14.232	502.105	0,03 %	Oceaneering International, Inc.	21.223	448.654	0,03 %
Oasis Petroleum, Inc.	59.674	501.858	0,03 %	Ubiquiti Networks, Inc.	6.313	448.349	0,03 %
Arch Coal, Inc. Klasse A	5.375	500.735	0,03 %	Rowan Cos plc Klasse A	28.611	448.048	0,03 %
Acxiom Corp.	18.138	499.883	0,03 %	Dorman Products, Inc.	7.325	447.850	0,03 %
DiamondRock Hospitality Co. REIT	44.270	499.808	0,03 %	MGM Growth Properties LLC REIT Klasse A	15.327	446.782	0,03 %
SM Energy Co.	22.605	499.118	0,03 %	Mueller Industries, Inc.	12.610	446.772	0,03 %
Envestnet, Inc.	10.002	498.600	0,03 %	Cooper Tire & Rubber Co.	12.616	445.976	0,03 %
Merit Medical Systems, Inc.	11.508	497.146	0,03 %	ExlService Holdings, Inc.	7.386	445.745	0,03 %
El Paso Electric Co.	8.972	496.600	0,03 %	Ironwood Pharmaceuticals, Inc. Klasse A	29.589	443.539	0,03 %
Dave & Buster's Entertainment, Inc.	9.001	496.585	0,03 %	Viavi Solutions, Inc.	50.615	442.375	0,03 %
Gulfport Energy Corp.	38.808	495.190	0,03 %	Wix.com Ltd.	7.681	442.042	0,03 %
Triton International Ltd.	13.175	493.404	0,03 %	Hilltop Holdings, Inc.	17.426	441.401	0,03 %
Semtech Corp.	14.396	492.343	0,03 %	Kaiser Aluminum Corp.	4.116	439.795	0,03 %
Mallinckrodt plc	21.777	491.289	0,03 %	Progress Software Corp.	10.325	439.535	0,03 %
Korn/Ferry International	11.860	490.767	0,03 %	Plexus Corp.	7.237	439.431	0,03 %
Halyard Health, Inc.	10.604	489.693	0,03 %	LifePoint Health, Inc.	8.792	437.842	0,03 %
MGE Energy, Inc.	7.732	487.889	0,03 %	SemGroup Corp. Klasse A	14.467	436.903	0,03 %
Retail Opportunity Investments Corp. REIT	24.419	487.159	0,03 %	Taylor Morrison Home Corp. Klasse A	17.839	436.520	0,03 %
American States Water Co.	8.395	486.154	0,03 %	Apollo Commercial Real Estate Finance, Inc. REIT	23.632	436.010	0,03 %
Mueller Water Products, Inc. Klasse A	38.766	485.738	0,03 %	LegacyTexas Financial Group, Inc.	10.327	435.903	0,03 %
Worthington Industries, Inc.	11.008	485.012	0,03 %	Quaker Chemical Corp.	2.889	435.632	0,03 %
Power Integrations, Inc.	6.588	484.547	0,03 %	Ferro Corp.	18.457	435.401	0,03 %
Cooper-Standard Holdings, Inc.	3.947	483.507	0,03 %	SRC Energy, Inc.	51.000	435.030	0,03 %
Box, Inc. Klasse A	22.874	483.099	0,03 %	TiVo Corp.	27.846	434.398	0,03 %
EnPro Industries, Inc.	5.166	483.073	0,03 %	American Woodmark Corp.	3.335	434.384	0,03 %
Insperty, Inc.	8.350	478.873	0,03 %	Callidus Software, Inc.	15.148	433.990	0,03 %
Bloomin' Brands, Inc.	22.361	477.184	0,03 %	Artisan Partners Asset Management, Inc. Klasse A	10.978	433.631	0,03 %
Groupon, Inc. Klasse A	93.351	476.090	0,03 %	Independent Bank Corp.	6.207	433.559	0,03 %
California Water Service Group	10.413	472.230	0,03 %	Brookdale Senior Living, Inc.	44.675	433.347	0,03 %
Cheesecake Factory, Inc.	9.800	472.164	0,03 %	Ultragenyx Pharmaceutical, Inc.	9.342	433.282	0,03 %
Enstar Group Ltd.	2.349	471.562	0,03 %	Financial Engines, Inc.	14.295	433.138	0,03 %
ABM Industries, Inc.	12.481	470.783	0,03 %	Penske Automotive Group, Inc.	9.048	432.947	0,03 %
C&J Energy Services, Inc.	14.028	469.517	0,03 %	Meritor, Inc.	18.451	432.860	0,03 %
Rexford Industrial Realty, Inc. REIT	16.091	469.214	0,03 %	Argo Group International Holdings Ltd.	7.017	432.598	0,03 %
iRobot Corp.	6.117	469.174	0,03 %	Navistar International Corp.	10.036	430.344	0,03 %
HRG Group, Inc.	27.663	468.888	0,03 %	PriceSmart, Inc.	4.989	429.553	0,03 %
Cleveland-Cliffs, Inc.	65.018	468.780	0,03 %	Blackhawk Network Holdings, Inc. Klasse A	12.044	429.369	0,03 %
Trustmark Corp.	14.660	467.068	0,03 %				
Amicus Therapeutics, Inc.	32.434	466.725	0,03 %				
Rite Aid Corp.	236.793	466.482	0,03 %				
Inogen, Inc.	3.902	464.650	0,03 %				
Simmons First National Corp. Klasse A	8.126	463.995	0,03 %				
Pitney Bowes, Inc.	41.368	462.494	0,03 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
OneMain Holdings, Inc. Klasse A	16.484	428.419	0,03 %	Plantronics, Inc.	7.562	380.974	0,03 %
New Relic, Inc.	7.415	428.365	0,03 %	FTI Consulting, Inc.	8.844	379.938	0,03 %
Office Depot, Inc.	120.876	427.901	0,03 %	Winnebago Industries, Inc.	6.832	379.859	0,03 %
Select Medical Holdings Corp.	24.242	427.871	0,03 %	BroadSoft, Inc.	6.913	379.524	0,03 %
Qualys, Inc.	7.183	426.311	0,03 %	Northwest Bancshares, Inc.	22.592	377.964	0,03 %
GameStop Corp. Klasse A	23.558	422.866	0,03 %	Northwest Natural Gas Co.	6.330	377.585	0,03 %
Meritage Homes Corp.	8.252	422.502	0,03 %	Chesapeake Lodging Trust REIT	13.904	376.659	0,03 %
World Fuel Services Corp.	14.960	420.974	0,03 %	Comfort Systems USA, Inc.	8.606	375.652	0,03 %
Eagle Bancorp, Inc.	7.261	420.412	0,03 %	Travelport Worldwide Ltd.	28.686	374.926	0,03 %
Terreno Realty Corp. REIT	11.973	419.773	0,03 %	Pattern Energy Group, Inc. Klasse A	17.411	374.162	0,03 %
Pegasystems, Inc.	8.902	419.729	0,03 %	Rambus, Inc.	26.297	373.943	0,03 %
TriNet Group, Inc.	9.455	419.235	0,03 %	Forward Air Corp.	6.504	373.590	0,03 %
NETGEAR, Inc.	7.129	418.829	0,03 %	Chicago Bridge & Iron Co. NV	23.053	372.075	0,03 %
BOK Financial Corp.	4.527	417.933	0,03 %	First Financial Bancorp	14.108	371.746	0,03 %
Morningstar, Inc.	4.309	417.844	0,03 %	Summit Hotel Properties, Inc. REIT	24.387	371.414	0,03 %
Teladoc, Inc.	11.988	417.782	0,03 %	HNI Corp.	9.626	371.275	0,03 %
ServisFirst Bancshares, Inc.	10.027	416.121	0,03 %	G-III Apparel Group Ltd.	10.062	371.187	0,03 %
Exponent, Inc.	5.826	414.229	0,03 %	Westamerica Bancorporation	6.230	370.997	0,03 %
Mack-Cali Realty Corp. REIT	19.168	413.262	0,03 %	Installed Building Products, Inc.	4.884	370.940	0,03 %
Sotheby's	8.005	413.058	0,03 %	First Hawaiian, Inc.	12.699	370.557	0,03 %
Capitol Federal Financial, Inc.	30.796	412.974	0,03 %	NxStage Medical, Inc.	15.260	369.750	0,03 %
Pinnacle Entertainment, Inc.	12.611	412.758	0,03 %	Oil States International, Inc.	13.048	369.258	0,03 %
Omniceil, Inc.	8.509	412.687	0,03 %	Etsy, Inc.	18.030	368.713	0,03 %
Time, Inc.	22.356	412.468	0,03 %	American Axle & Manufacturing Holdings, Inc.	21.640	368.529	0,03 %
Pacira Pharmaceuticals, Inc.	8.994	410.576	0,03 %	Acceleron Pharma, Inc.	8.657	367.403	0,03 %
Laredo Petroleum, Inc.	38.671	410.299	0,03 %	Ebix, Inc.	4.632	367.086	0,03 %
Waddell & Reed Financial, Inc. Klasse A	18.361	410.185	0,03 %	Premier, Inc. Klasse A	12.562	366.685	0,03 %
MaxLinear, Inc. Klasse A	15.525	410.171	0,03 %	Kite Realty Group Trust REIT	18.664	365.814	0,03 %
Towne Bank	13.273	408.145	0,03 %	Nutrisystem, Inc.	6.949	365.517	0,03 %
McDermott International, Inc.	61.877	407.151	0,03 %	Patrick Industries, Inc.	5.260	365.307	0,03 %
Tronox Ltd. Klasse A	19.770	405.483	0,03 %	Provident Financial Services, Inc.	13.531	364.931	0,03 %
Loxo Oncology, Inc.	4.795	403.643	0,03 %	Rush Enterprises, Inc. Klasse A	7.167	364.155	0,03 %
Ormat Technologies, Inc. (XNYS)	6.303	403.140	0,03 %	Four Corners Property Trust, Inc. REIT	14.136	363.295	0,03 %
Albany International Corp. Klasse A	6.560	403.112	0,03 %	Moelis & Co. Klasse A	7.490	363.265	0,03 %
Werner Enterprises, Inc.	10.386	401.419	0,03 %	AAON, Inc.	9.894	363.110	0,03 %
Aerie Pharmaceuticals, Inc.	6.706	400.683	0,03 %	WD-40 Co.	3.073	362.614	0,03 %
Dril-Quip, Inc.	8.397	400.537	0,03 %	OPKO Health, Inc.	73.922	362.218	0,03 %
Monro, Inc.	7.032	400.472	0,03 %	Novanta, Inc.	7.221	361.050	0,03 %
Banner Corp.	7.255	399.896	0,03 %	Shutterfly, Inc.	7.247	360.538	0,02 %
Cornerstone OnDemand, Inc.	11.315	399.759	0,03 %	Stepan Co.	4.557	359.866	0,02 %
Saia, Inc.	5.634	398.606	0,03 %	Eldorado Resorts, Inc.	10.837	359.247	0,02 %
Franklin Electric Co., Inc.	8.670	397.953	0,03 %	Papa John's International, Inc.	6.388	358.431	0,02 %
WesBanco, Inc.	9.738	395.850	0,03 %	Interface, Inc. Klasse A	14.249	358.362	0,02 %
Mathews International Corp. Klasse A	7.495	395.736	0,03 %	Spectrum Pharmaceuticals, Inc.	18.886	357.890	0,02 %
HFF, Inc. Klasse A	8.134	395.638	0,03 %	Pacific Premier Bancorp, Inc.	8.946	357.840	0,02 %
Emergent BioSolutions, Inc.	8.513	395.599	0,03 %	Kaman Corp.	6.051	356.041	0,02 %
Brady Corp. Klasse A	10.414	394.691	0,03 %	Floor & Decor Holdings, Inc. Klasse A	7.312	355.948	0,02 %
Ultra Petroleum Corp.	43.507	394.173	0,03 %	Mobile Mini, Inc.	10.298	355.281	0,02 %
CenterState Bank Corp.	15.230	391.868	0,03 %	Fresh Del Monte Produce, Inc.	7.429	354.140	0,02 %
Boston Beer Co., Inc. Klasse A	2.043	390.417	0,03 %	PRA Group, Inc.	10.637	353.148	0,02 %
Bofl Holding, Inc.	13.040	389.896	0,03 %	Hub Group, Inc. Klasse A	7.339	351.538	0,02 %
Horace Mann Educators Corp.	8.837	389.712	0,03 %	Spark Therapeutics, Inc.	6.835	351.456	0,02 %
Ameris Bancorp	8.084	389.649	0,03 %	Otter Tail Corp.	7.896	350.977	0,02 %
Nevro Corp.	5.632	388.833	0,03 %	Union Bankshares Corp.	9.696	350.704	0,02 %
NBT Bancorp, Inc.	10.563	388.718	0,03 %	Greif, Inc. Klasse A	5.776	349.910	0,02 %
Carrizo Oil & Gas, Inc.	18.240	388.147	0,03 %	ESCO Technologies, Inc.	5.804	349.691	0,02 %
Government Properties Income Trust REIT	20.927	387.987	0,03 %	RPC, Inc.	13.694	349.608	0,02 %
Select Income REIT	15.404	387.103	0,03 %	Superior Energy Services ,Inc.	36.223	348.827	0,02 %
Global Blood Therapeutics, Inc.	9.832	386.889	0,03 %	Boise Cascade Co.	8.733	348.447	0,02 %
Brooks Automation, Inc.	16.142	384.987	0,03 %	Amedisys, Inc.	6.607	348.255	0,02 %
AK Steel Holding Corp.	67.971	384.716	0,03 %	Bob Evans Farms, Inc.	4.414	347.911	0,02 %
Kulicke & Soffa Industries, Inc.	15.807	384.663	0,03 %	Kosmos Energy Ltd.	50.599	346.603	0,02 %
Innospec, Inc.	5.432	383.499	0,03 %	Hecla Mining Co.	87.155	346.005	0,02 %
Caesars Entertainment Corp.	30.226	382.359	0,03 %	Shenandoah Telecommunications Co.	10.233	345.875	0,02 %
LTC Properties, Inc. REIT	8.777	382.238	0,03 %	Extraction Oil & Gas, Inc.	24.092	344.757	0,02 %
American National Insurance Co.	2.975	381.544	0,03 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Sleep Number Corp.	9.123	342.934	0,02 %	MiMedx Group, Inc.	24.342	306.953	0,02 %
Sun Hydraulics Corp.	5.298	342.728	0,02 %	Cal-Maine Foods, Inc.	6.895	306.483	0,02 %
Varex Imaging Corp.	8.523	342.369	0,02 %	Chart Industries, Inc.	6.530	305.996	0,02 %
Kraton Corp.	7.102	342.103	0,02 %	Milacron Holdings Corp.	15.954	305.360	0,02 %
Cambrex Corp.	7.093	340.464	0,02 %	MDC Holdings, Inc.	9.565	304.932	0,02 %
Benchmark Electronics, Inc.	11.673	339.684	0,02 %	Electronics For Imaging, Inc.	10.324	304.868	0,02 %
American Assets Trust, Inc. REIT	8.826	337.506	0,02 %	Methode Electronics, Inc.	7.594	304.519	0,02 %
Genworth Financial, Inc. Klasse A	108.466	337.329	0,02 %	S&T Bancorp, Inc.	7.626	303.591	0,02 %
Endo International plc	43.461	336.823	0,02 %	Berkshire Hills Bancorp, Inc.	8.283	303.158	0,02 %
MRC Global, Inc.	19.893	336.590	0,02 %	TTM Technologies, Inc.	19.325	302.823	0,02 %
Cubic Corp.	5.709	336.546	0,02 %	Callaway Golf Co.	21.697	302.239	0,02 %
Tenet Healthcare Corp.	22.183	336.294	0,02 %	Alexander & Baldwin, Inc. REIT	10.892	302.144	0,02 %
Park National Corp.	3.228	335.712	0,02 %	MACOM Technology Solutions Holdings, Inc.	9.285	302.134	0,02 %
Dynegey, Inc.	28.189	334.040	0,02 %	Standex International Corp.	2.962	301.680	0,02 %
Knowles Corp.	22.760	333.662	0,02 %	Global Net Lease, Inc. REIT	14.619	300.859	0,02 %
Caleres, Inc.	9.950	333.126	0,02 %	Inphi Corp.	8.216	300.706	0,02 %
Immunomedics, Inc.	20.610	333.058	0,02 %	Gray Television, Inc.	17.951	300.679	0,02 %
Actuant Corp. Klasse A	13.154	332.796	0,02 %	First Commonwealth Financial Corp.	20.966	300.233	0,02 %
BMC Stock Holdings, Inc.	13.137	332.366	0,02 %	Chesapeake Utilities Corp.	3.822	300.218	0,02 %
WSFS Financial Corp.	6.930	331.601	0,02 %	Apogee Enterprises, Inc.	6.563	300.126	0,02 %
Corcept Therapeutics, Inc.	18.356	331.509	0,02 %	Universal Corp.	5.710	299.775	0,02 %
Badger Meter, Inc.	6.928	331.158	0,02 %	Schweitzer-Mauduit International, Inc.	6.603	299.512	0,02 %
Neenah Paper, Inc.	3.650	330.873	0,02 %	Natus Medical, Inc.	7.840	299.488	0,02 %
HMS Holdings Corp.	19.498	330.491	0,02 %	Entercom Communications Corp. Klasse A	27.725	299.430	0,02 %
Greenbrier Cos, Inc.	6.200	330.460	0,02 %	Quality Care Properties, Inc. REIT	21.651	299.000	0,02 %
La Quinta Holdings, Inc.	17.822	328.994	0,02 %	Sangamo Therapeutics, Inc.	18.226	298.906	0,02 %
Chegg, Inc.	20.156	328.946	0,02 %	Tennant Co.	4.106	298.301	0,02 %
DSW, Inc. Klasse A	15.342	328.472	0,02 %	National Storage Affiliates Trust REIT	10.919	297.652	0,02 %
AZZ, Inc.	6.425	328.317	0,02 %	AAR Corp.	7.572	297.504	0,02 %
Mercury General Corp.	6.141	328.175	0,02 %	Aircastle Ltd.	12.680	296.585	0,02 %
Core-Mark Holding Co., Inc.	10.348	326.790	0,02 %	Coeur Mining, Inc.	39.481	296.107	0,02 %
GTT Communications, Inc.	6.959	326.725	0,02 %	Gannett Co., Inc.	25.547	296.090	0,02 %
LendingClub Corp.	78.973	326.158	0,02 %	8x8, Inc.	20.994	296.015	0,02 %
Group 1 Automotive, Inc.	4.586	325.468	0,02 %	MSG Networks, Inc. Klasse A	14.605	295.751	0,02 %
Altra Industrial Motion Corp.	6.451	325.130	0,02 %	Trade Desk, Inc. Klasse A	6.462	295.507	0,02 %
Fox Factory Holding Corp.	8.361	324.825	0,02 %	Herc Holdings, Inc.	4.715	295.206	0,02 %
La-Z-Boy, Inc.	10.364	323.357	0,02 %	Triumph Group, Inc.	10.852	295.174	0,02 %
Twilio, Inc. Klasse A	13.696	323.226	0,02 %	Nelnet, Inc. Klasse A	5.383	294.881	0,02 %
Diamond Offshore Drilling, Inc.	17.366	322.834	0,02 %	Tivity Health, Inc.	8.067	294.849	0,02 %
Harsco Corp.	17.280	322.272	0,02 %	CyberArk Software Ltd.	7.120	294.697	0,02 %
Tallgrass Energy GP LP Klasse A	12.514	322.110	0,02 %	Sandy Spring Bancorp, Inc.	7.547	294.484	0,02 %
General Cable Corp.	10.819	320.242	0,02 %	SFX Corp.	9.379	294.407	0,02 %
IMAX Corp.	13.773	318.845	0,02 %	Bottomline Technologies de, Inc.	8.488	294.364	0,02 %
Employers Holdings, Inc.	7.150	317.460	0,02 %	Camping World Holdings, Inc. Klasse A	6.571	293.921	0,02 %
Hostess Brands, Inc. Klasse A	21.320	315.749	0,02 %	Cavco Industries, Inc.	1.925	293.755	0,02 %
SodaStream International Ltd.	4.474	314.701	0,02 %	EnLink Midstream LLC	16.690	293.744	0,02 %
Agree Realty Corp. REIT	6.113	314.453	0,02 %	ACCO Brands Corp.	24.031	293.178	0,02 %
CONMED Corp.	6.157	313.822	0,02 %	ManTech International Corp. Klasse A	5.819	292.056	0,02 %
Straight Path Communications, Inc. Klasse B	1.726	313.770	0,02 %	Weight Watchers International, Inc.	6.591	291.849	0,02 %
Heartland Financial USA, Inc.	5.841	313.370	0,02 %	H&E Equipment Services, Inc.	7.163	291.176	0,02 %
Seaboard Corp.	71	313.110	0,02 %	US Concrete, Inc.	3.480	291.102	0,02 %
WisdomTree Investments, Inc.	24.948	313.097	0,02 %	Scholastic Corp.	7.253	290.918	0,02 %
Synaptics, Inc.	7.827	312.610	0,02 %	Washington Prime Group, Inc. REIT	40.597	289.051	0,02 %
CSG Systems International, Inc.	7.116	311.823	0,02 %	Manitowoc Co., Inc.	7.302	287.261	0,02 %
Boston Private Financial Holdings, Inc.	20.173	311.673	0,02 %	Steelcase, Inc. Klasse A	18.872	286.854	0,02 %
Axon Enterprise, Inc.	11.755	311.507	0,02 %	Wabash National Corp.	13.169	285.767	0,02 %
Esperion Therapeutics, Inc.	4.728	311.292	0,02 %	Third Point Reinsurance Ltd.	19.452	284.972	0,02 %
Advanced Disposal Services, Inc.	12.965	310.382	0,02 %	AdvanSix, Inc.	6.751	284.015	0,02 %
Cotiviti Holdings, Inc.	9.624	309.989	0,02 %	Calavo Growers, Inc.	3.360	283.584	0,02 %
Walker & Dunlop, Inc.	6.521	309.748	0,02 %	Virtusa Corp.	6.418	282.905	0,02 %
LGI Homes, Inc.	4.124	309.424	0,02 %	MicroStrategy, Inc. Klasse A	2.144	281.507	0,02 %
Extreme Networks, Inc.	24.652	308.643	0,02 %	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital, Inc. REIT	11.635	279.938	0,02 %
Repligen Corp.	8.487	307.908	0,02 %	Xperi Corp.	11.457	279.551	0,02 %
Insight Enterprises, Inc.	8.031	307.507	0,02 %	Match Group, Inc.	8.927	279.504	0,02 %
Paylocity Holding Corp.	6.515	307.247	0,02 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Cannae Holdings, Inc.	16.401	279.309	0,02 %	Abaxis, Inc.	5.043	249.729	0,02 %
Arena Pharmaceuticals, Inc.	8.219	279.199	0,02 %	Primoris Services Corp.	9.121	248.000	0,02 %
Safety Insurance Group, Inc.	3.463	278.425	0,02 %	NRG Yield, Inc. Klasse C	13.108	247.741	0,02 %
Raven Industries, Inc.	8.092	277.960	0,02 %	OraSure Technologies, Inc.	13.130	247.632	0,02 %
Sykes Enterprises, Inc.	8.837	277.924	0,02 %	Seritage Growth Properties REIT	6.091	246.442	0,02 %
CareTrust, Inc. REIT	16.511	276.724	0,02 %	McGrath RentCorp	5.238	246.081	0,02 %
Pandora Media, Inc.	57.156	275.492	0,02 %	Calgon Carbon Corp.	11.550	246.015	0,02 %
GMS, Inc.	7.260	273.266	0,02 %	Franklin Street Properties Corp. REIT	22.859	245.506	0,02 %
Integer Holdings Corp.	6.026	272.978	0,02 %	Sonic Corp.	8.923	245.204	0,02 %
Monmouth Real Estate Investment Corp. REIT	15.308	272.482	0,02 %	Viad Corp.	4.424	245.090	0,02 %
Owens & Minor, Inc.	14.389	271.664	0,02 %	Koppers Holdings, Inc.	4.811	244.880	0,02 %
Pure Storage, Inc. Klasse A	17.058	270.540	0,02 %	PennyMac Mortgage Investment Trust REIT	15.205	244.344	0,02 %
First Busey Corp.	9.006	269.640	0,02 %	Five9, Inc.	9.807	243.998	0,02 %
TrueBlue, Inc.	9.793	269.308	0,02 %	Hanmi Financial Corp.	8.020	243.407	0,02 %
Quidel Corp.	6.207	269.073	0,02 %	Multi-Color Corp.	3.241	242.589	0,02 %
Zogenix, Inc.	6.695	268.135	0,02 %	OSI Systems, Inc.	3.766	242.455	0,02 %
Navigators Group, Inc.	5.495	267.607	0,02 %	Wingstop, Inc.	6.215	242.261	0,02 %
Continental Building Products, Inc.	9.488	267.087	0,02 %	Kadant, Inc.	2.406	241.562	0,02 %
CYS Investments, Inc. REIT	33.198	266.580	0,02 %	Monotype Imaging Holdings, Inc.	10.002	241.048	0,02 %
NOW, Inc.	24.106	265.889	0,02 %	Cohen & Steers, Inc.	5.096	240.990	0,02 %
Central Garden & Pet Co. Klasse A	7.039	265.441	0,02 %	Meridian Bancorp, Inc.	11.687	240.752	0,02 %
Diodes, Inc.	9.254	265.312	0,02 %	Ignity, Inc.	9.008	240.514	0,02 %
Knoll, Inc.	11.466	264.177	0,02 %	Coca-Cola Bottling Co. Consolidated	1.116	240.230	0,02 %
Gentherm Inc.	8.304	263.652	0,02 %	State Bank Financial Corp.	8.049	240.182	0,02 %
Piper Jaffray Cos	3.056	263.580	0,02 %	Amkor Technology, Inc.	23.894	240.135	0,02 %
World Wrestling Entertainment, Inc. Klasse A	8.617	263.508	0,02 %	United Fire Group, Inc.	5.248	239.204	0,02 %
National Beverage Corp.	2.700	263.088	0,02 %	TherapeuticsMD, Inc.	39.526	238.737	0,02 %
Q2 Holdings, Inc.	7.136	262.962	0,02 %	Hertz Global Holdings, Inc.	10.787	238.393	0,02 %
Aerovironment, Inc.	4.677	262.660	0,02 %	Lakeland Financial Corp.	4.900	237.601	0,02 %
ARMOUR Residential, Inc. REIT	10.205	262.473	0,02 %	ICF International, Inc.	4.521	237.353	0,02 %
Chico's FAS, Inc.	29.755	262.439	0,02 %	National General Holdings Corp.	12.081	237.271	0,02 %
Astec Industries, Inc.	4.482	262.197	0,02 %	Sturm Ruger & Co., Inc.	4.245	237.083	0,02 %
Imperva, Inc.	6.596	261.861	0,02 %	Heartland Express, Inc.	10.099	235.711	0,02 %
Brookline Bancorp, Inc.	16.622	260.965	0,02 %	Noble Corp. plc	52.041	235.225	0,02 %
First Interstate BancSystem, Inc. Klasse A	6.506	260.565	0,02 %	Southside Bancshares, Inc.	6.975	234.918	0,02 %
Venator Materials plc	11.775	260.463	0,02 %	ScanSource, Inc.	6.538	234.060	0,02 %
Houlihan Lokey, Inc. Klasse A	5.715	259.632	0,02 %	Momenta Pharmaceuticals, Inc.	16.761	233.816	0,02 %
Unit Corp.	11.777	259.094	0,02 %	Fabrinet	8.143	233.704	0,02 %
Dynavax Technologies Corp.	13.808	258.210	0,02 %	Innoviva, Inc.	16.458	233.539	0,02 %
Abercrombie & Fitch Co. Klasse A	14.810	258.138	0,02 %	NIC, Inc.	14.064	233.462	0,02 %
Oclaro, Inc.	38.217	257.583	0,02 %	Acorda Therapeutics, Inc.	10.873	233.226	0,02 %
Dean Foods Co.	22.258	257.302	0,02 %	US Physical Therapy, Inc.	3.220	232.484	0,02 %
US Ecology, Inc.	5.042	257.142	0,02 %	Overstock.com, Inc.	3.636	232.340	0,02 %
Ensign Group, Inc.	11.578	257.032	0,02 %	Independent Bank Group, Inc.	3.433	232.071	0,02 %
TriMas Corp.	9.596	256.693	0,02 %	Alamo Group, Inc.	2.054	231.835	0,02 %
Ramco-Gershenson Properties Trust REIT	17.379	255.993	0,02 %	CEVA, Inc.	5.020	231.673	0,02 %
Theravance Biopharma, Inc.	9.169	255.723	0,02 %	SolarEdge Technologies, Inc.	6.158	231.233	0,02 %
Kearny Financial Corp.	17.669	255.317	0,02 %	Tompkins Financial Corp.	2.842	231.197	0,02 %
Oxford Industries, Inc.	3.393	255.120	0,02 %	Barracuda Networks, Inc.	8.395	230.862	0,02 %
Helix Energy Solutions Group, Inc.	33.780	254.701	0,02 %	SpartanNash Co.	8.643	230.595	0,02 %
Impax Laboratories, Inc.	15.286	254.512	0,02 %	Heron Therapeutics, Inc.	12.722	230.268	0,02 %
A Schulman, Inc.	6.806	253.524	0,02 %	Guess?, Inc.	13.630	230.074	0,02 %
Infinity Property & Casualty Corp.	2.389	253.234	0,02 %	Rayonier Advanced Materials, Inc.	11.184	228.713	0,02 %
AnaptysBio, Inc.	2.513	253.109	0,02 %	Briggs & Stratton Corp.	9.004	228.431	0,02 %
Federal Signal Corp.	12.592	252.973	0,02 %	ePlus, Inc.	3.027	227.630	0,02 %
LHC Group, Inc.	4.123	252.534	0,02 %	Iridium Communications, Inc.	19.280	227.504	0,02 %
Redwood Trust, Inc. REIT	17.007	252.044	0,02 %	Tutor Perini Corp.	8.956	227.035	0,02 %
City Holding Co.	3.734	251.933	0,02 %	AmTrust Financial Services, Inc.	22.524	226.817	0,02 %
Belmond Ltd. Klasse A	20.537	251.578	0,02 %	Revanche Therapeutics, Inc.	6.318	225.869	0,02 %
FormFactor, Inc.	16.048	251.151	0,02 %	Analogic Corp.	2.696	225.790	0,02 %
Radius Health, Inc.	7.881	250.379	0,02 %	Enbridge Energy Management LLC	16.851	225.635	0,02 %
Asbury Automotive Group, Inc.	3.908	250.112	0,02 %	Universal Health Realty Income Trust REIT	2.999	225.255	0,02 %
Beneficial Bancorp, Inc.	15.189	249.859	0,02 %	Tier, Inc. REIT	11.022	224.739	0,02 %
AMERISAFE, Inc.	4.056	249.850	0,02 %	Deltic Timber Corp.	2.445	223.840	0,02 %
				JC Penney Co., Inc.	70.776	223.652	0,02 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Chatham Lodging Trust REIT	9.809	223.253	0,02 %	ArcBest Corp.	5.663	202.452	0,01 %
ProPetro Holding Corp.	11.059	222.949	0,02 %	PH Glatfelter Co.	9.441	202.415	0,01 %
Encore Capital Group, Inc.	5.276	222.120	0,02 %	Heritage Financial Corp.	6.549	201.709	0,01 %
Tailored Brands, Inc.	10.162	221.836	0,02 %	PetMed Express, Inc.	4.431	201.611	0,01 %
SJW Group	3.474	221.745	0,02 %	EW Scripps Co. Klasse A	12.876	201.252	0,01 %
Lindsay Corp.	2.511	221.470	0,02 %	Warrior Met Coal, Inc.	8.002	201.250	0,01 %
Diebold Nixdorf, Inc. (XNYS)	13.526	221.150	0,02 %	REV Group, Inc.	6.182	201.100	0,01 %
Intercept Pharmaceuticals, Inc.	3.783	221.003	0,02 %	Kinsale Capital Group, Inc.	4.454	200.430	0,01 %
M/I Homes, Inc.	6.424	220.986	0,02 %	Saul Centers, Inc. REIT	3.238	199.947	0,01 %
Blucora, Inc.	9.974	220.425	0,02 %	Web.com Group, Inc.	9.160	199.688	0,01 %
New Media Investment Group, Inc.	13.122	220.187	0,02 %	Inovalon Holdings, Inc. Klasse A	13.299	199.485	0,01 %
Foundation Medicine, Inc.	3.227	220.081	0,02 %	Mitel Networks Corp.	24.164	198.870	0,01 %
Enterprise Financial Services Corp.	4.848	218.887	0,02 %	MGP Ingredients, Inc.	2.585	198.735	0,01 %
Houghton Mifflin Harcourt Co.	23.475	218.317	0,02 %	ADTRAN, Inc.	10.265	198.628	0,01 %
MTS Systems Corp.	4.061	218.076	0,02 %	Meta Financial Group, Inc.	2.143	198.549	0,01 %
Standard Motor Products, Inc.	4.835	217.140	0,02 %	Accelerate Diagnostics, Inc.	7.562	198.124	0,01 %
James River Group Holdings Ltd.	5.417	216.734	0,01 %	TrustCo Bank Corp. NY	21.516	197.947	0,01 %
Navigant Consulting, Inc.	11.163	216.674	0,01 %	First Bancorp/NC	5.601	197.771	0,01 %
International Speedway Corp. Klasse A	5.433	216.505	0,01 %	Innophos Holdings, Inc.	4.225	197.434	0,01 %
Hortonworks, Inc.	9.817	197.420	0,01 %	Vista Outdoor, Inc.	13.530	197.132	0,01 %
Fitbit, Inc. Klasse A	37.851	216.129	0,01 %	CONSOL Energy, Inc.	4.989	197.115	0,01 %
Century Aluminum Co.	10.952	215.097	0,01 %	Atrion Corp.	312	196.747	0,01 %
DineEquity, Inc.	4.240	215.095	0,01 %	Casella Waste Systems, Inc. Klasse A	8.514	195.992	0,01 %
Infinera Corp.	33.974	215.055	0,01 %	Huron Consulting Group, Inc.	4.845	195.980	0,01 %
Astronics Corp.	5.181	214.856	0,01 %	ConnectOne Bancorp, Inc.	7.610	195.957	0,01 %
CBL & Associates Properties, Inc. REIT	37.910	214.571	0,01 %	Kindred Healthcare, Inc.	20.179	195.736	0,01 %
Avon Products, Inc.	99.718	214.394	0,01 %	Shutterstock, Inc.	4.545	195.571	0,01 %
Strayer Education, Inc.	2.391	214.186	0,01 %	Aegion Corp. Klasse A	7.686	195.455	0,01 %
Diplomat Pharmacy, Inc.	10.671	214.167	0,01 %	Advanced Drainage Systems, Inc.	8.191	195.355	0,01 %
Alexander's, Inc. REIT	541	214.155	0,01 %	HomeStreet, Inc.	6.746	195.297	0,01 %
Sandstorm Gold Ltd.	42.713	214.085	0,01 %	Preferred Bank	3.317	194.973	0,01 %
Dillard's, Inc. Klasse A	3.565	214.078	0,01 %	Consolidated Communications Holdings, Inc.	15.981	194.808	0,01 %
SeaWorld Entertainment, Inc.	15.764	213.917	0,01 %	Jagged Peak Energy, Inc.	12.332	194.599	0,01 %
Forum Energy Technologies, Inc.	13.735	213.579	0,01 %	Axcelis Technologies, Inc.	6.776	194.471	0,01 %
Orthofix International NV	3.890	212.783	0,01 %	General Communication, Inc. Klasse A	4.971	193.968	0,01 %
MainSource Financial Group, Inc.	5.857	212.668	0,01 %	CBIZ, Inc.	12.527	193.542	0,01 %
Encore Wire Corp.	4.367	212.455	0,01 %	NCI Building Systems, Inc.	10.014	193.270	0,01 %
Universal Insurance Holdings, Inc.	7.755	212.099	0,01 %	TrueCar, Inc.	17.249	193.189	0,01 %
BioTelemetry, Inc.	7.082	211.752	0,01 %	Andersons, Inc.	6.199	193.099	0,01 %
Modine Manufacturing Co.	10.479	211.676	0,01 %	Ladder Capital Corp. REIT Klasse A	14.130	192.592	0,01 %
Crocs, Inc.	16.729	211.455	0,01 %	Novocure Ltd.	9.522	192.344	0,01 %
Pennsylvania REIT	17.744	210.976	0,01 %	Fairmount Santrol Holdings, Inc.	36.752	192.213	0,01 %
Getty Realty Corp. REIT	7.753	210.571	0,01 %	Cardiovascular Systems, Inc.	8.110	192.126	0,01 %
Flagstar Bancorp, Inc.	5.626	210.525	0,01 %	Antero Midstream GP LP	9.742	192.112	0,01 %
3D Systems Corp.	24.164	208.777	0,01 %	SEACOR Holdings, Inc.	4.156	192.090	0,01 %
Exterran Corp.	6.640	208.762	0,01 %	SUPERVALU, Inc.	8.874	191.678	0,01 %
Seacoast Banking Corp. of Florida	8.274	208.588	0,01 %	REGENXBIO, Inc.	5.764	191.653	0,01 %
Capella Education Co.	2.683	207.664	0,01 %	MBIA, Inc.	26.131	191.279	0,01 %
Lydall, Inc.	4.088	207.466	0,01 %	1st Source Corp.	3.868	191.273	0,01 %
BancFirst Corp.	4.046	206.953	0,01 %	Douglas Dynamics, Inc.	5.037	190.399	0,01 %
Cray, Inc.	8.550	206.910	0,01 %	National Bank Holdings Corp. Klasse A	5.870	190.364	0,01 %
Chase Corp.	1.716	206.778	0,01 %	Express, Inc.	18.720	190.008	0,01 %
Gibraltar Industries, Inc.	6.247	206.151	0,01 %	Kratos Defense & Security Solutions, Inc.	17.905	189.614	0,01 %
First BanCorp	40.337	205.719	0,01 %	Denbury Resources, Inc.	85.725	189.452	0,01 %
Denny's Corp.	15.532	205.644	0,01 %	Clearwater Paper Corp.	4.168	189.227	0,01 %
Shake Shack, Inc. Klasse A	4.756	205.459	0,01 %	RE/MAX Holdings, Inc. Klasse A	3.898	189.053	0,01 %
MINDBODY, Inc. Klasse A	6.729	204.898	0,01 %	FBL Financial Group, Inc. Klasse A	2.711	188.821	0,01 %
Virtus Investment Partners, Inc.	1.780	204.789	0,01 %	Enanta Pharmaceuticals, Inc.	3.206	188.128	0,01 %
NMI Holdings, Inc. Klasse A	12.036	204.612	0,01 %	Granite Point Mortgage Trust, Inc. REIT	10.580	187.689	0,01 %
MyoKardia, Inc.	4.850	204.185	0,01 %	Bryn Mawr Bank Corp.	4.246	187.673	0,01 %
TFS Financial Corp.	13.657	204.036	0,01 %	Quotient Technology, Inc.	15.939	187.283	0,01 %
SPS Commerce, Inc.	4.189	203.544	0,01 %	United Financial Bancorp, Inc.	10.611	187.178	0,01 %
Aimmune Therapeutics, Inc.	5.375	203.282	0,01 %				
AVX Corp.	11.748	203.240	0,01 %				
St Joe Co.	11.243	202.936	0,01 %				
Materion Corp.	4.174	202.856	0,01 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Lumber Liquidators Holdings, Inc.	5.928	186.080	0,01 %	Super Micro Computer, Inc.	8.164	170.832	0,01 %
Stewart Information Services Corp.	4.389	185.655	0,01 %	Carolina Financial Corp.	4.582	170.221	0,01 %
Kirby Corp.	2.778	185.570	0,01 %	Assembly Biosciences, Inc.	3.758	170.049	0,01 %
Central Pacific Financial Corp.	6.214	185.364	0,01 %	PJT Partners, Inc. Klasse A	3.723	169.769	0,01 %
Customers Bancorp, Inc.	7.112	184.841	0,01 %	Editas Medicine, Inc.	5.518	169.568	0,01 %
Cardtronics plc Klasse A	9.974	184.718	0,01 %	Quanex Building Products Corp.	7.221	168.971	0,01 %
Anika Therapeutics, Inc.	3.424	184.588	0,01 %	NRG Yield, Inc. Klasse A	8.964	168.971	0,01 %
NN, Inc.	6.687	184.561	0,01 %	Liberty TripAdvisor Holdings, Inc. Klasse A	17.848	168.217	0,01 %
Omeros Corp.	9.498	184.546	0,01 %	Veeco Instruments, Inc.	11.209	166.454	0,01 %
Northfield Bancorp, Inc.	10.795	184.379	0,01 %	Conn's, Inc.	4.681	166.410	0,01 %
PGT Innovations, Inc.	10.920	184.002	0,01 %	Quad/Graphics, Inc.	7.350	166.110	0,01 %
USANA Health Sciences, Inc.	2.483	183.866	0,01 %	Quality Systems, Inc.	12.220	165.948	0,01 %
EVERTEC, Inc.	13.432	183.347	0,01 %	Retrophin, Inc.	7.849	165.378	0,01 %
Simply Good Foods Co.	12.854	183.298	0,01 %	Evolent Health, Inc. Klasse A	13.417	165.029	0,01 %
Newpark Resources, Inc.	21.282	183.025	0,01 %	Halcon Resources Corp.	21.793	164.973	0,01 %
TriCo Bancshares	4.828	182.788	0,01 %	CSW Industrials, Inc.	3.582	164.593	0,01 %
Virtu Financial, Inc. Klasse A	9.976	182.561	0,01 %	Camden National Corp.	3.895	164.096	0,01 %
Thermon Group Holdings, Inc.	7.703	182.330	0,01 %	Hyster-Yale Materials Handling, Inc.	1.923	163.763	0,01 %
Easterly Government Properties, Inc. REIT	8.531	182.052	0,01 %	MacroGenics, Inc.	8.588	163.172	0,01 %
Schnitzer Steel Industries, Inc. Klasse A	5.431	181.939	0,01 %	Net 1 UEPS Technologies, Inc.	13.722	163.155	0,01 %
Career Education Corp.	15.016	181.393	0,01 %	American Outdoor Brands Corp.	12.698	163.042	0,01 %
AMC Entertainment Holdings, Inc. Klasse A	11.981	180.913	0,01 %	iStar, Inc. REIT	14.397	162.686	0,01 %
Lakeland Bancorp, Inc.	9.380	180.565	0,01 %	Inter Parfums, Inc.	3.739	162.460	0,01 %
Intersect ENT, Inc.	5.572	180.533	0,01 %	Cass Information Systems, Inc.	2.784	162.057	0,01 %
Banc of California, Inc.	8.711	179.882	0,01 %	Liberty Media Corp.-Liberty Braves Klasse C	7.293	162.050	0,01 %
Dermira, Inc.	6.468	179.875	0,01 %	SkyWest, Inc.	3.035	161.159	0,01 %
Xencor, Inc.	8.202	179.788	0,01 %	Everbridge, Inc.	5.401	160.518	0,01 %
AxoGen, Inc.	6.350	179.705	0,01 %	Spirit Airlines, Inc.	3.569	160.070	0,01 %
InfraREIT, Inc. REIT	9.666	179.594	0,01 %	Acacia Communications, Inc.	4.417	160.028	0,01 %
Univest Corp. of Pennsylvania	6.399	179.492	0,01 %	German American Bancorp, Inc.	4.527	159.939	0,01 %
Kelly Services, Inc. Klasse A	6.581	179.464	0,01 %	Medifast, Inc.	2.286	159.586	0,01 %
Radware Ltd.	9.250	179.450	0,01 %	KEMET Corp.	10.551	158.898	0,01 %
KMG Chemicals, Inc.	2.714	179.341	0,01 %	Amphastar Pharmaceuticals, Inc.	8.249	158.711	0,01 %
Capstead Mortgage Corp. REIT	20.646	178.588	0,01 %	Ormat Technologies, Inc.	2.466	158.402	0,01 %
Global Brass & Copper Holdings, Inc.	5.387	178.310	0,01 %	Federal Agricultural Mortgage Corp. Klasse C	2.024	158.358	0,01 %
Community Trust Bancorp, Inc.	3.785	178.273	0,01 %	Vocera Communications, Inc.	5.236	158.232	0,01 %
SP Plus Corp.	4.787	177.598	0,01 %	California Resources Corp.	8.130	158.047	0,01 %
Marten Transport Ltd.	8.746	177.544	0,01 %	Flexion Therapeutics, Inc.	6.289	157.477	0,01 %
National Western Life Group, Inc. Klasse A	536	177.427	0,01 %	Preferred Apartment Communities, Inc. REIT Klasse A	7.751	156.958	0,01 %
Luminex Corp.	8.992	177.142	0,01 %	New York, Inc. REIT	39.887	156.756	0,01 %
GoPro, Inc. Klasse A	23.398	177.123	0,01 %	Buckle, Inc.	6.574	156.132	0,01 %
Donnelley Financial Solutions, Inc.	9.086	177.086	0,01 %	Control4 Corp.	5.245	156.091	0,01 %
Columbus McKinnon Corp.	4.422	176.792	0,01 %	TeleTech Holdings, Inc.	3.856	155.204	0,01 %
CalAmp Corp.	8.227	176.305	0,01 %	Echo Global Logistics, Inc.	5.542	155.176	0,01 %
CTS Corp.	6.820	175.615	0,01 %	SunCoke Energy, Inc.	12.904	154.719	0,01 %
Washington Trust Bancorp, Inc.	3.276	174.447	0,01 %	Middlesex Water Co.	3.855	153.853	0,01 %
Rudolph Technologies, Inc.	7.284	174.088	0,01 %	Playa Hotels & Resorts NV	14.248	153.736	0,01 %
Stock Yards Bancorp, Inc.	4.603	173.533	0,01 %	NorthStar Realty Europe Corp. REIT	11.384	152.887	0,01 %
Ultra Clean Holdings, Inc.	7.512	173.452	0,01 %	Globalstar, Inc.	116.678	152.848	0,01 %
Cincinnati Bell, Inc.	8.319	173.451	0,01 %	Acushnet Holdings Corp.	7.245	152.725	0,01 %
CoBiz Financial, Inc.	8.676	173.433	0,01 %	Unifi, Inc.	4.256	152.663	0,01 %
ORBCOMM, Inc.	17.028	173.345	0,01 %	Ambac Financial Group, Inc.	9.527	152.241	0,01 %
FARO Technologies, Inc.	3.671	172.537	0,01 %	Ethan Allen Interiors, Inc.	5.311	151.895	0,01 %
William Lyon Homes Klasse A	5.925	172.299	0,01 %	Opus Bank	5.563	151.870	0,01 %
Boingo Wireless, Inc.	7.637	171.832	0,01 %	Connecticut Water Service, Inc.	2.639	151.505	0,01 %
Flushing Financial Corp.	6.246	171.765	0,01 %	Unitil Corp.	3.312	151.093	0,01 %
Independence Realty Trust, Inc. REIT	17.011	171.641	0,01 %	Resolute Forest Products, Inc.	13.645	150.777	0,01 %
Blackline, Inc.	5.230	171.544	0,01 %	Titan International, Inc.	11.655	150.116	0,01 %
CIRCOR International, Inc.	3.521	171.402	0,01 %	Mercer International, Inc.	10.488	149.978	0,01 %
Alder Biopharmaceuticals, Inc.	14.966	171.361	0,01 %	Red Robin Gourmet Burgers, Inc.	2.648	149.347	0,01 %
Syntel, Inc.	7.450	171.276	0,01 %	Tootsie Roll Industries, Inc.	4.096	149.094	0,01 %
MTGE Investment Corp. REIT	9.246	171.051	0,01 %	Investors Real Estate Trust REIT	26.239	149.038	0,01 %
Varonis Systems, Inc.	3.521	170.945	0,01 %	Gladstone Commercial Corp. REIT	7.073	148.957	0,01 %
				Argan, Inc.	3.305	148.725	0,01 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Madrigal Pharmaceuticals, Inc.	1.616	148.333	0,01 %	Lannett Co., Inc.	5.787	134.258	0,01 %
Universal Electronics, Inc.	3.135	148.129	0,01 %	Kforce, Inc.	5.297	133.749	0,01 %
Griffon Corp.	7.230	147.130	0,01 %	Greenlight Capital Re Ltd. Klasse A	6.635	133.364	0,01 %
Live Oak Bancshares, Inc.	6.166	147.059	0,01 %	Lantheus Holdings, Inc.	6.505	133.027	0,01 %
Presidio, Inc.	7.671	147.053	0,01 %	National Presto Industries, Inc.	1.334	132.666	0,01 %
OceanFirst Financial Corp.	5.601	147.026	0,01 %	Ruth's Hospitality Group, Inc.	6.119	132.476	0,01 %
Stone Energy Corp.	4.549	146.296	0,01 %	ATN International, Inc.	2.391	132.127	0,01 %
Exactech, Inc.	2.955	146.125	0,01 %	Epizyme, Inc.	10.521	132.039	0,01 %
Applied Optoelectronics, Inc.	3.860	145.985	0,01 %	Gogo, Inc.	11.689	131.852	0,01 %
Ring Energy, Inc.	10.456	145.338	0,01 %	HealthStream, Inc.	5.693	131.850	0,01 %
Green Plains, Inc.	8.621	145.264	0,01 %	QCR Holdings, Inc.	3.067	131.421	0,01 %
Audentes Therapeutics, Inc.	4.644	145.125	0,01 %	Vanda Pharmaceuticals, Inc.	8.643	131.374	0,01 %
Akebia Therapeutics, Inc.	9.756	145.072	0,01 %	First Community Bancshares, Inc.	4.570	131.296	0,01 %
Tower International, Inc.	4.741	144.838	0,01 %	National HealthCare Corp.	2.149	130.960	0,01 %
PROS Holdings, Inc.	5.472	144.734	0,01 %	INTL. FCStone, Inc.	3.067	130.440	0,01 %
Finish Line, Inc. Klasse A	9.928	144.254	0,01 %	Carbonite, Inc.	5.181	130.043	0,01 %
Oritani Financial Corp.	8.784	144.058	0,01 %	Five Prime Therapeutics, Inc.	5.928	129.942	0,01 %
Alarm.com Holdings, Inc.	3.816	144.054	0,01 %	AngioDynamics, Inc.	7.787	129.498	0,01 %
Hersha Hospitality Trust REIT Klasse A	8.274	143.968	0,01 %	Intra-Cellular Therapies, Inc. Klasse A	8.943	129.495	0,01 %
MYR Group, Inc.	4.028	143.920	0,01 %	Investment Technology Group, Inc.	6.700	128.975	0,01 %
Loral Space & Communications, Inc.	3.265	143.823	0,01 %	Xcerra Corp.	13.130	128.543	0,01 %
Perficient, Inc.	7.515	143.311	0,01 %	Genesco, Inc.	3.953	128.472	0,01 %
CVR Energy, Inc.	3.832	142.704	0,01 %	Triple-S Management Corp. Klasse B	5.156	128.127	0,01 %
Central Garden & Pet Co.	3.664	142.603	0,01 %	Regis Corp.	8.313	127.688	0,01 %
Diamond Hill Investment Group, Inc.	690	142.595	0,01 %	MDC Partners, Inc. Klasse A	13.065	127.384	0,01 %
Blue Hills Bancorp, Inc.	7.094	142.589	0,01 %	Cohu, Inc.	5.801	127.332	0,01 %
Genomic Health, Inc.	4.167	142.511	0,01 %	La Jolla Pharmaceutical Co.	3.951	127.143	0,01 %
PTC Therapeutics, Inc.	8.539	142.431	0,01 %	Archrock, Inc.	12.102	127.071	0,01 %
Dime Community Bancshares, Inc.	6.789	142.230	0,01 %	K2M Group Holdings, Inc.	7.056	127.008	0,01 %
Whitestone REIT Klasse B	9.818	141.477	0,01 %	McEwen Mining, Inc.	55.620	126.814	0,01 %
Electro Scientific Industries, Inc.	6.566	140.709	0,01 %	Triumph Bancorp, Inc.	4.024	126.756	0,01 %
Kimball International, Inc. Klasse B	7.515	140.305	0,01 %	Chuy's Holdings, Inc.	4.508	126.449	0,01 %
Stoneridge, Inc.	6.127	140.063	0,01 %	TriState Capital Holdings, Inc.	5.493	126.339	0,01 %
SandRidge Energy, Inc.	6.641	139.926	0,01 %	Monarch Casino & Resort, Inc.	2.816	126.213	0,01 %
Cutera, Inc.	3.075	139.451	0,01 %	Anworth Mortgage Asset Corp. REIT	23.155	125.963	0,01 %
Allegiant Travel Co. Klasse A	901	139.430	0,01 %	Heska Corp.	1.568	125.769	0,01 %
AtriCure, Inc.	7.640	139.354	0,01 %	RPX Corp.	9.335	125.462	0,01 %
EZCORP, Inc. Klasse A	11.411	139.214	0,01 %	Marcus Corp.	4.570	124.990	0,01 %
Kronos Worldwide, Inc.	5.401	139.184	0,01 %	Cedar Realty Trust, Inc. REIT	20.501	124.646	0,01 %
Atkore International Group, Inc.	6.485	139.103	0,01 %	elf Beauty, Inc.	5.585	124.601	0,01 %
RR Donnelley & Sons Co.	14.934	138.886	0,01 %	Mercantile Bank Corp.	3.520	124.502	0,01 %
Lattice Semiconductor Corp.	24.015	138.807	0,01 %	Rigel Pharmaceuticals, Inc.	31.920	123.850	0,01 %
Resolute Energy Corp.	4.409	138.751	0,01 %	Spartan Motors, Inc.	7.841	123.496	0,01 %
BJ's Restaurants, Inc.	3.811	138.720	0,01 %	World Acceptance Corp.	1.526	123.179	0,01 %
Intrexon Corp.	12.040	138.701	0,01 %	BBX Capital Corp. Klasse A	15.446	123.105	0,01 %
Tellurian, Inc.	14.233	138.629	0,01 %	Aclaris Therapeutics, Inc.	4.979	122.782	0,01 %
Armada Hoffer Properties, Inc. REIT	8.907	138.326	0,01 %	Movado Group, Inc.	3.811	122.714	0,01 %
First of Long Island Corp.	4.846	138.111	0,01 %	First Foundation, Inc.	6.607	122.494	0,01 %
Beazer Homes USA, Inc.	7.162	137.582	0,01 %	CryoLife, Inc.	6.383	122.234	0,01 %
Providence Service Corp.	2.316	137.431	0,01 %	CorVel Corp.	2.304	121.882	0,01 %
Horizon Bancorp	4.940	137.332	0,01 %	Photronics, Inc.	14.296	121.873	0,01 %
Silver Spring Networks, Inc.	8.437	137.017	0,01 %	LivePerson, Inc.	10.567	121.521	0,01 %
Ashford Hospitality Trust, Inc. REIT	20.359	137.016	0,01 %	Keane Group, Inc.	6.382	121.322	0,01 %
New York Mortgage Trust, Inc. REIT	22.199	136.968	0,01 %	Altisource Residential Corp. REIT	10.219	121.197	0,01 %
Guaranty Bancorp	4.944	136.702	0,01 %	Community Healthcare Trust, Inc. REIT	4.302	120.886	0,01 %
New Senior Investment Group, Inc. REIT	18.076	136.655	0,01 %	NeoGenomics, Inc.	13.601	120.505	0,01 %
Urstadt Biddle Properties, Inc. REIT Klasse A	6.247	135.810	0,01 %	Trupanion, Inc.	4.117	120.505	0,01 %
Ennis, Inc.	6.524	135.373	0,01 %	Sucampo Pharmaceuticals, Inc. Klasse A	6.711	120.462	0,01 %
Meridian Bioscience, Inc.	9.641	134.974	0,01 %	CatchMark Timber Trust, Inc. REIT Klasse A	9.172	120.428	0,01 %
LSC Communications, Inc.	8.904	134.896	0,01 %	Nanometrics, Inc.	4.824	120.214	0,01 %
Almost Family, Inc.	2.437	134.888	0,01 %	Five Point Holdings LLC Klasse A	8.493	119.751	0,01 %
Bank Mutual Corp.	12.645	134.669	0,01 %	Synergy Pharmaceuticals, Inc.	53.344	118.957	0,01 %
ImmunoGen, Inc.	21.003	134.629	0,01 %	Select Energy Services, Inc. Klasse A	6.500	118.560	0,01 %
IXYS Corp.	5.619	134.575	0,01 %	Century Communities, Inc.	3.809	118.460	0,01 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Student Transportation, Inc.	19.087	117.908	0,01 %	Abeona Therapeutics, Inc.	6.656	105.498	0,01 %
LeMaitre Vascular, Inc.	3.702	117.872	0,01 %	DXP Enterprises, Inc.	3.567	105.476	0,01 %
Fiesta Restaurant Group, Inc.	6.199	117.781	0,01 %	Instructure, Inc.	3.186	105.457	0,01 %
Heritage Commerce Corp.	7.685	117.734	0,01 %	Hawaiian Holdings, Inc.	2.645	105.403	0,01 %
American Vanguard Corp.	5.962	117.153	0,01 %	Basic Energy Services, Inc.	4.487	105.310	0,01 %
WildHorse Resource Development Corp.	6.335	116.627	0,01 %	NV5 Global, Inc.	1.944	105.268	0,01 %
Marcus & Millichap, Inc.	3.576	116.613	0,01 %	YRC Worldwide, Inc.	7.313	105.161	0,01 %
Nicolet Bankshares, Inc.	2.127	116.432	0,01 %	Biglari Holdings, Inc.	253	104.843	0,01 %
Peoples Bancorp, Inc.	3.567	116.356	0,01 %	Greenhill & Co., Inc.	5.352	104.364	0,01 %
Engility Holdings, Inc.	4.101	116.345	0,01 %	Invitae Corp.	11.483	104.266	0,01 %
Great Southern Bancorp, Inc.	2.251	116.264	0,01 %	Maiden Holdings Ltd.	15.797	104.260	0,01 %
Plug Power, Inc.	49.194	116.098	0,01 %	MarineMax, Inc.	5.502	103.988	0,01 %
Invacare Corp.	6.877	115.877	0,01 %	UMH Properties, Inc. REIT	6.979	103.987	0,01 %
Kimball Electronics, Inc.	6.347	115.833	0,01 %	Amplify Snack Brands, Inc.	8.649	103.874	0,01 %
Rent-A-Center, Inc.	10.370	115.107	0,01 %	XO Group, Inc.	5.626	103.856	0,01 %
K12, Inc.	7.231	114.973	0,01 %	Endologix, Inc.	19.387	103.720	0,01 %
AG Mortgage Investment Trust, Inc. REIT	6.033	114.687	0,01 %	Cowen, Inc. Klasse A	7.578	103.440	0,01 %
Gorman-Rupp Co.	3.670	114.541	0,01 %	United Insurance Holdings Corp.	5.991	103.345	0,01 %
Cision Ltd.	9.644	114.474	0,01 %	Independent Bank Corp. - IBCP	4.610	103.034	0,01 %
TimkenSteel Corp.	7.507	114.031	0,01 %	Workiva, Inc. Klasse A	4.794	102.592	0,01 %
Everi Holdings, Inc.	15.088	113.764	0,01 %	Tredegar Corp.	5.342	102.566	0,01 %
Bridge Bancorp, Inc.	3.233	113.155	0,01 %	Wesco Aircraft Holdings, Inc.	13.849	102.483	0,01 %
Bonanza Creek Energy, Inc.	4.099	113.091	0,01 %	Systemax, Inc.	3.050	101.474	0,01 %
ANI Pharmaceuticals, Inc.	1.749	112.723	0,01 %	Heritage Insurance Holdings, Inc.	5.624	101.344	0,01 %
TETRA Technologies, Inc.	26.395	112.707	0,01 %	Emerald Expositions Events, Inc.	4.976	101.212	0,01 %
National Commerce Corp.	2.798	112.620	0,01 %	CytomX Therapeutics, Inc.	4.794	101.201	0,01 %
Veritex Holdings, Inc.	4.056	111.905	0,01 %	CommerceHub, Inc. - Series C	4.900	100.891	0,01 %
At Home Group, Inc.	3.671	111.562	0,01 %	Haverty Furniture Cos, Inc.	4.453	100.860	0,01 %
Ichor Holdings Ltd.	4.522	111.241	0,01 %	InnerWorkings, Inc.	10.053	100.832	0,01 %
First Defiance Financial Corp.	2.140	111.216	0,01 %	iRhythm Technologies, Inc.	1.798	100.778	0,01 %
American Public Education, Inc.	4.433	111.047	0,01 %	United States Cellular Corp.	2.678	100.773	0,01 %
Comtech Telecommunications Corp.	5.020	111.042	0,01 %	Waterstone Financial, Inc.	5.895	100.510	0,01 %
QAD, Inc. Klasse A	2.856	110.956	0,01 %	Progenics Pharmaceuticals, Inc.	16.838	100.186	0,01 %
Bill Barrett Corp.	21.546	110.531	0,01 %	VSE Corp.	2.063	99.911	0,01 %
OMNOVA Solutions, Inc.	11.041	110.410	0,01 %	Entravision Communications Corp. Klasse A	13.957	99.793	0,01 %
John B Sanfilippo & Son, Inc.	1.737	109.865	0,01 %	Cross Country Healthcare, Inc.	7.817	99.745	0,01 %
Insteel Industries, Inc.	3.872	109.655	0,01 %	Daktronics, Inc.	10.907	99.581	0,01 %
Tucows, Inc. Klasse A	1.565	109.628	0,01 %	Del Taco Restaurants, Inc.	8.205	99.445	0,01 %
Westwood Holdings Group, Inc.	1.655	109.578	0,01 %	Renewable Energy Group, Inc.	8.420	99.356	0,01 %
Bancorp, Inc.	11.085	109.520	0,01 %	BioCryst Pharmaceuticals, Inc.	20.208	99.221	0,01 %
Nationstar Mortgage Holdings, Inc.	5.916	109.446	0,01 %	Community Health Systems, Inc.	23.277	99.160	0,01 %
Tejon Ranch Co.	5.254	109.073	0,01 %	Ladenburg Thalmann Financial Services, Inc.	31.219	98.652	0,01 %
Iovance Biotherapeutics, Inc.	13.617	108.936	0,01 %	PDL BioPharma, Inc.	35.971	98.561	0,01 %
Myers Industries, Inc.	5.582	108.849	0,01 %	Heidrick & Struggles International, Inc.	4.012	98.495	0,01 %
Peapack Gladstone Financial Corp.	3.105	108.737	0,01 %	A10 Networks, Inc.	12.755	98.469	0,01 %
CommerceHub, Inc. - Series A	4.943	108.697	0,01 %	Midland States Bancorp, Inc.	3.030	98.414	0,01 %
Party City Holdco, Inc.	7.777	108.489	0,01 %	RadNet, Inc.	9.725	98.223	0,01 %
Caesarstone Ltd.	4.929	108.438	0,01 %	CAI International, Inc.	3.467	98.185	0,01 %
Endurance International Group Holdings, Inc.	12.876	108.158	0,01 %	Freshpet, Inc.	5.181	98.180	0,01 %
OFG Bancorp	11.491	108.015	0,01 %	Tactile Systems Technology, Inc.	3.387	98.155	0,01 %
Chefs' Warehouse, Inc.	5.245	107.522	0,01 %	Hovnanian Enterprises, Inc. Klasse A	29.130	97.586	0,01 %
Frontier Communications Corp.	15.857	107.193	0,01 %	Daseke, Inc.	6.778	96.858	0,01 %
Carrols Restaurant Group, Inc.	8.822	107.187	0,01 %	AMAG Pharmaceuticals, Inc.	7.299	96.712	0,01 %
ZIOPHARM Oncology, Inc.	25.863	107.073	0,01 %	National CineMedia, Inc.	14.098	96.712	0,01 %
SunPower Corp. Klasse A	12.678	106.876	0,01 %	Sanchez Energy Corp.	18.161	96.435	0,01 %
Western Asset Mortgage Capital Corp. REIT	10.739	106.853	0,01 %	HomeTrust Bancshares, Inc.	3.744	96.408	0,01 %
Hackett Group, Inc.	6.790	106.671	0,01 %	Depomed, Inc.	11.970	96.358	0,01 %
Actua Corp.	6.834	106.610	0,01 %	Ply Gem Holdings, Inc.	5.203	96.256	0,01 %
STAAR Surgical Co.	6.878	106.609	0,01 %	TG Therapeutics, Inc.	11.720	96.104	0,01 %
NexPoint Residential Trust, Inc. REIT	3.803	106.256	0,01 %	Ribbon Communications, Inc.	12.356	95.512	0,01 %
Nautilus, Inc.	7.959	106.253	0,01 %	Hooker Furniture Corp.	2.236	94.918	0,01 %
Fidelity Southern Corp.	4.870	106.166	0,01 %	Glu Mobile, Inc.	26.056	94.844	0,01 %
State Auto Financial Corp.	3.634	105.822	0,01 %	Atara Biotherapeutics, Inc.	5.223	94.536	0,01 %
Zumiez, Inc.	5.068	105.541	0,01 %	Atlantic Capital Bancshares, Inc.	5.367	94.459	0,01 %
				TerraForm Power, Inc. Klasse A	7.894	94.412	0,01 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Matrix Service Co.	5.303	94.393	0,01 %	WideOpenWest, Inc.	7.447	78.715	0,01 %
Eagle Pharmaceuticals, Inc.	1.757	93.859	0,01 %	Glaukos Corp.	3.067	78.669	0,01 %
Bazaarvoice, Inc.	17.194	93.707	0,01 %	Ascena Retail Group, Inc.	33.461	78.633	0,01 %
Sonic Automotive, Inc. Klasse A	5.067	93.486	0,01 %	Titan Machinery, Inc.	3.679	77.884	0,01 %
Dynex Capital, Inc. REIT	13.258	92.939	0,01 %	Pier 1 Imports, Inc.	18.784	77.766	0,01 %
Ingles Markets, Inc. Klasse A	2.678	92.659	0,01 %	Shoe Carnival, Inc.	2.894	77.415	0,01 %
Citizens, Inc. Klasse A	12.487	91.779	0,01 %	Republic First Bancorp, Inc.	9.153	77.343	0,01 %
Lexicon Pharmaceuticals, Inc.	9.253	91.420	0,01 %	Altisource Portfolio Solutions SA	2.751	77.028	0,01 %
PDF Solutions, Inc.	5.806	91.154	0,01 %	Forrester Research, Inc.	1.741	76.952	0,01 %
Green Bancorp, Inc.	4.484	91.025	0,01 %	Energy Recovery, Inc.	8.746	76.527	0,01 %
Arbor Realty Trust, Inc. REIT	10.476	90.513	0,01 %	Frank's International NV	11.501	76.482	0,01 %
REX American Resources Corp.	1.093	90.489	0,01 %	Ocwen Financial Corp.	24.398	76.366	0,01 %
Yext, Inc.	7.486	90.057	0,01 %	Revlon, Inc. Klasse A	3.500	76.300	0,01 %
Alpha & Omega Semiconductor Ltd.	5.501	89.996	0,01 %	Synchronoss Technologies, Inc.	8.516	76.133	0,01 %
Accuray, Inc.	20.888	89.818	0,01 %	Barnes & Noble ,Inc.	11.326	75.884	0,01 %
Sunrun, Inc.	15.184	89.586	0,01 %	American Railcar Industries, Inc.	1.815	75.577	0,01 %
People's Utah Bancorp	2.956	89.567	0,01 %	Essendant, Inc.	8.145	75.504	0,01 %
KKR Real Estate Finance Trust, Inc.	4.468	89.405	0,01 %	Cato Corp. Klasse A	4.731	75.318	0,01 %
Mesa Laboratories, Inc.	713	88.626	0,01 %	Impinj, Inc.	3.316	74.709	0,01 %
Cerus Corp.	26.173	88.465	0,01 %	Celldex Therapeutics, Inc.	26.257	74.570	0,01 %
MoneyGram International, Inc.	6.685	88.108	0,01 %	Donegal Group, Inc. Klasse A	4.274	73.940	0,01 %
Intellia Therapeutics, Inc.	4.572	87.874	0,01 %	SMART Global Holdings, Inc.	2.172	73.196	0,01 %
Benefitfocus, Inc.	3.253	87.831	0,01 %	Hawkins, Inc.	2.069	72.829	0,00 %
Vicor Corp.	4.200	87.780	0,01 %	First Financial Corp.	1.605	72.787	0,00 %
Motorcar Parts of America, Inc.	3.502	87.515	0,01 %	Republic Bancorp, Inc. Klasse A	1.914	72.770	0,00 %
Spok Holdings, Inc.	5.569	87.155	0,01 %	Carriage Services, Inc. Klasse A	2.824	72.605	0,00 %
8Point3 Energy Partners LP Klasse A	5.727	87.108	0,01 %	1-800-Flowers.com, Inc. Klasse A	6.784	72.589	0,00 %
Powell Industries, Inc.	3.040	87.096	0,01 %	Haynes International, Inc.	2.259	72.401	0,00 %
Franklin Financial Network, Inc.	2.553	87.057	0,01 %	ANGI Homeservices, Inc. Klasse A	6.912	72.300	0,00 %
Enova International, Inc.	5.726	87.035	0,01 %	Cytokinetics, Inc.	8.824	71.916	0,00 %
Clean Energy Fuels Corp.	42.810	86.904	0,01 %	Concert Pharmaceuticals, Inc.	2.770	71.660	0,00 %
RMR Group, Inc. Klasse A	1.458	86.459	0,01 %	Surmodics, Inc.	2.556	71.568	0,00 %
Unisys Corp.	10.603	86.414	0,01 %	Medpace Holdings, Inc.	1.963	71.178	0,00 %
Bar Harbor Bankshares	3.198	86.378	0,01 %	Farmer Brothers Co.	2.210	71.051	0,00 %
Laureate Education, Inc. Klasse A	6.365	86.309	0,01 %	Coherus Biosciences, Inc.	7.957	70.022	0,00 %
Team, Inc.	5.792	86.301	0,01 %	PHH Corp.	6.778	69.813	0,00 %
Hibbett Sports, Inc.	4.216	86.006	0,01 %	Voyager Therapeutics, Inc.	4.171	69.239	0,00 %
Weis Markets, Inc.	2.072	85.760	0,01 %	Rapid7, Inc.	3.697	68.986	0,00 %
Collegium Pharmaceutical, Inc.	4.626	85.396	0,01 %	Entellus Medical, Inc.	2.827	68.951	0,00 %
Resources Connection, Inc.	5.522	85.315	0,01 %	PICO Holdings, Inc.	5.372	68.762	0,00 %
FutureFuel Corp.	6.038	85.075	0,01 %	Park Electrochemical Corp.	3.494	68.657	0,00 %
York Water Co.	2.497	84.648	0,01 %	Reata Pharmaceuticals, Inc. Klasse A	2.414	68.364	0,00 %
Par Pacific Holdings, Inc.	4.386	84.562	0,01 %	Tile Shop Holdings, Inc.	7.093	68.093	0,00 %
Financial Institutions, Inc.	2.717	84.499	0,01 %	Windstream Holdings, Inc.	36.789	68.060	0,00 %
Matson, Inc.	2.824	84.268	0,01 %	Park-Ohio Holdings Corp.	1.480	68.006	0,00 %
Allegiance Bancshares, Inc.	2.223	83.696	0,01 %	Barnes & Noble Education, Inc.	8.226	67.782	0,00 %
National Research Corp. Klasse A	2.243	83.664	0,01 %	Agenus, Inc.	20.709	67.511	0,00 %
Arrow Financial Corp.	2.461	83.551	0,01 %	Computer Programs & Systems, Inc.	2.246	67.492	0,00 %
Paratek Pharmaceuticals, Inc.	4.665	83.504	0,01 %	Winmark Corp.	519	67.159	0,00 %
Citi Trends, Inc.	3.138	83.031	0,01 %	Fossil Group, Inc.	8.634	67.086	0,00 %
Covenant Transportation Group, Inc. Klasse A	2.880	82.742	0,01 %	One Liberty Properties, Inc. REIT	2.587	67.055	0,00 %
TPG RE Finance Trust, Inc. REIT	4.340	82.677	0,01 %	EMC Insurance Group, Inc.	2.316	66.446	0,00 %
Atlas Air Worldwide Holdings, Inc.	1.405	82.403	0,01 %	Air Transport Services Group, Inc.	2.870	66.412	0,00 %
Access National Corp.	2.955	82.267	0,01 %	Natera, Inc.	7.346	66.041	0,00 %
Inovio Pharmaceuticals, Inc.	19.510	80.576	0,01 %	Novavax, Inc.	52.947	65.654	0,00 %
First Mid-Illinois Bancshares, Inc.	2.089	80.510	0,01 %	Karyopharm Therapeutics, Inc.	6.810	65.376	0,00 %
Golden Entertainment, Inc.	2.465	80.482	0,01 %	GAMCO Investors, Inc. Klasse A	2.200	65.230	0,00 %
NVE Corp.	934	80.324	0,01 %	Akcea Therapeutics, Inc.	3.755	65.187	0,00 %
Keryx Biopharmaceuticals, Inc.	17.262	80.268	0,01 %	Capital Senior Living Corp.	4.763	64.253	0,00 %
VASCO Data Security International, Inc.	5.768	80.175	0,01 %	Armstrong Flooring, Inc.	3.794	64.194	0,00 %
Veritiv Corp.					2.219	64.129	0,00 %
Biohaven Pharmaceutical Holding Co., Ltd.	18.064	79.662	0,01 %		2.349	63.376	0,00 %
Cara Therapeutics, Inc.	14.735	79.569	0,01 %		5.136	62.865	0,00 %
Lands' End, Inc.	1.144	79.336	0,01 %		3.154	61.661	0,00 %
FB Financial Corp.	3.379	79.305	0,01 %		1.464	61.473	0,00 %
Vera Bradley, Inc.	3.928	79.149	0,01 %		5.024	61.192	0,00 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Geron Corp.	33.938	61.088	0,00 %	Surgery Partners, Inc.	3.668	44.383	0,00 %
Superior Industries International, Inc.	4.113	61.078	0,00 %	Omega Flex, Inc.	621	44.346	0,00 %
GP Strategies Corp.	2.622	60.830	0,00 %	Hemisphere Media Group, Inc. Klasse A	3.824	44.167	0,00 %
tronc, Inc.	3.452	60.721	0,00 %	Eclipse Resources Corp.	18.169	43.606	0,00 %
Rockwell Medical, Inc.	10.433	60.720	0,00 %	BioTime, Inc.	20.147	43.316	0,00 %
Duluth Holdings, Inc. Klasse B	3.401	60.708	0,00 %	Insys Therapeutics, Inc.	4.500	43.290	0,00 %
On Deck Capital, Inc.	10.498	60.259	0,00 %	GenMark Diagnostics, Inc.	10.278	42.859	0,00 %
ServiceSource International, Inc.	19.289	59.603	0,00 %	Midstates Petroleum Co., Inc.	2.573	42.660	0,00 %
HSN, Inc.	1.477	59.597	0,00 %	Speedway Motorsports, Inc.	2.202	41.552	0,00 %
GNC Holdings, Inc. Klasse A	16.150	59.593	0,00 %	NCS Multistage Holdings, Inc.	2.805	41.346	0,00 %
Landec Corp.	4.727	59.560	0,00 %	Lindblad Expeditions Holdings, Inc.	4.074	39.884	0,00 %
Aceto Corp.	5.712	59.005	0,00 %	Myovant Sciences Ltd.	3.154	39.867	0,00 %
Xenith Bankshares, Inc.	1.742	58.932	0,00 %	Quantenna Communications, Inc.	3.217	39.247	0,00 %
Natural Gas Services Group, Inc.	2.244	58.793	0,00 %	American Renal Associates Holdings, Inc.	2.253	39.202	0,00 %
Achillion Pharmaceuticals, Inc.	20.396	58.740	0,00 %	Universal Logistics Holdings, Inc.	1.644	39.045	0,00 %
pdvWireless, Inc.	1.824	58.550	0,00 %	Minerva Neurosciences, Inc.	6.363	38.496	0,00 %
Resource Capital Corp. REIT	6.163	57.747	0,00 %	Ryerson Holding Corp.	3.662	38.085	0,00 %
Nexeo Solutions, Inc.	6.329	57.594	0,00 %	Bellicum Pharmaceuticals, Inc.	4.525	38.055	0,00 %
Gener8 Maritime, Inc.	8.686	57.501	0,00 %	Dyax Corp.	18.309	36.618	0,00 %
Achaogen, Inc.	5.327	57.212	0,00 %	United States Lime & Minerals, Inc.	454	35.003	0,00 %
PC Connection, Inc.	2.155	56.483	0,00 %	Seneca Foods Corp. Klasse A	1.137	34.963	0,00 %
Castlight Health, Inc. Klasse B	15.052	56.445	0,00 %	Habit Restaurants, Inc. Klasse A	3.660	34.953	0,00 %
El Pollo Loco Holdings, Inc.	5.644	55.876	0,00 %	NewLink Genetics Corp.	4.301	34.881	0,00 %
HarborOne Bancorp, Inc.	2.882	55.219	0,00 %	Mammoth Energy Services, Inc.	1.652	32.429	0,00 %
International Seaways, Inc.	2.973	54.882	0,00 %	Axovant Sciences Ltd.	6.142	32.368	0,00 %
Calithera Biosciences, Inc.	6.451	53.866	0,00 %	Associated Capital Group, Inc. Klasse A	922	31.440	0,00 %
Arlington Asset Investment Corp. Klasse A	4.559	53.705	0,00 %	Hamilton Beach Brands Holding Co. Klasse A	1.222	31.393	0,00 %
Potbelly Corp.	4.349	53.493	0,00 %	FTD Cos, Inc.	4.207	30.248	0,00 %
Sutherland Asset Management Corp. REIT	3.465	52.495	0,00 %	Spark Energy, Inc. Klasse A	2.372	29.413	0,00 %
Pacific Biosciences of California, Inc.	19.870	52.457	0,00 %	Diebold Nixdorf, Inc.	1.745	28.958	0,00 %
Aduro Biotech, Inc.	6.934	52.005	0,00 %	Pzena Investment Management, Inc. Klasse A	2.704	28.852	0,00 %
ChannelAdvisor Corp.	5.763	51.867	0,00 %	Village Super Market, Inc. Klasse A	1.235	28.319	0,00 %
Jounce Therapeutics, Inc.	4.056	51.714	0,00 %	Teligent, Inc.	7.534	27.348	0,00 %
AquaVenture Holdings Ltd.	3.295	51.138	0,00 %	Escrow Winthrop Realty Trust	3.887	26.030	0,00 %
Liberty Media Corp.-Liberty Braves Klasse A	2.276	50.186	0,00 %	MobileIron, Inc.	6.655	25.955	0,00 %
IDT Corp.Klasse B	4.660	49.396	0,00 %	Crawford & Co. Klasse A	3.033	25.780	0,00 %
Civitas Solutions, Inc.	2.885	49.333	0,00 %	Rush Enterprises, Inc. Klasse B	522	25.166	0,00 %
Sun Bancorp, Inc.	2.029	49.305	0,00 %	AgroFresh Solutions, Inc.	3.269	24.191	0,00 %
Forestar Group, Inc.	2.224	48.928	0,00 %	Green Brick Partners, Inc.	2.127	24.035	0,00 %
Foundation Building Materials, Inc.	3.288	48.630	0,00 %	Herbalife Ltd.	2.216	21.495	0,00 %
Smart & Final Stores, Inc.	5.674	48.513	0,00 %	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. Klasse A	4.651	21.395	0,00 %
Bojangles', Inc.	4.081	48.156	0,00 %	Sears Holdings Corp.	5.899	21.118	0,00 %
HCI Group, Inc.	1.582	47.302	0,00 %	Ra Pharmaceuticals, Inc.	1.611	13.694	0,00 %
KeyW Holding Corp.	7.979	46.837	0,00 %	Iconix Brand Group, Inc.	9.147	11.800	0,00 %
Ashford Hospitality Prime, Inc. REIT	4.740	46.120	0,00 %	NewStar Financial, Inc.	4.182	2.258	0,00 %
Baldwin & Lyons, Inc. Klasse B	1.908	45.697	0,00 %	Media General, Inc. CVR	15.608	606	0,00 %
RigNet, Inc.	3.009	44.985	0,00 %	Invitation Homes, Inc. REIT	1	24	0,00 %
Roadrunner Transportation Systems, Inc.	5.829	44.942	0,00 %				
G1 Therapeutics, Inc.	2.265	44.938	0,00 %			779.846.997	54,18 %
Seres Therapeutics, Inc.	4.407	44.687	0,00 %			1.425.100.028	99,01 %
				Summe Aktien			

	Kapital US-Dollar (\$)	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Optionsscheine 0,00 % (2016: 0,00 %)				
Australien 0,00 % (2016: 0,00 %)				
Westgold Resources Ltd.	6.857	30.06.2019	1.207	0,00 %
			1.207	0,00 %
Kanada 0,00 % (2016: 0,00 %)				
Osisko Gold Royalties Ltd.	463	26.02.2019	521	0,00 %
			521	0,00 %
Singapur 0,00 % (2016: 0,00 %)				
Ezion Holdings Ltd.	38.803	24.04.2020	595	0,00 %
			595	0,00 %
Spanien 0,00 % (2016: 0,00 %)				
Abengoa SA	143.586	31.12.2049	1.690	0,00 %
			1.690	0,00 %
Summe Optionsscheine			4.013	0,00 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte			1.425.104.041	99,01 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures 0,00 % (2016: (0,01 %))				
FTSE 100 Index März 2018	13	1.317.297	25.903	0,00 %
Russell 2000 E-Mini März 2018	129	9.902.351	8.074	0,00 %
Topix Index März 2018	10	1.613.138	(178)	(0,00 %)
SPI 200 März 2018	5	589.358	(790)	(0,00 %)
Euro Stoxx 50 März 2018	32	1.363.405	(21.199)	(0,00 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente			11.810	0,00 %

	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva	14.265.216	0,99 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	1.439.381.067	100,00 %

REIT – Real Estate Investment Trust.

Analyse des Gesamtvermögens	US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	1.398.097.397	97,13 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	26.838.410	1,87 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	168.234	0,01 %
(d) Derivative Finanzinstrumente	11.810	0,00 %
(e) Sonstige Aktiva und Passiva	14.265.216	0,99 %
Gesamtnettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	1.439.381.067	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Anteile	Kosten US-Dollar (\$)		Anteile	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
Liberty Media Corp. - Liberty Formula One Klasse A	37.631	1.318.450	Wirecard AG	27.201	2.841.211
Bioerativ, Inc.	26.641	1.255.295	Alnylam Pharmaceuticals, Inc.	21.232	2.725.986
Foot Locker, Inc.	28.010	1.203.881	Cognex Corp.	20.037	2.721.548
DexCom, Inc.	19.596	1.144.485	Take-Two Interactive Software, Inc.	23.381	2.592.909
Delphi Technologies plc	19.697	1.112.881	Spirit AeroSystems Holdings, Inc. Klasse A	29.299	2.387.804
US Foods Holding Corp.	38.842	1.090.407	Owens Corning	26.348	2.282.681
Calpine Corp.	82.941	1.085.840	Chemours Co.	42.415	2.162.596
Valvoline, Inc.	46.182	1.063.294	IAC/InterActiveCorp	16.949	2.128.313
MEDNAX, Inc.	20.785	1.034.885	MTU Aero Engines AG	11.938	2.128.294
Svenska Cellulosa AB SCA Klasse B	138.646	1.019.930	Advanced Micro Devices, Inc.	143.114	2.067.292
Murphy Oil Corp.	36.489	1.019.868	Teleperformance	13.512	1.988.808
Park Hotels & Resorts, Inc. REIT	35.285	1.018.659	IPG Photonics Corp.	8.723	1.956.645
Nuance Communications, Inc.	65.001	1.010.116	TransUnion	35.452	1.942.131
Core Laboratories NV	9.733	980.600	Old Dominion Freight Line, Inc.	15.186	1.936.349
Tate & Lyle plc	103.831	945.907	Square, Inc. Klasse A	48.578	1.886.407
Dun & Bradstreet Corp.	8.713	927.413	SVB Financial Group	10.882	1.859.896
Edgewell Personal Care Co.	12.454	909.308	Clariant AG	68.755	1.857.737
LogMeIn, Inc.	8.305	894.116	Cboe Global Markets Inc.	20.996	1.810.156
Ashland Global Holdings, Inc.	13.863	879.295	Vail Resorts, Inc.	8.290	1.765.973
Scout24 AG	20.634	863.030	NVR, Inc.	776	1.756.547
			Steel Dynamics, Inc.	50.898	1.734.366
			Zions Bancorporation	42.822	1.719.924

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.425.104.041	915.516.275
Derivative Finanzinstrumente	33.977	19.105
Barmittel	10.880.769	8.024.272
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	1.976.385	1.291.101
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	6.699.716	4.124.337
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	1.281.422	360.847
Bareinschüsse für Futures	788.302	638.923
Summe Umlaufvermögen	1.446.764.612	929.974.860
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	22.167	90.453
Überziehungskredit	47.071	5.132
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	15.577	11.631
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	5.777.508	591.838
Zahlbare Dividenden	414.730	436.621
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	678.535	1.602.980
Zahlbare Verwaltungsgebühren	427.957	282.187
Summe kurzfristige Passiva	7.383.545	3.020.842
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken) („Nettovermögen“)	1.439.381.067	926.954.018

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	169.616.234	153.218.542	85.938.112
Nettovermögen	141.252.694	145.265.271	79.110.846
Anzahl der umlaufenden Anteile	698.417	772.059	487.160
Nettoinventarwert je Anteil	202,25	188,15	162,39
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	158.837.168	98.579.190	90.619.493
Anzahl der umlaufenden Anteile	628.630	477.442	493.779
Nettoinventarwert je Anteil	252,67	206,47	183,52
EUR-Anlegeranteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	64.385.642	38.759.875	26.048.951
Nettovermögen	53.618.956	36.747.927	23.979.519
Anzahl der umlaufenden Anteile	255.004	187.822	141.985
Nettoinventarwert je Anteil	210,27	195,65	168,89
USD-Anlegeranteile (\$)			
Nettovermögen	30.852.587	5.408.488	2.621.646
Anzahl der umlaufenden Anteile	228.424	48.993	26.713
Nettoinventarwert je Anteil	135,07	110,39	98,14
Thesaurierende GBP-Anteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	463.466.884	305.822.614	243.639.449
Nettovermögen	342.610.904	247.499.394	165.302.566
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.216.190	982.074	880.234
Nettoinventarwert je Anteil	281,71	252,02	187,79
Ausschüttende GBP-Anteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	160.442.746	154.439.485	115.960.009
Nettovermögen	118.604.880	124.986.437	78.675.629
Anzahl der umlaufenden Anteile	469.735	546.013	454.501
Nettoinventarwert je Anteil	252,49	228,91	173,10
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	361.398.480	153.545.880	59.707.750
Nettovermögen	300.964.759	145.575.618	54.964.328
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.832.849	953.712	417.536
Nettoinventarwert je Anteil	164,21	152,64	131,64
Institutionelle Plus USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	9.710	571.751	7.041
Anzahl der umlaufenden Anteile	72	5.170	72
Nettoinventarwert je Anteil	134,86	110,59	98,21
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	8.282.674	3.146.042	7.961
Nettovermögen	6.122.842	2.546.063	5.401
Anzahl der umlaufenden Anteile	37.722	17.548	50
Nettoinventarwert je Anteil	162,31	145,09	108,03
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	22.088.942	13.462.151	92.424
Nettovermögen	16.328.917	10.894.793	62.707
Anzahl der umlaufenden Anteile	105.572	77.697	591
Nettoinventarwert je Anteil	154,67	140,22	106,03

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	60.620	66.621
Dividenden	23.583.250	16.231.153
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	962.164	629.368
Verschiedene Erträge	28.366	27.879
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	224.994.902	83.385.641
Summe Anlageerträge/(-verluste)	249.629.302	100.340.662
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	4.281.616	2.718.921
Transaktionsgebühren und Provisionen	299.234	151.207
Sonstige Aufwendungen	4.686	243
Summe Aufwendungen	4.585.536	2.870.371
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	15.709	3.814
Ausgezahlte Ausschüttungen	2.164.610	1.982.822
Ertragsausgleich	18.762	(56.956)
Summe Finanzierungskosten	2.199.081	1.929.680
Nettoanlageerträge/(-verluste)	242.844.685	95.540.611
Ausländische Quellensteuer	(4.191.552)	(3.422.226)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	238.653.133	92.118.385

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	238.653.133	92.118.385
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	623.709.386	348.052.820
Rücknahmen	(349.953.164)	(137.865.834)
Reinvestitionen	17.694	5.811
Summe Kapitalgeschäfte ¹	273.773.916	210.192.797
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	512.427.049	302.311.182
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	926.954.018	624.642.836
Zum Jahresende	1.439.381.067	926.954.018

¹ Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Global Stock Index Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Asset Management, Limited.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Anlageziel

Der Fonds strebt langfristiges Kapitalwachstum durch Nachbildung der Performance des MSCI World Index an, einem nach Marktkapitalisierung gewichteten Index, der sich aus Stammaktien von in Industrieländern ansässigen Unternehmen zusammensetzt.

Portfoliomerkmale

	Fonds	MSCI World Index
Anzahl der Aktien	1.670	1.652
Mittlere Marktkapitalisierung		
US-Dollar	\$ 59,6 Mrd.	\$ 59,7 Mrd.
Euro	€ 49,6 Mrd.	€ 49,7 Mrd.
Kurs/Gewinn-Verhältnis	20,1x	20,1x
Kurs/Buch-Verhältnis	2,4x	2,4x
Rendite	2,2 %	2,2 %
Eigenkapitalrendite	13,7 %	13,7 %
Ertragszuwachsrate	7,9 %	7,9 %
Portfolioumschlag ¹	-34 %	—
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,25 %	
Anlegeranteile	0,30 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,15 %	
Kurzfristige Reserven	0,0 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	MSCI World Index
R ²	1,00	1,00
Beta	1,00	1,00

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI World Index
Europa		
Vereinigtes Königreich	6,6 %	6,6 %
Frankreich	4,0	4,0
Deutschland	3,7	3,7
Schweiz	3,0	3,0
Niederlande	1,3	1,3
Spanien	1,2	1,2
Schweden	1,0	1,0
Sonstige	2,8	2,8
Zwischensumme	23,6 %	23,6 %
Pazifik		
Japan	8,9 %	8,9 %
Australien	2,6	2,6
Hongkong	1,3	1,3
Sonstige	0,6	0,6
Zwischensumme	13,4 %	13,4 %
Nordamerika		
USA	59,2 %	59,3 %
Kanada	3,6	3,5
Zwischensumme	62,8 %	62,8 %
Naher Osten		
	0,2 %	0,2 %

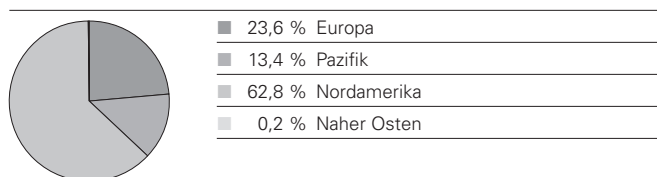
Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI World Index
Luxusgüter	12,3 %	12,3 %
Grundbedarfsgüter	9,0	9,0
Energie	6,3	6,3
Finanzwerte	18,1	18,1
Gesundheitswesen	11,7	11,8
Industriegüter	11,7	11,6
Informationstechnologie	16,8	16,8
Grundstoffe	5,2	5,2
Immobilien	3,1	3,1
Telekommunikationsdienste	2,8	2,8
Versorger	3,0	3,0

Die 10 grössten Positionen² (% des Gesamtvermögens)

Apple Inc.	Technologie-Hardware, Speicher und Peripheriegeräte	2,1 %
Alphabet Inc.	Internetsoftware und -dienste	1,6
Microsoft Corp.	Systemsoftware	1,5
Amazon.com Inc.	Online- und Direkt-Marketing Einzelhandel	1,2
Facebook Inc.	Internetsoftware und -dienste	1,0
JPMorgan Chase & Co.	Diversifizierte Banken	0,9
Johnson & Johnson	Pharma	0,9
Exxon Mobil Corp.	Integrierter Öl- und Gaskonzern	0,9
Bank of America Corp.	Diversifizierte Banken	0,7
Wells Fargo & Co.	Diversifizierte Banken	0,7
Zehn grösste Positionen		11,5 %

Allokation nach Region (% des Portfolios)



Anlagefokus

Stil	Wert	Mischung	Wachstum
Marktkapitalisierung	Gross		
	Mittel		
	Klein		

1 Ein negativer Portfolioumschlag deutet darauf hin, dass der Gesamtwert der Zeichnungen und Rückkäufe über dem Wert der Wertpapiertransaktionen gelegen hat.

2 Die aufgeführten Positionen schliessen etwaige vorübergehende Baranlagen und Aktienindexprodukte aus.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

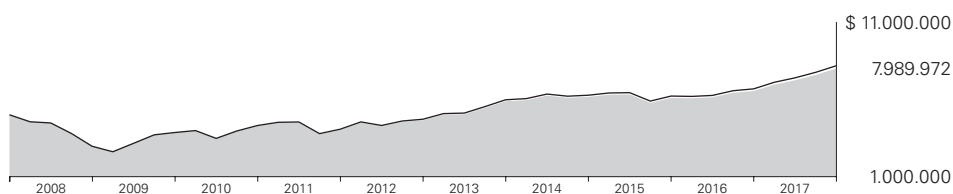
Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

Global Stock Index Fund
Benchmark: MSCI World Index

In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000



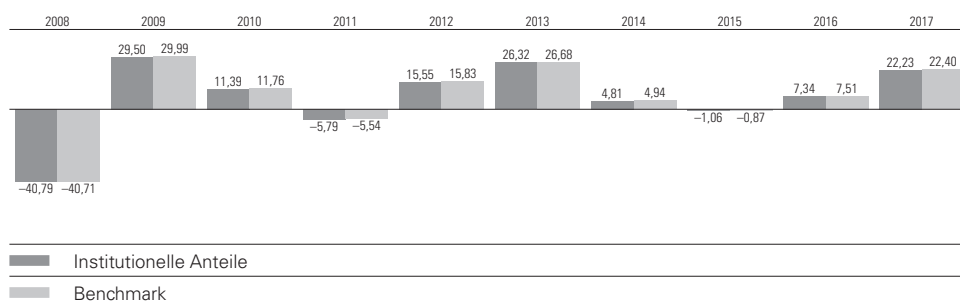
	Durchschnittliche jährliche Gesamrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
— Institutionelle Anteile	22,23 %	11,44 %	4,80 %	\$ 7.989.972
— Benchmark	22,40	11,64	5,03	8.170.443

	Durchschnittliche jährliche Gesamrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Anlegeranteile	22,17 %	11,38 %	4,72 %	\$ 158.563
Benchmark	22,40	11,64	5,03	163.409

	Durchschnittliche jährliche Gesamrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹		
Institutionelle Plus-Anteile	22,35 %	8,75 %		\$ 280.537.800
Benchmark	22,40	8,81		281.108.381

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,17 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,23 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,05 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



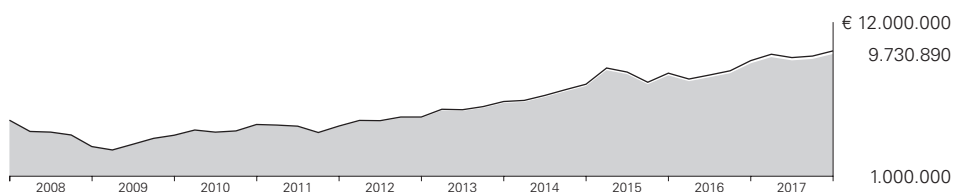
¹ 19. Dezember 2013.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Global Stock Index Fund
Benchmark: MSCI World Index

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



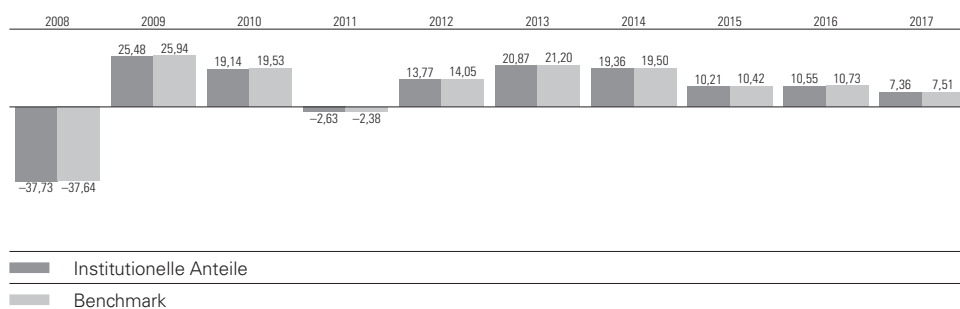
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
— Institutionelle Anteile	7,36 %	13,54 %	6,89 %	€ 9.730.890
— Benchmark	7,51	13,74	7,12	9.948.055

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Anlegeranteile	7,31 %	13,48 %	6,80 %	€ 193.083
Benchmark	7,51	13,74	7,12	198.961

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile	7,47 %	12,32 %	€ 320.917.000
Benchmark	7,51	12,38	321.608.837

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,15 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,20 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,04 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



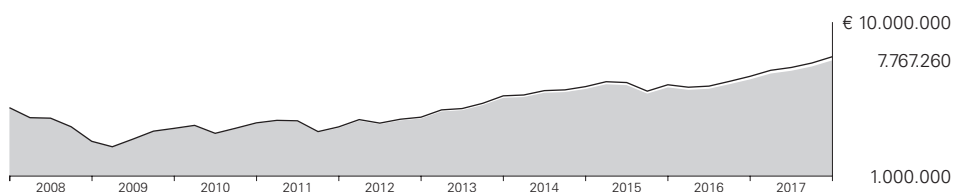
¹ 6. Dezember 2013.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Global Stock Index Fund
 Benchmark: MSCI World Index Euro-Hedged

Abgesichert in Euro

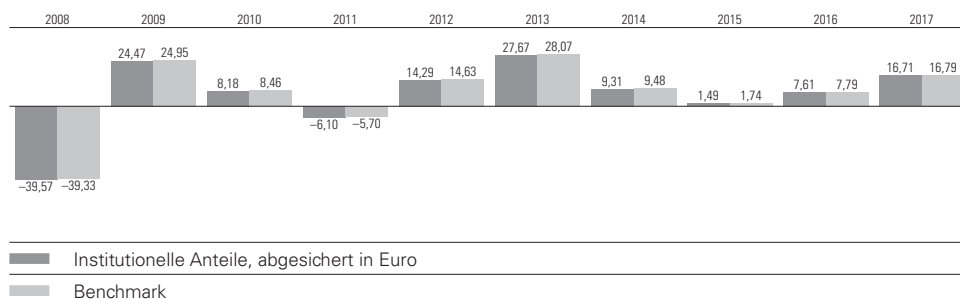
Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtrrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
— Institutionelle Anteile, abgesichert in Euro	16,71 %	12,21 %	4,50 %	€ 7.767.260
— Benchmark	16,79	12,42	4,79	7.980.089

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,08 Prozentpunkte für institutionelle in Euro abgesicherte Anteile.¹

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



¹ Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

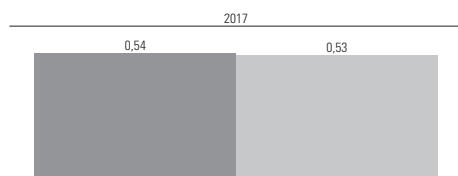
Global Stock Index Fund
 Benchmark: MSCI World Index

In GBP

	Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017 Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von £ 20.000.000
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile	0,54 %	£ 201.075.108
Benchmark	0,53	201.058.710

Der Tracking-Unterschied für den Zeitraum betrug 0,01 Prozentpunkte für die Institutionellen Plus-GBP-Thesaurierungsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 14. Dezember 2017–31. Dezember 2017



	Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile
	Benchmark

¹ 14. Dezember 2017.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	223.361	4.595.751	0,04 %	Turquoise Hill Resources Ltd.	259.674	889.103	0,01 %
National Bank of Canada	91.166	4.563.575	0,04 %	IGM Financial, Inc.	24.221	853.472	0,01 %
Barrick Gold Corp.	308.494	4.476.173	0,04 %	RioCan REIT	43.487	845.479	0,01 %
Agrium, Inc.	36.700	4.234.874	0,04 %	Element Fleet Management Corp.	102.331	775.884	0,01 %
Fortis, Inc.	112.030	4.122.833	0,04 %	Linamar Corp.	12.564	734.116	0,01 %
Franco-Nevada Corp.	51.211	4.106.035	0,04 %	Atco Ltd. Klasse I	18.581	667.341	0,01 %
Fairfax Financial Holdings Ltd.	7641	4.081.908	0,04 %	Emera, Inc.	17.313	649.160	0,01 %
Teck Resources Ltd. Klasse B	150.280	3.942.459	0,04 %	First Capital Realty, Inc.	37.358	617.788	0,01 %
Restaurant Brands International, Inc.	60.323	3.720.147	0,03 %	H&R REIT	36.060	614.742	0,01 %
Dollarama, Inc.	28.759	3.604.773	0,03 %	Jean Coutu Group PJC, Inc. Klasse A	21.060	410.459	0,00 %
Encana Corp.	254.436	3.405.476	0,03 %	SmartCentres REIT	16.174	399.009	0,00 %
Thomson Reuters Corp.	76.675	3.352.906	0,03 %	Kinross Gold Corp.	18.800	81.216	0,00 %
Constellation Software, Inc.	5.388	3.276.878	0,03 %			388.581.632	3,56 %
Intact Financial Corp.	38.725	3.244.932	0,03 %	China 0,01 % (2016: 0,00 %)			
Loblaw Cos., Ltd.	59.086	3.217.085	0,03 %	Mint Group Ltd.	186.000	1.121.858	0,01 %
CGI Group, Inc. Klasse A	55.700	3.036.282	0,03 %			1.121.858	0,01 %
Goldcorp, Inc.	225.853	2.889.520	0,03 %	Dänemark 0,67 % (2016: 0,59 %)			
Agnico Eagle Mines Ltd.	61.850	2.865.058	0,03 %	Novo Nordisk A/S Klasse B	496.895	26.806.557	0,25 %
Shaw Communications, Inc. Klasse B	115.101	2.635.578	0,02 %	Danske Bank A/S	198.627	7.739.546	0,07 %
Cenovus Energy, Inc.	284.205	2.603.993	0,02 %	DSV A/S	51.326	4.044.559	0,04 %
First Quantum Minerals Ltd.	183.412	2.577.825	0,02 %	Vestas Wind Systems A/S	57.103	3.949.062	0,04 %
Wheaton Precious Metals Corp.	115.897	2.570.556	0,02 %	Novozymes A/S Klasse B	60.738	3.472.618	0,03 %
Open Text Corp.	69.318	2.473.529	0,02 %	Carlsberg A/S Klasse B	28.144	3.381.601	0,03 %
Imperial Oil Ltd.	77.119	2.414.604	0,02 %	Pandora A/S	27.969	3.047.071	0,03 %
Power Corp. of Canada	91.523	2.364.499	0,02 %	AP Moller-Maersk A/S Klasse B	1.733	3.029.759	0,03 %
Canadian Tire Corp., Ltd. Klasse A	17.465	2.284.619	0,02 %	Orsted A/S	50.566	2.762.193	0,02 %
Great-West Lifeco, Inc.	78.736	2.205.701	0,02 %	Genmab A/S	15.351	2.547.607	0,02 %
Shopify, Inc. Klasse A	21.324	2.163.290	0,02 %	Coloplast A/S Klasse B	31.326	2.493.288	0,02 %
SNC-Lavalin Group Inc.	47.079	2.143.627	0,02 %	Chr Hansen Holding A/S	26.534	2.490.612	0,02 %
Inter Pipeline Ltd.	100.597	2.089.900	0,02 %	ISS A/S	45.936	1.780.276	0,02 %
BCE, Inc.	42.128	2.030.160	0,02 %	AP Moller-Maersk A/S Klasse A	1.013	1.692.581	0,01 %
Gildan Activewear, Inc. Klasse A	62.295	2.019.075	0,02 %	TDC A/S	211.671	1.301.693	0,01 %
Saputo, Inc.	55.904	2.015.837	0,02 %	H Lundbeck A/S	18.055	917.251	0,01 %
Power Financial Corp.	70.241	1.936.330	0,02 %	Tryg A/S	32.942	824.560	0,01 %
TELUS Corp.	50.840	1.932.241	0,02 %	William Demant Holding A/S	29.152	815.733	0,01 %
Metro, Inc.	59.232	1.902.780	0,02 %			73.096.567	0,67 %
Valeant Pharmaceuticals International, Inc.	85.079	1.779.057	0,02 %	Finnland 0,34 % (2016: 0,35 %)			
CCL Industries, Inc. Klasse B	36.475	1.690.784	0,02 %	Nokia OYJ	1.555.802	7.274.798	0,07 %
CI Financial Corp.	67.866	1.612.491	0,01 %	Sampo OYJ Klasse A	120.360	6.619.395	0,06 %
BlackBerry Ltd.	142.058	1.591.839	0,01 %	Kone OYJ Klasse B	91.648	4.928.080	0,05 %
Onex Corp.	21.320	1.568.691	0,01 %	UPM-Kymmene OYJ	142.903	4.446.102	0,04 %
PrairieSky Royalty Ltd.	59.319	1.517.832	0,01 %	Wartsila OYJ Abp	39.375	2.487.007	0,02 %
Keyera Corp.	51.323	1.450.864	0,01 %	Fortum OYJ	115.118	2.280.856	0,02 %
Hydro One Ltd.	79.854	1.427.614	0,01 %	Stora Enso OYJ Klasse R	141.308	2.243.205	0,02 %
Methanex Corp.	23.367	1.420.353	0,01 %	Neste OYJ	34.207	2.191.392	0,02 %
Industrial Alliance Insurance & Financial Services, Inc.	29.114	1.389.999	0,01 %	Elisa OYJ	37.775	1.484.186	0,01 %
Husky Energy, Inc.	93.304	1.321.797	0,01 %	Nokian Renkaat OYJ	32.469	1.473.776	0,01 %
Kinross Gold Corp. - CAD	296.291	1.281.693	0,01 %	Orion OYJ Klasse B	28.984	1.081.708	0,01 %
CAE, Inc.	67.899	1.265.367	0,01 %	Metso OYJ	28.343	968.956	0,01 %
Bombardier, Inc.	522.858	1.264.424	0,01 %			37.479.461	0,34 %
West Fraser Timber Co., Ltd.	19.340	1.197.337	0,01 %	Frankreich 3,91 % (2016: 3,64 %)			
Vermilion Energy, Inc.	31.095	1.133.660	0,01 %	Total SA	633.476	35.025.417	0,32 %
George Weston Ltd.	12.822	1.117.083	0,01 %	Sanofi	302.068	26.061.666	0,24 %
Lundin Mining Corp.	165.956	1.107.300	0,01 %	BNP Paribas SA	298.641	22.323.355	0,20 %
Tourmaline Oil Corp.	60.277	1.095.902	0,01 %	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	74.619	21.988.452	0,20 %
Crescent Point Energy Corp.	142.711	1.091.162	0,01 %	Airbus SE	155.732	15.521.248	0,14 %
Finning International, Inc.	42.517	1.076.371	0,01 %	AXA SA	517.301	15.364.765	0,14 %
ARC Resources Ltd.	90.703	1.067.775	0,01 %	Vinci SA	135.084	13.812.085	0,13 %
AltaGas Ltd.	43.142	985.454	0,01 %	Danone SA	161.569	13.571.143	0,12 %
Empire Co., Ltd.	49.911	975.554	0,01 %	Schneider Electric SE	152.224	12.952.540	0,12 %
Canadian Utilities Ltd. Klasse A	32.321	965.025	0,01 %	Societe Generale SA	205.810	10.639.233	0,10 %
Cameco Corp.	100.034	926.928	0,01 %	Kering	20.328	9.593.076	0,09 %
Seven Generations Energy Ltd. Klasse A	64.113	909.796	0,01 %	Safran SA	89.669	9.250.319	0,08 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens
Orange SA	527.804	9.174.067	0,08 %	Eurazeo SA	10.969	1.014.211	0,01 %
Pernod Ricard SA	56.677	8.980.219	0,08 %	Fonciere Des Regions REIT	8.875	1.006.883	0,01 %
L'Oreal SA (Prime De Fidelite)	36.286	8.058.684	0,07 %	CNP Assurances	42.658	986.313	0,01 %
Essilor International Cie Generale d'Optique SA	55.730	7.692.521	0,07 %	Imerys SA	9.646	909.722	0,01 %
Air Liquide SA (Prime De Fidelite)	59.962	7.563.849	0,07 %	Casino Guichard Perrachon SA	14.476	878.873	0,01 %
Cie de Saint-Gobain	135.579	7.485.694	0,07 %	JCDecaux SA	21.663	874.165	0,01 %
Vivendi SA	273.241	7.356.177	0,07 %	Remy Cointreau SA	6.232	864.331	0,01 %
L'Oreal SA (XPAR)	31.062	6.898.496	0,06 %	ICADE REIT	8.416	827.979	0,01 %
Unibail-Rodamco SE REIT	26.633	6.715.990	0,06 %	Societe BIC SA	7.374	811.622	0,01 %
Air Liquide SA	53.212	6.712.377	0,06 %	SEB SA	3.242	601.273	0,01 %
Cie Generale des Etablissements Michelin	46.062	6.612.460	0,06 %	Electricite de France SA (Prime De Fidelite)	34.673	433.840	0,00 %
Legrand SA	70.244	5.414.362	0,05 %	SEB SA (XPAR)	2.314	429.163	0,00 %
Renault SA	50.837	5.122.292	0,05 %	Credit Agricole SA	4.308	71.388	0,00 %
Capgemini SE	43.114	5.119.663	0,05 %	Credit Agricole SA Prime	3.477	57.617	0,00 %
Engie SA	288.923	4.973.367	0,05 %			427.103.415	3,91 %
Valeo SA	63.621	4.757.185	0,04 %	Deutschland 3,61 % (2016: 3,37 %)			
Hermes International	8.549	4.581.041	0,04 %	SAP SE	261.050	29.293.663	0,27 %
Publicis Groupe SA	56.343	3.832.751	0,04 %	Siemens AG	203.565	28.391.805	0,26 %
STMicroelectronics NV	170.813	3.734.068	0,03 %	Allianz SE	119.740	27.534.596	0,25 %
Dassault Systemes SE	34.848	3.707.091	0,03 %	Bayer AG	219.840	27.454.323	0,25 %
Atos SE	24.960	3.637.098	0,03 %	BASF SE	243.209	26.792.242	0,25 %
Engie SA (Prime De Fidelite 2019)	195.925	3.372.549	0,03 %	Daimler AG	254.613	21.646.342	0,20 %
Carrefour SA	152.677	3.307.355	0,03 %	Deutsche Telekom AG	893.047	15.865.726	0,15 %
Peugeot SA	159.358	3.244.459	0,03 %	Deutsche Post AG	259.942	12.407.499	0,11 %
Veolia Environnement SA	124.839	3.189.264	0,03 %	Linde AG	49.916	11.667.152	0,11 %
Thales SA	28.441	3.069.577	0,03 %	Deutsche Bank AG	550.801	10.499.754	0,10 %
Bouygues SA	57.500	2.990.382	0,03 %	Adidas AG	50.553	10.146.681	0,09 %
Kleppierre SA REIT	59.317	2.611.569	0,02 %	Volkswagen AG - Vorzugsaktien	48.973	9.788.388	0,09 %
Accor SA	50.429	2.603.871	0,02 %	Bayerische Motoren Werke AG	87.739	9.148.147	0,08 %
Credit Agricole SA (XPAR)	156.668	2.596.152	0,02 %	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen	41.674	9.045.117	0,08 %
Credit Agricole SA (Prime De Fidelite)	140.239	2.323.906	0,02 %	Fresenius SE & Co. KGaA	110.809	8.658.178	0,08 %
Teleperformance	16.085	2.307.161	0,02 %	Infineon Technologies AG	306.370	8.400.747	0,08 %
Arkema SA	18.670	2.276.643	0,02 %	Continental AG	29.291	7.915.601	0,07 %
Gecina SA REIT	11.659	2.154.620	0,02 %	Vonovia SE	130.463	6.484.156	0,06 %
Eiffage SA	19.485	2.137.136	0,02 %	E.ON SE	583.584	6.349.656	0,06 %
Natixis SA	257.893	2.042.635	0,02 %	Henkel AG & Co. KGaA - Vorzugsaktien	47.514	6.295.998	0,06 %
Bureau Veritas SA	73.097	2.000.389	0,02 %	Deutsche Börse AG	51.964	6.040.162	0,06 %
SCOR SE	46.848	1.887.077	0,02 %	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA	57.104	6.019.117	0,06 %
TechnipFMC plc	59.498	1.862.882	0,02 %	HeidelbergCement AG	39.908	4.324.918	0,04 %
Eurofins Scientific SE	3.026	1.844.426	0,02 %	Commerzbank AG	282.497	4.241.976	0,04 %
TechnipFMC plc (XPAR)	57.636	1.789.061	0,02 %	Deutsche Wohnen SE	95.755	4.192.266	0,04 %
Alstom SA	42.736	1.775.838	0,02 %	Merck KGaA	34.386	3.705.841	0,03 %
Suez	100.612	1.771.750	0,02 %	Wirecard AG	32.003	3.576.606	0,03 %
Ingenico Group SA	16.431	1.756.198	0,02 %	Porsche Automobil Holding SE - Vorzugsaktien	41.637	3.488.840	0,03 %
Edenred	60.104	1.745.140	0,02 %	Covestro AG	32.976	3.406.580	0,03 %
Iliad SA	7.069	1.695.569	0,02 %	thyssenkrupp AG	115.729	3.365.095	0,03 %
Sodexo SA (Prime De Fidelite)	12.295	1.654.288	0,02 %	Henkel AG & Co. KGaA	27.307	3.279.025	0,03 %
Zodiac Aerospace	55.257	1.654.170	0,02 %	Beiersdorf AG	27.215	3.199.350	0,03 %
Faurecia	21.070	1.647.845	0,02 %	RWE AG	137.184	2.800.419	0,03 %
Aeroports de Paris	8.288	1.577.428	0,01 %	Symrise AG	32.396	2.786.098	0,03 %
Sodexo SA	11.677	1.571.136	0,01 %	Brenntag AG	42.632	2.701.429	0,02 %
Getlink SE	118.591	1.526.572	0,01 %	MTU Aero Engines AG	14.356	2.575.459	0,02 %
Electricite de France SA (XPAR)	121.847	1.524.591	0,01 %	Deutsche Lufthansa AG	64.287	2.371.456	0,02 %
SES SA Klasse A	96.699	1.510.671	0,01 %	OSRAM Licht AG	26.218	2.358.989	0,02 %
Rexel SA	79.365	1.440.959	0,01 %	GEA Group AG	47.709	2.292.132	0,02 %
Amundi SA	16.615	1.409.559	0,01 %	United Internet AG	32.144	2.213.239	0,02 %
Ubisoft Entertainment SA	16.149	1.243.785	0,01 %	ProSiebenSat.1 Media SE	60.844	2.097.230	0,02 %
Wendel SA	7.113	1.233.362	0,01 %	Hannover Rueck SE	16.601	2.091.127	0,02 %
Bollere SA	219.828	1.195.254	0,01 %	LANXESS AG	25.284	2.012.632	0,02 %
Ipsen SA	9.825	1.174.713	0,01 %	Volkswagen AG	9.121	1.847.686	0,02 %
Eutelsat Communications SA	49.073	1.136.994	0,01 %	QIAGEN NV	56.875	1.788.659	0,02 %
Dassault Aviation SA	709	1.104.989	0,01 %				
Lagardere SCA	33.843	1.086.272	0,01 %				
BioMerieux	11.764	1.055.087	0,01 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Evonik Industries AG	43.880	1.652.920	0,01 %	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd.	183.992	722.571	0,01 %
Uniper SE	51.320	1.602.251	0,01 %	Kerry Properties Ltd.	158.532	712.829	0,01 %
KION Group AG	18.518	1.600.577	0,01 %	NWS Holdings Ltd.	378.948	683.505	0,01 %
Zalando SE	29.438	1.559.428	0,01 %	Shangri-La Asia Ltd.	296.360	672.537	0,01 %
Innogy SE	36.926	1.448.834	0,01 %	PCCW Ltd.	1.106.958	642.880	0,01 %
Bayerische Motoren Werke AG - Vorzugsaktien	15.799	1.416.028	0,01 %	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd.	671.296	613.993	0,00 %
HUGO BOSS AG	16.578	1.412.193	0,01 %	SJM Holdings Ltd.	491.228	439.870	0,00 %
K+S AG	52.001	1.296.000	0,01 %	First Pacific Co., Ltd.	593.587	402.442	0,00 %
Drillisch AG	14.815	1.224.476	0,01 %			142.220.117	1,30 %
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	10.377	1.144.640	0,01 %	Irland 0,11 % (2016: 0,09 %)			
Telefonica Deutschland Holding AG	205.671	1.033.815	0,01 %	Kerry Group plc Klasse A	42.489	4.770.444	0,04 %
MAN SE	8.644	990.225	0,01 %	Paddy Power Betfair plc	21.992	2.619.673	0,03 %
Axel Springer SE	12.455	974.082	0,01 %	Bank of Ireland Group plc	249.546	2.126.051	0,02 %
METRO AG	48.513	969.936	0,01 %	AIB Group plc	206.711	1.365.202	0,01 %
Fuchs Petrolub SE - Vorzugsaktien	17.388	923.918	0,01 %	Ryanair Holdings plc	43.556	787.146	0,01 %
Hochtief AG	5.160	914.548	0,01 %			11.668.516	0,11 %
RTL Group SA	9.615	774.370	0,01 %	Israel 0,14 % (2016: 0,19 %)			
Schaeffler AG - Vorzugsaktien	40.967	727.321	0,01 %	Teva Pharmaceutical Industries Ltd. ADR	245.739	4.656.754	0,04 %
		394.227.664	3,61 %	Bank Leumi Le-Israel BM	392.153	2.368.744	0,02 %
Hongkong 1,30 % (2016: 1,17 %)				Bank Hapoalim BM	292.922	2.159.168	0,02 %
AIA Group Ltd.	3.214.877	27.409.918	0,25 %	Nice Ltd.	16.156	1.463.587	0,01 %
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	316.638	9.713.046	0,09 %	Fruarom Industries Ltd.	11.119	1.045.714	0,01 %
CK Hutchison Holdings Ltd.	722.069	9.061.309	0,08 %	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp., Ltd.	549.329	832.305	0,01 %
Sun Hung Kai Properties Ltd.	396.133	6.607.875	0,06 %	Elbit Systems Ltd.	5.674	759.987	0,01 %
CK Asset Holdings Ltd.	704.843	6.158.236	0,06 %	Azrieli Group Ltd.	12.520	700.715	0,01 %
Link REIT	601.772	5.577.166	0,05 %	Mizrahi Tefahot Bank Ltd.	35.263	651.598	0,01 %
Hang Seng Bank Ltd.	205.990	5.112.003	0,05 %	Israel Chemicals Ltd.	128.346	521.273	0,00 %
BOC Hong Kong Holdings Ltd.	993.823	5.034.397	0,05 %			15.159.845	0,14 %
Galaxy Entertainment Group Ltd.	621.050	4.981.238	0,05 %	Italien 0,86 % (2016: 0,75 %)			
CLP Holdings Ltd.	433.160	4.430.064	0,04 %	Enel SpA	2.162.613	13.321.921	0,12 %
Hong Kong & China Gas Co., Ltd.	2.256.985	4.423.140	0,04 %	Intesa Sanpaolo SpA	3.590.382	11.942.386	0,11 %
Jardine Matheson Holdings Ltd.	59.666	3.624.710	0,03 %	Eni SpA	676.689	11.213.440	0,10 %
Sands China Ltd.	637.618	3.291.147	0,03 %	UniCredit SpA	536.784	10.042.404	0,09 %
Power Assets Holdings Ltd.	369.449	3.116.826	0,03 %	Assicurazioni Generali SpA	327.728	5.981.744	0,05 %
WH Group Ltd.	2.287.261	2.580.641	0,02 %	Fiat Chrysler Automobiles NV	291.352	5.216.345	0,05 %
Techtronic Industries Co., Ltd.	377.602	2.461.057	0,02 %	Atlantia SpA	118.367	3.740.996	0,03 %
New World Development Co., Ltd.	1.622.389	2.436.499	0,02 %	CNH Industrial NV	271.790	3.645.502	0,03 %
MTR Corp., Ltd.	390.428	2.287.440	0,02 %	Ferrari NV	33.010	3.466.379	0,03 %
Jardine Strategic Holdings Ltd.	57.600	2.279.808	0,02 %	Snam SpA	622.094	3.047.803	0,03 %
Hongkong Land Holdings Ltd.	309.437	2.178.436	0,02 %	Luxottica Group SpA	44.265	2.718.797	0,03 %
Wharf Real Estate Investment Co., Ltd.	322.046	2.142.222	0,02 %	Telecom Italia SpA	3.123.400	2.702.292	0,02 %
Henderson Land Development Co., Ltd.	320.205	2.109.495	0,02 %	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	386.552	2.248.447	0,02 %
Melco Resorts & Entertainment Ltd. ADR	66.139	1.920.677	0,02 %	Tenaris SA	122.622	1.937.738	0,02 %
Wheelock & Co., Ltd.	219.200	1.564.653	0,01 %	EXOR NV	29.337	1.800.144	0,02 %
CK Infrastructure Holdings Ltd.	177.329	1.523.242	0,01 %	Prysmian SpA	54.347	1.774.416	0,02 %
Sino Land Co., Ltd.	795.285	1.407.998	0,01 %	Mediobanca SpA	155.719	1.768.901	0,02 %
Wynn Macau Ltd.	444.327	1.406.764	0,01 %	Leonardo SpA	110.016	1.310.503	0,01 %
Bank of East Asia Ltd.	317.180	1.373.434	0,01 %	Davide Campari-Milano SpA	163.320	1.263.959	0,01 %
Hang Lung Properties Ltd.	534.993	1.307.148	0,01 %	Recordati SpA	26.472	1.178.048	0,01 %
HKT Trust & HKT Ltd.	978.481	1.246.680	0,01 %	Telecom Italia SpA (Non CVA)	1.574.464	1.126.807	0,01 %
Swire Pacific Ltd. Klasse A	127.007	1.175.464	0,01 %	Poste Italiane SpA	130.143	980.630	0,01 %
Wharf Holdings Ltd.	322.046	1.112.308	0,01 %	Intesa Sanpaolo SpA-(Non CNV)	256.388	818.936	0,01 %
Kingston Financial Group Ltd.	1.074.000	1.030.407	0,01 %	UnipolSai Assicurazioni SpA	287.178	671.410	0,01 %
Swire Properties Ltd.	293.999	947.741	0,01 %			93.919.948	0,86 %
ASM Pacific Technology Ltd.	67.809	944.623	0,01 %	Japan 8,85 % (2016: 8,73 %)			
Hang Lung Group Ltd.	246.000	904.724	0,01 %	Toyota Motor Corp.	695.354	44.523.643	0,41 %
Hysan Development Co., Ltd.	165.835	879.314	0,01 %	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	3.174.954	23.291.451	0,21 %
Li & Fung Ltd.	1.500.510	823.454	0,01 %	SoftBank Group Corp.	219.686	17.395.465	0,16 %
MGM China Holdings Ltd.	245.984	744.186	0,01 %	Honda Motor Co., Ltd.	456.829	15.661.550	0,14 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	356.915	15.423.544	0,14 %	Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	380.048	4.171.588	0,04 %
Sony Corp.	339.435	15.316.006	0,14 %	Secom Co., Ltd.	55.022	4.155.101	0,04 %
Keyence Corp.	26.146	14.650.116	0,13 %	Terumo Corp.	84.701	4.015.121	0,04 %
FANUC Corp.	51.390	12.344.549	0,11 %	Nitto Denko Corp.	43.957	3.905.988	0,04 %
KDDI Corp.	481.551	11.988.547	0,11 %	Daiichi Sankyo Co., Ltd.	148.876	3.881.481	0,04 %
Mizuho Financial Group, Inc.	6.398.766	11.621.727	0,11 %	Daito Trust Construction Co., Ltd.	18.838	3.842.016	0,04 %
Mitsubishi Corp.	408.605	11.291.499	0,10 %	Toray Industries, Inc.	404.904	3.819.001	0,03 %
Nintendo Co., Ltd.	30.498	11.151.466	0,10 %	Sompo Holdings, Inc.	95.626	3.704.499	0,03 %
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	190.232	10.809.366	0,10 %	Fujitsu Ltd.	519.101	3.698.911	0,03 %
Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	104.733	10.645.298	0,10 %	Resona Holdings, Inc.	594.576	3.552.677	0,03 %
Canon, Inc.	282.409	10.529.230	0,10 %	Sumitomo Electric Industries Ltd.	204.108	3.451.627	0,03 %
Hitachi Ltd.	1.283.689	10.004.000	0,09 %	Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc.	86.730	3.443.793	0,03 %
Japan Tobacco, Inc.	296.451	9.555.380	0,09 %	JFE Holdings, Inc.	141.631	3.402.161	0,03 %
Nidec Corp.	64.481	9.049.664	0,08 %	Sysmex Corp.	42.325	3.332.648	0,03 %
Kao Corp.	131.310	8.881.055	0,08 %	Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	85.900	3.210.288	0,03 %
Komatsu Ltd.	244.709	8.858.618	0,08 %	Inpex Corp.	253.015	3.164.653	0,03 %
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	186.477	8.775.096	0,08 %	Marubeni Corp.	435.580	3.155.587	
NTT DOCOMO, Inc.	369.392	8.725.718	0,08 %	0,03 % West Japan Railway Co.	43.017	3.141.597	0,03 %
Panasonic Corp.	587.453	8.601.897	0,08 %	Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	61.210	3.135.213	0,03 %
East Japan Railway Co.	87.389	8.529.446	0,08 %	Nitori Holdings Co., Ltd.	21.666	3.089.785	0,03 %
Mitsubishi Electric Corp.	512.201	8.509.402	0,08 %	Sumitomo Metal Mining Co., Ltd.	66.746	3.068.005	0,03 %
Tokio Marine Holdings, Inc.	183.717	8.384.280	0,08 %	Sumitomo Realty & Development Co., Ltd.	93.177	3.062.889	0,03 %
Seven & i Holdings Co., Ltd.	198.809	8.264.736	0,08 %	Yaskawa Electric Corp.	68.885	3.036.077	0,03 %
Bridgestone Corp.	175.714	8.170.350	0,07 %	Omron Corp.	50.394	3.006.193	0,03 %
Daikin Industries Ltd.	67.544	7.995.555	0,07 %	Sumitomo Chemical Co., Ltd.	415.540	2.987.904	0,03 %
Tokyo Electron Ltd.	42.237	7.648.778	0,07 %	Aeon Co., Ltd.	173.744	2.934.292	0,03 %
Denso Corp.	126.076	7.569.037	0,07 %	Olympus Corp.	76.390	2.929.470	0,03 %
Recruit Holdings Co., Ltd.	296.927	7.380.343	0,07 %	Toyota Industries Corp.	44.502	2.860.137	0,03 %
ITOCU Corp.	394.012	7.355.590	0,07 %	Sekisui House Ltd.	155.799	2.815.170	0,03 %
Mitsui & Co., Ltd.	450.002	7.318.275	0,07 %	Rohm Co., Ltd.	25.394	2.813.290	0,03 %
Astellas Pharma, Inc.	562.906	7.180.612	0,07 %	TDK Corp.	35.153	2.805.375	0,03 %
Murata Manufacturing Co., Ltd.	51.895	6.965.401	0,06 %	Shimano, Inc.	19.902	2.800.237	0,03 %
Central Japan Railway Co.	38.617	6.917.808	0,06 %	Ajinomoto Co., Inc.	148.374	2.793.620	0,03 %
SMC Corp.	15.572	6.411.268	0,06 %	MEIJI Holdings Co., Ltd.	32.487	2.765.649	0,03 %
Nissan Motor Co., Ltd.	634.469	6.327.793	0,06 %	Unicharm Corp.	104.715	2.723.148	0,02 %
ORIX Corp.	353.223	5.971.711	0,05 %	Taisei Corp.	54.464	2.712.322	0,02 %
Kirin Holdings Co., Ltd.	236.337	5.959.301	0,05 %	Daiwa Securities Group, Inc.	421.689	2.646.178	0,02 %
Dai-ichi Life Holdings, Inc.	285.485	5.889.633	0,05 %	Hankyu Hanshin Holdings, Inc.	65.707	2.642.279	0,02 %
Nomura Holdings, Inc.	993.170	5.863.803	0,05 %	Ono Pharmaceutical Co., Ltd.	112.910	2.632.061	0,02 %
Mitsubishi Estate Co., Ltd.	333.314	5.799.338	0,05 %	Makita Corp.	61.480	2.584.179	0,02 %
Fast Retailing Co., Ltd.	14.399	5.740.427	0,05 %	Aisin Seiki Co., Ltd.	45.838	2.575.717	0,02 %
Daiwa House Industry Co., Ltd.	147.877	5.680.105	0,05 %	Dentsu, Inc.	58.485	2.479.058	0,02 %
Kyocera Corp.	85.663	5.606.687	0,05 %	Yamaha Motor Co., Ltd.	74.736	2.451.394	0,02 %
Sumitomo Corp.	325.691	5.536.602	0,05 %	T & D Holdings, Inc.	142.839	2.443.415	0,02 %
Kubota Corp.	280.850	5.508.549	0,05 %	Isuzu Motors Ltd.	143.788	2.408.593	0,02 %
Mitsui Fudosan Co., Ltd.	243.802	5.464.714	0,05 %	Japan Exchange Group, Inc.	137.079	2.386.258	0,02 %
Suzuki Motor Corp.	92.303	5.353.820	0,05 %	Kajima Corp.	245.720	2.364.496	0,02 %
JXTG Holdings, Inc.	819.868	5.291.114	0,05 %	Asahi Glass Co., Ltd.	54.088	2.343.093	0,02 %
Oriental Land Co., Ltd.	57.647	5.255.523	0,05 %	Tokyo Gas Co., Ltd.	101.563	2.324.724	0,02 %
Subaru Corp.	163.182	5.190.245	0,05 %	Kansai Electric Power Co., Inc.	188.705	2.311.699	0,02 %
Asahi Group Holdings Ltd.	104.158	5.168.604	0,05 %	TOTO Ltd.	37.940	2.239.689	0,02 %
Hoya Corp.	103.099	5.150.832	0,05 %	Rakuten, Inc.	242.606	2.223.619	0,02 %
Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp.	200.475	5.144.902	0,05 %	Toyota Tsusho Corp.	55.200	2.222.210	0,02 %
Shiseido Co., Ltd.	102.541	4.957.286	0,05 %	MISUMI Group, Inc.	75.600	2.201.225	0,02 %
Toshiba Corp.	1.720.665	4.841.996	0,04 %	Tokyu Corp.	137.838	2.200.024	0,02 %
Japan Post Holdings Co., Ltd.	418.255	4.797.030	0,04 %	MINEBEA MITSUMI, Inc.	101.691	2.133.119	0,02 %
Otsuka Holdings Co., Ltd.	104.463	4.588.397	0,04 %	Obayashi Corp.	174.739	2.115.792	0,02 %
FUJIFILM Holdings Corp.	108.250	4.425.133	0,04 %	Sekisui Chemical Co., Ltd.	104.798	2.104.333	0,02 %
Asahi Kasei Corp.	334.685	4.318.372	0,04 %	Chubu Electric Power Co., Inc.	168.849	2.099.184	0,02 %
MS&AD Insurance Group Holdings, Inc.	124.725	4.222.824	0,04 %	Koito Manufacturing Co., Ltd.	29.263	2.057.372	0,02 %
Eisai Co., Ltd.	74.107	4.220.777	0,04 %	M3, Inc.	57.376	2.019.493	0,02 %
Shionogi & Co., Ltd.	77.934	4.218.052	0,04 %	Mazda Motor Corp.	149.016	1.999.447	0,02 %
				Ryohin Keikaku Co., Ltd.	6.238	1.943.664	0,02 %
				NTT Data Corp.	161.835	1.923.631	0,02 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
NEC Corp.	71.263	1.923.120	0,02 %	Hoshizaki Corp.	14.619	1.296.439	0,01 %
Concordia Financial Group Ltd.	318.075	1.920.027	0,02 %	Persol Holdings Co., Ltd.	51.600	1.293.550	0,01 %
LIXIL Group Corp.	70.301	1.903.400	0,02 %	Japan Airlines Co., Ltd.	32.754	1.281.666	0,01 %
Osaka Gas Co., Ltd.	97.112	1.870.688	0,02 %	Seibu Holdings, Inc.	67.671	1.280.132	0,01 %
Kintetsu Group Holdings Co., Ltd.	48.337	1.853.669	0,02 %	Kyushu Railway Co.	41.200	1.278.242	0,01 %
Nikon Corp.	91.599	1.845.803	0,02 %	Konica Minolta, Inc.	132.650	1.276.454	0,01 %
Yamato Holdings Co., Ltd.	90.907	1.829.841	0,02 %	Keio Corp.	28.984	1.274.884	0,01 %
Ricoh Co., Ltd.	193.410	1.797.606	0,02 %	USS Co., Ltd.	59.729	1.265.099	0,01 %
Kuraray Co., Ltd.	95.147	1.795.673	0,02 %	Yokogawa Electric Corp.	65.396	1.252.770	0,01 %
Nippon Building Fund, Inc. REIT	367	1.795.091	0,02 %	Aozora Bank Ltd.	32.076	1.248.586	0,01 %
Yahoo Japan Corp.	390.134	1.790.495	0,02 %	Mitsubishi Motors Corp.	172.156	1.243.986	0,01 %
Trend Micro, Inc.	31.301	1.775.529	0,02 %	Obic Co., Ltd.	16.903	1.242.404	0,01 %
Mitsui Chemicals, Inc.	53.538	1.722.816	0,02 %	Nissan Chemical Industries Ltd.	31.100	1.240.963	0,01 %
Seiko Epson Corp.	72.760	1.717.433	0,02 %	Hamamatsu Photonics KK	36.619	1.232.011	0,01 %
Yakult Honsha Co., Ltd.	22.592	1.704.678	0,02 %	Nagoya Railroad Co., Ltd.	48.735	1.227.352	0,01 %
Tosoh Corp.	74.700	1.693.598	0,02 %	Alfresa Holdings Corp.	52.079	1.223.729	0,01 %
Bandai Namco Holdings, Inc.	51.605	1.688.100	0,02 %	United Urban Investment Corp. REIT	850	1.223.125	0,01 %
Suntory Beverage & Food Ltd.	37.345	1.660.883	0,02 %	Hirose Electric Co., Ltd.	8.361	1.222.420	0,01 %
Tobu Railway Co., Ltd.	51.095	1.651.006	0,02 %	THK Co., Ltd.	32.502	1.220.448	0,01 %
Disco Corp.	7.400	1.646.853	0,01 %	Toppan Printing Co., Ltd.	134.886	1.220.141	0,01 %
Odakyu Electric Railway Co., Ltd.	76.604	1.638.843	0,01 %	Nabtesco Corp.	31.738	1.217.116	0,01 %
Japan Real Estate Investment Corp. REIT	338	1.605.237	0,01 %	NH Foods Ltd.	49.740	1.213.365	0,01 %
Tokyo Electric Power Co. Holdings, Inc.	401.631	1.590.124	0,01 %	Kose Corp.	7.713	1.204.365	0,01 %
Nomura Research Institute Ltd.	34.171	1.589.490	0,01 %	Mitsubishi Tanabe Pharma Corp.	57.749	1.195.479	0,01 %
Yamaha Corp.	42.848	1.582.314	0,01 %	Coca-Cola Bottlers Japan, Inc.	32.600	1.190.848	0,01 %
NSK Ltd.	99.874	1.572.805	0,01 %	Amada Holdings Co., Ltd.	85.008	1.157.588	0,01 %
Don Quijote Holdings Co., Ltd.	30.018	1.569.516	0,01 %	J Front Retailing Co., Ltd.	61.386	1.156.880	0,01 %
Santen Pharmaceutical Co., Ltd.	99.678	1.567.064	0,01 %	Lion Corp.	61.000	1.156.103	0,01 %
Renesas Electronics Corp.	134.100	1.563.012	0,01 %	Keikyu Corp.	59.512	1.143.750	0,01 %
Dai Nippon Printing Co., Ltd.	69.216	1.544.073	0,01 %	Kyushu Electric Power Co., Inc.	108.200	1.134.347	0,01 %
Kikkoman Corp.	38.140	1.543.883	0,01 %	Nissin Foods Holdings Co., Ltd.	15.516	1.133.570	0,01 %
SUMCO Corp.	60.200	1.543.343	0,01 %	Hitachi Construction Machinery Co., Ltd.	31.110	1.130.896	0,01 %
Stanley Electric Co., Ltd.	37.913	1.539.742	0,01 %	SBI Holdings, Inc.	53.360	1.115.989	0,01 %
Oji Holdings Corp.	229.947	1.530.939	0,01 %	Fukuoka Financial Group, Inc.	198.262	1.114.069	0,01 %
Start Today Co., Ltd.	50.200	1.526.276	0,01 %	Keisei Electric Railway Co., Ltd.	34.373	1.104.574	0,01 %
Shimadzu Corp.	66.990	1.523.554	0,01 %	Mitsui OSK Lines Ltd.	32.848	1.096.391	0,01 %
Chiba Bank Ltd.	182.029	1.515.696	0,01 %	JTEKT Corp.	63.523	1.091.705	0,01 %
Brother Industries Ltd.	61.367	1.514.427	0,01 %	NGK Spark Plug Co., Ltd.	44.875	1.091.102	0,01 %
FamilyMart UNY Holdings Co., Ltd.	21.582	1.513.518	0,01 %	Nisshin Seifun Group, Inc.	52.840	1.067.588	0,01 %
Shizuoka Bank Ltd.	144.321	1.491.253	0,01 %	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd.	85.493	1.060.219	0,01 %
Nexon Co., Ltd.	50.966	1.483.963	0,01 %	Mebuki Financial Group, Inc.	249.992	1.058.555	0,01 %
Tohoku Electric Power Co., Inc.	115.828	1.481.652	0,01 %	JSR Corp.	53.043	1.044.380	0,01 %
Shimizu Corp.	142.152	1.468.841	0,01 %	Fuji Electric Co., Ltd.	138.043	1.040.377	0,01 %
Kansai Paint Co., Ltd.	56.380	1.465.430	0,01 %	Teijin Ltd.	46.639	1.039.182	0,01 %
Alps Electric Co., Ltd.	51.022	1.458.418	0,01 %	Tokyu Fudosan Holdings Corp.	141.817	1.026.017	0,01 %
Nippon Paint Holdings Co., Ltd.	45.550	1.441.507	0,01 %	Mitsubishi Materials Corp.	28.425	1.011.844	0,01 %
Japan Post Bank Co., Ltd.	110.222	1.435.381	0,01 %	JGC Corp.	52.008	1.005.996	0,01 %
Kawasaki Heavy Industries Ltd.	40.854	1.434.333	0,01 %	Otsuka Corp.	13.031	999.448	0,01 %
Japan Retail Fund Investment Corp. REIT	780	1.430.519	0,01 %	Sohgo Security Services Co., Ltd.	18.284	994.948	0,01 %
Idemitsu Kosan Co., Ltd.	35.385	1.421.368	0,01 %	Toho Co., Ltd.	28.607	991.659	0,01 %
Nippon Express Co., Ltd.	21.370	1.420.873	0,01 %	Electric Power Development Co., Ltd.	36.790	991.191	0,01 %
IHI Corp.	41.776	1.390.679	0,01 %	Nippon Yusen KK	40.606	990.909	0,01 %
Kyowa Hakko Kirin Co., Ltd.	71.084	1.374.985	0,01 %	Nippon Prologis, Inc. REIT	466	985.777	0,01 %
Mitsubishi Gas Chemical Co., Inc.	47.840	1.373.834	0,01 %	Suruga Bank Ltd.	45.528	976.841	0,01 %
ANA Holdings, Inc.	32.882	1.373.659	0,01 %	Sundrug Co., Ltd.	20.600	958.225	0,01 %
Taiheiyu Cement Corp.	31.694	1.368.764	0,01 %	Toyo Suisan Kaisha Ltd.	21.943	937.910	0,01 %
Sumitomo Heavy Industries Ltd.	32.186	1.362.869	0,01 %	Pola Orbis Holdings, Inc.	26.700	937.403	0,01 %
Daifuku Co., Ltd.	24.900	1.357.177	0,01 %	Nippon Electric Glass Co., Ltd.	24.554	937.259	0,01 %
Sharp Corp.	39.200	1.346.684	0,01 %	Yamada Denki Co., Ltd.	169.030	931.803	0,01 %
NGK Insulators Ltd.	70.948	1.340.234	0,01 %	Hisamitsu Pharmaceutical Co., Inc.	15.368	931.766	0,01 %
Tsuruha Holdings, Inc.	9.700	1.319.166	0,01 %	Sony Financial Holdings, Inc.	51.313	909.194	0,01 %
Nomura Real Estate Master Fund, Inc. REIT	1.056	1.311.446	0,01 %	Daiwa House Investment Corp. REIT	377	895.898	0,01 %
Konami Holdings Corp.	23.764	1.307.917	0,01 %	Marui Group Co., Ltd.	48.783	893.381	0,01 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Oracle Corp. Japan	10.665	884.253	0,01 %	Japan Airport Terminal Co., Ltd.	11.439	424.456	0,00 %
Air Water, Inc.	41.540	876.894	0,01 %	LINE Corp.	10.200	416.059	0,00 %
Lawson, Inc.	13.055	868.016	0,01 %	Sankyo Co., Ltd.	9.897	311.450	0,00 %
Hino Motors Ltd.	66.898	867.031	0,01 %			965.186.381	8,85 %
McDonald's Holdings Co. Japan Ltd.	19.533	859.175	0,01 %	Malaysia 0,00 % (2016: 0,00 %)			
Bank of Kyoto Ltd.	16.348	851.866	0,01 %	BGP Holdings Beneficial	1.010.126	—	0,00 %
Hakuhodo DY Holdings, Inc.	65.444	849.930	0,01 %			—	0,00 %
Sumitomo Rubber Industries Ltd.	45.650	849.378	0,01 %	Niederlande 1,37 % (2016: 1,24 %)			
Credit Saison Co., Ltd.	46.185	840.473	0,01 %	Unilever NV	433.638	24.450.056	0,22 %
Suzuken Co., Ltd.	20.332	836.563	0,01 %	ING Groep NV	1.029.880	18.952.119	0,17 %
Rinnai Corp.	9.196	832.660	0,01 %	ASML Holding NV	104.003	18.127.319	0,17 %
Yokohama Rubber Co., Ltd.	33.676	825.981	0,01 %	NXP Semiconductors NV	92.828	10.869.231	0,10 %
Kurita Water Industries Ltd.	25.270	821.023	0,01 %	Koninklijke Philips NV	253.028	9.582.988	0,09 %
Hulic Co., Ltd.	73.025	820.680	0,01 %	Koninklijke Ahold Delhaize NV	344.686	7.588.837	0,07 %
Medipal Holdings Corp.	41.867	820.244	0,01 %	Heineken NV	68.837	7.185.588	0,07 %
Casio Computer Co., Ltd.	56.844	817.968	0,01 %	RELX NV	260.844	6.002.890	0,06 %
Hikari Tsushin, Inc.	5.684	817.406	0,01 %	Akzo Nobel NV	67.477	5.916.546	0,05 %
Daicel Corp.	71.714	816.133	0,01 %	ArcelorMittal	175.204	5.704.588	0,05 %
Chugoku Electric Power Co., Inc.	74.037	795.906	0,01 %	Koninklijke DSM NV	48.035	4.595.400	0,04 %
Takashimaya Co., Ltd.	75.318	792.962	0,01 %	Wolters Kluwer NV	80.342	4.194.719	0,04 %
Hitachi Chemical Co., Ltd.	30.229	776.589	0,01 %	ABN AMRO Group NV	113.947	3.680.661	0,03 %
Hitachi High-Technologies Corp.	18.392	775.517	0,01 %	NN Group NV	82.110	3.561.349	0,03 %
Shinsei Bank Ltd.	44.703	773.423	0,01 %	Koninklijke KPN NV	927.251	3.237.892	0,03 %
Hitachi Metals Ltd.	53.692	771.182	0,01 %	Heineken Holding NV	30.597	3.030.755	0,03 %
Iida Group Holdings Co., Ltd.	40.720	768.131	0,01 %	Aegon NV	466.115	2.974.863	0,03 %
Keihan Holdings Co., Ltd.	26.014	766.680	0,01 %	Coca-Cola European Partners plc	58.440	2.331.907	0,02 %
Kamigumi Co., Ltd.	33.662	744.957	0,01 %	AerCap Holdings NV	38.884	2.045.687	0,02 %
Kobe Steel Ltd.	80.060	742.678	0,01 %	Randstad Holding NV	30.489	1.875.957	0,02 %
Benesse Holdings, Inc.	20.720	731.132	0,01 %	Altice NV Klasse A	148.780	1.562.517	0,01 %
Park24 Co., Ltd.	30.390	727.579	0,01 %	Boskalis Westminster	24.687	931.716	0,01 %
Nomura Real Estate Holdings, Inc.	31.834	713.828	0,01 %	Koninklijke Vopak NV	17.491	768.087	0,01 %
Yamaguchi Financial Group, Inc.	59.648	708.998	0,01 %			149.171.672	1,37 %
Calbee, Inc.	21.658	704.630	0,01 %	Neuseeland 0,07 % (2016: 0,06 %)			
Japan Prime Realty Investment Corp. REIT	220	699.157	0,01 %	Fisher & Paykel Healthcare Corp., Ltd.	157.911	1.611.595	0,02 %
AEON Financial Service Co., Ltd.	29.469	686.433	0,01 %	Spark New Zealand Ltd.	504.547	1.302.567	0,01 %
Tokyo Tatemono Co., Ltd.	50.472	681.921	0,01 %	Auckland International Airport Ltd.	261.370	1.204.543	0,01 %
Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co., Ltd.	109.003	649.277	0,01 %	Fletcher Building Ltd.	176.414	953.539	0,01 %
Mabuchi Motor Co., Ltd.	11.907	645.821	0,01 %	Ryman Healthcare Ltd.	114.504	862.399	0,01 %
Shimamura Co., Ltd.	5.853	644.272	0,01 %	Meridian Energy Ltd.	326.077	678.325	0,01 %
Toyo Seikan Group Holdings Ltd.	39.953	641.943	0,01 %	Mercury NZ Ltd.	178.834	428.619	0,00 %
Yamazaki Baking Co., Ltd.	32.867	641.001	0,01 %			7.041.587	0,07 %
Asics Corp.	39.681	632.642	0,01 %	Norwegen 0,24 % (2016: 0,24 %)			
Kaneka Corp.	69.016	630.426	0,01 %	Statoil A.S.A	313.377	6.712.471	0,06 %
Showa Shell Sekiyu KK	46.169	627.062	0,01 %	DNB A.S.A	259.336	4.822.511	0,04 %
Sumitomo Dainippon Pharma Co., Ltd.	41.998	624.098	0,01 %	Telenor A.S.A	199.145	4.282.688	0,04 %
Kakaku.com, Inc.	36.595	618.850	0,01 %	Norsk Hydro A.S.A	354.148	2.699.619	0,02 %
Taisho Pharmaceutical Holdings Co., Ltd.	7.574	605.113	0,01 %	Orkla A.S.A	220.935	2.351.335	0,02 %
Hachijuni Bank Ltd.	104.970	602.890	0,01 %	Yara International A.S.A	47.071	2.167.855	0,02 %
Mixi, Inc.	12.931	580.833	0,01 %	Marine Harvest A.S.A	110.468	1.877.295	0,02 %
Toho Gas Co., Ltd.	20.772	569.778	0,01 %	Gjensidige Forsikring A.S.A	50.481	956.006	0,01 %
Sega Sammy Holdings, Inc.	45.603	565.939	0,01 %	Schibsted A.S.A Klasse B	27.682	737.794	0,01 %
Kyushu Financial Group, Inc.	92.039	557.218	0,00 %			26.607.574	0,24 %
DeNA Co., Ltd.	26.500	546.467	0,00 %	Portugal 0,05 % (2016: 0,05 %)			
Aeon Mall Co., Ltd.	27.883	545.532	0,00 %	Galp Energia SGPS SA	129.920	2.390.821	0,02 %
NOK Corp.	23.326	544.791	0,00 %	EDP-Energias de Portugal SA	642.365	2.225.350	0,02 %
Seven Bank Ltd.	149.483	512.210	0,00 %	Jeronimo Martins SGPS SA	63.442	1.233.754	0,01 %
Maruichi Steel Tube Ltd.	16.422	481.071	0,00 %	Banco Espirito Santo SA	676.875	779	0,00 %
Acom Co., Ltd.	111.243	469.067	0,00 %			5.850.704	0,05 %
Toyoda Gosei Co., Ltd.	18.304	465.846	0,00 %	Singapur 0,49 % (2016: 0,45 %)			
ABC-Mart, Inc.	7.840	450.287	0,00 %	DBS Group Holdings Ltd.	484.464	9.008.478	0,08 %
Taiyo Nippon Sanso Corp.	31.872	446.180	0,00 %	Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	844.267	7.827.348	0,07 %
CYBERDYNE, Inc.	25.200	434.205	0,00 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	67635	10.135.781	0,09 %	Dollar General Corp.	72.702	6.762.013	0,06 %
Travelers Cos, Inc.	73.990	10.036.004	0,09 %	Rockwell Automation, Inc.	34.431	6.760.527	0,06 %
LyondellBasell Industries NV Klasse A	90.309	9.962.889	0,09 %	Williams Cos, Inc.	219.893	6.704.538	0,06 %
Twenty-First Century Fox, Inc. Klasse A	287959	9.943.224	0,09 %	VF Corp.	90.251	6.678.574	0,06 %
State Street Corp.	100.579	9.817.516	0,09 %	T Rowe Price Group, Inc.	63.643	6.678.060	0,06 %
Kinder Morgan, Inc.	542.959	9.811.269	0,09 %	PACCAR, Inc.	93.655	6.656.997	0,06 %
Humana, Inc.	38.897	9.649.179	0,09 %	Kroger Co.	241.705	6.634.802	0,06 %
American Electric Power Co., Inc.	130.384	9.592.351	0,09 %	Monster Beverage Corp.	104.791	6.632.222	0,06 %
Air Products & Chemicals, Inc.	58.418	9.585.225	0,09 %	Zimmer Biomet Holdings, Inc.	54.570	6.584.962	0,06 %
Eaton Corp. plc	120.065	9.486.336	0,09 %	AvalonBay Communities, Inc. REIT	36.650	6.538.726	0,06 %
Zoetis, Inc. Klasse A	131.665	9.485.147	0,09 %	Xcel Energy, Inc.	133.580	6.426.534	0,06 %
Johnson Controls International plc	247.761	9.442.172	0,09 %	Edwards Lifesciences Corp.	56.847	6.407.225	0,06 %
HP, Inc.	447.930	9.411.009	0,09 %	Western Digital Corp.	79.328	6.308.956	0,06 %
Equinix, Inc. REIT	20.699	9.381.201	0,09 %	Hewlett Packard Enterprise Co.	436.435	6.267.207	0,06 %
Aon plc	69.717	9.342.078	0,09 %	Tyson Foods, Inc. Klasse A	77.164	6.255.685	0,06 %
Ecolab, Inc.	69.515	9.327.523	0,09 %	Equity Residential REIT	97.578	6.222.549	0,06 %
Sherwin-Williams Co.	22.590	9.262.804	0,08 %	Digital Realty Trust, Inc. REIT	54.449	6.201.741	0,06 %
Prologis, Inc. REIT	142.788	9.211.254	0,08 %	M&T Bank Corp.	36.211	6.191.719	0,06 %
Boston Scientific Corp.	368.794	9.142.403	0,08 %	Carnival Corp.	92.277	6.124.424	0,06 %
General Mills, Inc.	153.709	9.113.407	0,08 %	PG&E Corp.	136.475	6.118.174	0,06 %
Aflac, Inc.	103.603	9.094.271	0,08 %	International Paper Co.	105.490	6.112.091	0,06 %
Target Corp.	138.358	9.027.859	0,08 %	Concho Resources, Inc.	40.304	6.054.467	0,06 %
Marathon Petroleum Corp.	136.451	9.003.037	0,08 %	Fifth Third Bancorp	199.335	6.047.824	0,06 %
McKesson Corp.	56.481	8.808.212	0,08 %	Fortive Corp.	83.479	6.039.706	0,06 %
Progressive Corp.	156.166	8.795.269	0,08 %	Welltower, Inc. REIT	94.585	6.031.685	0,06 %
Public Storage REIT	42.012	8.780.508	0,08 %	Ingersoll-Rand plc	67.148	5.988.930	0,05 %
Analog Devices, Inc.	97.701	8.698.320	0,08 %	Archer-Daniels-Midland Co.	149.389	5.987.511	0,05 %
Electronic Arts, Inc.	82.440	8.661.146	0,08 %	Aptiv plc	70.443	5.975.680	0,05 %
TE Connectivity Ltd.	91.092	8.657.384	0,08 %	Paychex, Inc.	87.519	5.958.294	0,05 %
Illumina, Inc.	39.171	8.558.472	0,08 %	KeyCorp	295.162	5.953.418	0,05 %
Baxter International, Inc.	131.578	8.505.202	0,08 %	Northern Trust Corp.	58.749	5.868.438	0,05 %
Fidelity National Information Services, Inc.	89.666	8.436.674	0,08 %	ServiceNow, Inc.	44.859	5.849.165	0,05 %
SunTrust Banks, Inc.	129.316	8.352.520	0,08 %	Rockwell Collins, Inc.	43.008	5.832.745	0,05 %
Synchrony Financial	214.293	8.273.853	0,08 %	Red Hat, Inc.	48.352	5.807.075	0,05 %
Ross Stores, Inc.	102.937	8.260.694	0,08 %	Agilent Technologies, Inc.	86.107	5.766.586	0,05 %
Sysco Corp.	134.928	8.194.177	0,08 %	O'Reilly Automotive, Inc.	23.777	5.719.320	0,05 %
Anadarko Petroleum Corp.	151.209	8.110.851	0,07 %	Ventas, Inc. REIT	94.803	5.689.128	0,05 %
Lam Research Corp.	43.700	8.043.859	0,07 %	PPL Corp.	182.614	5.651.903	0,05 %
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	21.111	7.936.892	0,07 %	Citizens Financial Group, Inc.	134.153	5.631.743	0,05 %
Pioneer Natural Resources Co.	45.491	7.863.119	0,07 %	Regions Financial Corp.	323.929	5.597.493	0,05 %
PPG Industries, Inc.	66.861	7.810.702	0,07 %	WEC Energy Group, Inc.	84.057	5.583.907	0,05 %
Discover Financial Services	100.609	7.738.844	0,07 %	Edison International	87.886	5.557.911	0,05 %
Corning, Inc.	240.824	7.703.960	0,07 %	Autodesk, Inc.	52.846	5.539.846	0,05 %
Estee Lauder Cos, Inc. Klasse A	59.767	7.604.753	0,07 %	Hartford Financial Services Group, Inc.	97.757	5.501.764	0,05 %
Cummins, Inc.	42.893	7.576.620	0,07 %	Devon Energy Corp.	131.715	5.453.001	0,05 %
Fiserv, Inc.	56.414	7.397.568	0,07 %	Royal Caribbean Cruises Ltd.	45.668	5.447.279	0,05 %
Las Vegas Sands Corp.	105.560	7.335.364	0,07 %	ONEOK, Inc.	101.908	5.446.983	0,05 %
Yum! Brands, Inc.	88.524	7.224.444	0,07 %	Microchip Technology, Inc.	61.564	5.410.244	0,05 %
Roper Technologies, Inc.	27.791	7.197.869	0,07 %	CBS Corp.Klasse B	91.505	5.398.795	0,05 %
Alexion Pharmaceuticals, Inc.	60.187	7.197.763	0,07 %	Principal Financial Group, Inc.	76.384	5.389.655	0,05 %
DXC Technology Co.	75.456	7.160.774	0,07 %	Nucor Corp.	84.305	5.360.112	0,05 %
Weyerhaeuser Co. REIT	201.855	7.117.407	0,07 %	SBA Communications Corp. REIT Klasse A	32.626	5.329.783	0,05 %
Parker-Hannifin Corp.	35.650	7.115.027	0,07 %	DTE Energy Co.	48.653	5.325.557	0,05 %
Consolidated Edison, Inc.	83.340	7.079.733	0,06 %	Eversource Energy	84.231	5.321.715	0,05 %
Stanley Black & Decker, Inc.	41.379	7.021.603	0,06 %	AutoZone, Inc.	7.479	5.320.336	0,05 %
Public Service Enterprise Group, Inc.	134.877	6.946.165	0,06 %	Cerner Corp.	78.840	5.313.028	0,05 %
Dollar Tree, Inc.	64.436	6.914.627	0,06 %	Boston Properties, Inc. REIT	40.770	5.301.323	0,05 %
Freeport-McMoRan, Inc.	363.298	6.888.130	0,06 %	Newmont Mining Corp.	140.510	5.271.935	0,05 %
HCA Healthcare, Inc.	78.058	6.856.615	0,06 %	Mylan NV	123.688	5.233.239	0,05 %
Ameriprise Financial, Inc.	40.352	6.838.453	0,06 %	Cardinal Health, Inc.	84.025	5.148.212	0,05 %
Amphenol Corp. Klasse A	77.628	6.815.738	0,06 %	Clorox Co.	34.500	5.131.530	0,05 %
Moody's Corp.	46.023	6.793.455	0,06 %	Willis Towers Watson plc	33.848	5.100.555	0,05 %
Sempra Energy	63.458	6.784.929	0,06 %	T-Mobile US, Inc.	78.133	4.962.227	0,05 %
				Best Buy Co., Inc.	72.209	4.944.150	0,05 %
				Liberty Global plc Klasse C	145.260	4.915.598	0,04 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens
IHS Markit Ltd.	108.024	4.877.284	0,04 %	Ameren Corp.	64.101	3.781.318	0,03 %
Dr Pepper Snapple Group, Inc.	49.625	4.816.602	0,04 %	GGP, Inc. REIT	161.628	3.780.479	0,03 %
DR Horton, Inc.	93.918	4.796.392	0,04 %	Marathon Oil Corp.	223.125	3.777.506	0,03 %
Kellogg Co.	69.621	4.732.836	0,04 %	Loews Corp.	75.262	3.765.358	0,03 %
FleetCor Technologies, Inc.	24.496	4.713.765	0,04 %	Cintas Corp.	23.985	3.737.583	0,03 %
Centene Corp.	46.654	4.706.456	0,04 %	Genuine Parts Co.	39.319	3.735.698	0,03 %
Symantec Corp.	166.322	4.666.995	0,04 %	Citrix Systems, Inc.	42.195	3.713.160	0,03 %
Skyworks Solutions, Inc.	49.110	4.662.994	0,04 %	Martin Marietta Materials, Inc.	16.783	3.709.714	0,03 %
AMETEK, Inc.	63.572	4.607.063	0,04 %	Brown-Forman Corp. Klasse B	53.964	3.705.708	0,03 %
Andeavor	40.176	4.593.724	0,04 %	Albemarle Corp.	28.923	3.698.962	0,03 %
Mohawk Industries, Inc.	16.619	4.585.182	0,04 %	Workday, Inc. Klasse A	36.345	3.697.740	0,03 %
Lincoln National Corp.	59.364	4.563.311	0,04 %	CMS Energy Corp.	77.999	3.689.353	0,03 %
Vulcan Materials Co.	35.440	4.549.433	0,04 %	First Republic Bank	42.354	3.669.551	0,03 %
Xilinx, Inc.	67.382	4.542.894	0,04 %	Wynn Resorts Ltd.	21.762	3.668.856	0,03 %
Harris Corp.	31.932	4.523.168	0,04 %	Annaly Capital Management, Inc. REIT	308.413	3.667.031	0,03 %
Dell Technologies, Inc. Klasse V Klasse V	55.064	4.475.602	0,04 %	Check Point Software Technologies Ltd.	35.369	3.664.936	0,03 %
Align Technology, Inc.	20.041	4.452.910	0,04 %	Twenty-First Century Fox, Inc. Klasse B	107.272	3.660.121	0,03 %
KLA-Tencor Corp.	42.182	4.432.063	0,04 %	FirstEnergy Corp.	119.507	3.659.304	0,03 %
Omnicom Group, Inc.	60.633	4.415.901	0,04 %	IDEXX Laboratories, Inc.	23.304	3.644.280	0,03 %
Hershey Co.	38.685	4.391.134	0,04 %	Hess Corp.	76.654	3.638.765	0,03 %
Incyte Corp.	46.345	4.389.335	0,04 %	IQVIA Holdings, Inc.	37.142	3.636.202	0,03 %
American Water Works Co., Inc.	47.477	4.343.671	0,04 %	National Oilwell Varco, Inc.	100.909	3.634.742	0,03 %
Apache Corp.	102.761	4.338.569	0,04 %	Palo Alto Networks, Inc.	24.845	3.601.034	0,03 %
Huntington Bancshares, Inc. Laboratory Corp. of America Holdings	27.132	4.327.825	0,04 %	Noble Energy, Inc.	123.272	3.592.146	0,03 %
Essex Property Trust, Inc. REIT	17.921	4.325.592	0,04 %	E*TRADE Financial Corp.	72.364	3.587.083	0,03 %
Mettler-Toledo International, Inc.	6.950	4.305.664	0,04 %	CBRE Group, Inc. Klasse A	82.721	3.582.647	0,03 %
Republic Services, Inc. Klasse A	63.254	4.276.603	0,04 %	Total System Services, Inc.	45.287	3.581.749	0,03 %
Realty Income Corp. REIT	74.696	4.259.166	0,04 %	Quest Diagnostics, Inc.	36.364	3.581.490	0,03 %
Conagra Brands, Inc.	112.818	4.249.854	0,04 %	Eastman Chemical Co.	38.511	3.567.659	0,03 %
WestRock Co.	67.225	4.249.292	0,04 %	Cabot Oil & Gas Corp.	124.620	3.564.132	0,03 %
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	52.998	4.232.420	0,04 %	MercadoLibre, Inc.	11.319	3.561.637	0,03 %
CenturyLink, Inc.	253.529	4.228.864	0,04 %	Ally Financial, Inc.	121.705	3.548.918	0,03 %
BioMarin Pharmaceutical, Inc.	47.361	4.223.180	0,04 %	Ulta Beauty, Inc.	15.806	3.535.170	0,03 %
Dover Corp.	41.489	4.189.974	0,04 %	Vornado Realty Trust REIT	45.161	3.530.687	0,03 %
Markel Corp.	3.674	4.185.164	0,04 %	Tiffany & Co.	33.892	3.523.073	0,03 %
Waters Corp.	21.630	4.178.700	0,04 %	WW Grainger, Inc.	14.757	3.486.341	0,03 %
Fastenal Co.	76.326	4.174.269	0,04 %	Cboe Global Markets Inc.	27.702	3.451.392	0,03 %
Newell Brands Inc.	132.995	4.109.545	0,04 %	Nielsen Holdings plc	94.754	3.449.046	0,03 %
AmerisourceBergen Corp. Klasse A	44.642	4.099.028	0,04 %	Baker Hughes a GE Co.	108.993	3.448.539	0,03 %
L3 Technologies, Inc.	20.676	4.090.747	0,04 %	Lennar Corp. Klasse A	54.391	3.439.687	0,03 %
Verisk Analytics, Inc. Klasse A	42.468	4.076.928	0,04 %	CH Robinson Worldwide, Inc.	38.282	3.410.543	0,03 %
Molson Coors Brewing Co. Klasse B	49.525	4.064.517	0,04 %	TD Ameritrade Holding Corp.	66.695	3.410.115	0,03 %
Global Payments, Inc.	40.431	4.052.803	0,04 %	Unum Group	61.792	3.391.763	0,03 %
MGM Resorts International	121.136	4.044.731	0,04 %	FMC Corp.	35.785	3.387.408	0,03 %
Invesco Ltd.	109.859	4.014.248	0,04 %	Alexandria Real Estate Equities, Inc. REIT	25.893	3.381.367	0,03 %
Expedia, Inc.	33.407	4.001.156	0,04 %	Ball Corp.	89.156	3.374.555	0,03 %
Comerica, Inc.	46.049	3.997.514	0,04 %	LKQ Corp.	82.973	3.374.512	0,03 %
DENTSPLY SIRONA, Inc.	60.555	3.986.336	0,04 %	Synopsys, Inc.	39.548	3.371.072	0,03 %
NetApp, Inc.	71.952	3.980.385	0,04 %	Alliance Data Systems Corp.	13.282	3.366.721	0,03 %
Twitter, Inc.	164.924	3.959.825	0,04 %	Whirlpool Corp.	19.944	3.363.356	0,03 %
Celanese Corp. Klasse A	36.977	3.959.497	0,04 %	SVB Financial Group	14.380	3.361.613	0,03 %
Maxim Integrated Products, Inc.	75.680	3.956.550	0,04 %	McCormick & Co., Inc.	32.693	3.331.744	0,03 %
L Brands, Inc.	65.689	3.955.792	0,04 %	Church & Dwight Co., Inc.	65.666	3.294.463	0,03 %
Host Hotels & Resorts, Inc. REIT	199.235	3.954.815	0,04 %	Xylem, Inc.	48.185	3.286.217	0,03 %
Textron, Inc.	69.709	3.944.832	0,04 %	ANSYS, Inc.	22.265	3.286.091	0,03 %
United Rentals, Inc.	22.852	3.928.487	0,04 %	HCP, Inc. REIT	125.994	3.285.924	0,03 %
Motorola Solutions, Inc.	43.155	3.898.623	0,04 %	Tapestry Inc.	74.093	3.277.133	0,03 %
TransDigm Group, Inc.	14.123	3.878.458	0,04 %	NVR, Inc.	931	3.266.153	0,03 %
Franklin Resources, Inc.	89.445	3.875.652	0,04 %	Pentair plc	46.155	3.259.466	0,03 %
Masco Corp.	87.973	3.865.534	0,04 %	ResMed, Inc.	38.261	3.240.324	0,03 %
Entergy Corp.	47.396	3.857.560	0,04 %	Seagate Technology plc	77.165	3.228.584	0,03 %
JM Smucker Co.	30.978	3.848.707	0,04 %	Lear Corp.	18.263	3.226.342	0,03 %
Equifax, Inc.	32.407	3.821.433	0,03 %				
EQT Corp.	66.833	3.804.134	0,03 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Lululemon Athletica, Inc.	28.009	2.201.227	0,02 %	Leggett & Platt, Inc.	35.124	1.676.469	0,02 %
F5 Networks, Inc.	16.715	2.193.342	0,02 %	Colony NorthStar, Inc. REIT Klasse A	145.583	1.661.102	0,02 %
Jacobs Engineering Group, Inc.	33.234	2.192.115	0,02 %	FLIR Systems, Inc.	35.405	1.650.581	0,02 %
Gap, Inc.	63.808	2.173.300	0,02 %	Xerox Corp.	55.978	1.631.759	0,01 %
Middleby Corp.	15.879	2.142.871	0,02 %	Newfield Exploration Co.	51.295	1.617.331	0,01 %
Goodyear Tire & Rubber Co.	66.273	2.141.281	0,02 %	American Airlines Group, Inc.	30.615	1.592.898	0,01 %
Jazz Pharmaceuticals plc	15.872	2.137.165	0,02 %	Live Nation Entertainment, Inc.	37.175	1.582.540	0,01 %
UGI Corp.	45.053	2.115.238	0,02 %	News Corp. Klasse A	96.481	1.563.957	0,01 %
Crown Holdings, Inc.	37.396	2.103.525	0,02 %	Veeva Systems, Inc. Klasse A	28.053	1.550.770	0,01 %
American Financial Group, Inc.	19.370	2.102.420	0,02 %	Knight-Swift Transportation Holdings, Inc. Klasse A	35.362	1.546.027	0,01 %
IPG Photonics Corp.	9.799	2.098.260	0,02 %	Nordstrom, Inc.	32.379	1.534.117	0,01 %
Lennox International, Inc.	10.068	2.096.762	0,02 %	Assurant, Inc.	15.039	1.516.533	0,01 %
Hanesbrands, Inc.	100.254	2.096.311	0,02 %	Athene Holding Ltd. Klasse A	29.104	1.504.968	0,01 %
Old Dominion Freight Line, Inc.	15.910	2.092.960	0,02 %	Stericycle, Inc.	21.887	1.488.097	0,01 %
HD Supply Holdings, Inc.	52.021	2.082.401	0,02 %	Brixmor Property Group, Inc. REIT	79.697	1.487.146	0,01 %
AGNC Investment Corp. REIT	102.940	2.078.359	0,02 %	Ralph Lauren Corp. Klasse A	14.332	1.486.085	0,01 %
Kimco Realty Corp. REIT	113.992	2.068.955	0,02 %	Flowserve Corp.	35.108	1.479.100	0,01 %
Interpublic Group of Cos, Inc.	102.162	2.059.586	0,02 %	SCANA Corp.	35.553	1.414.298	0,01 %
Macerich Co. REIT	31.110	2.043.305	0,02 %	United Continental Holdings, Inc.	20.837	1.404.414	0,01 %
Advance Auto Parts, Inc.	20.312	2.024.903	0,02 %	Continental Resources, Inc.	26.324	1.394.382	0,01 %
Signature Bank	14.597	2.003.584	0,02 %	RenaissanceRe Holdings Ltd.	11.060	1.389.025	0,01 %
Macy's, Inc.	79.377	1.999.507	0,02 %	H&R Block, Inc.	52.892	1.386.828	0,01 %
Scripps Networks Interactive, Inc. Klasse A	23.214	1.982.011	0,02 %	Macquarie Infrastructure Corp.	21.525	1.381.905	0,01 %
Chipotle Mexican Grill, Inc. Klasse A	6.849	1.979.566	0,02 %	Seattle Genetics, Inc.	25.658	1.372.703	0,01 %
VEREIT, Inc. REIT	253.789	1.977.016	0,02 %	Mattel, Inc.	88.125	1.355.362	0,01 %
WABCO Holdings, Inc.	13.775	1.976.712	0,02 %	BrightHouse Financial Inc.	22.724	1.332.535	0,01 %
Allegion plc	24.733	1.967.757	0,02 %	Avnet, Inc.	33.304	1.319.504	0,01 %
Polaris Industries, Inc.	15.838	1.963.754	0,02 %	Sprint Corp.	215.662	1.270.249	0,01 %
Garmin Ltd.	32.824	1.955.326	0,02 %	WR Grace & Co.	17.861	1.252.592	0,01 %
AES Corp.	179.762	1.946.822	0,02 %	Rollins, Inc.	25.483	1.185.724	0,01 %
Westar Energy, Inc. Klasse A	36.814	1.943.779	0,02 %	Vistra Energy Corp.	64.661	1.184.590	0,01 %
Invitation Homes, Inc. REIT	82.335	1.940.636	0,02 %	AGCO Corp.	16.383	1.170.238	0,01 %
Toll Brothers, Inc.	40.382	1.939.144	0,02 %	Axis Capital Holdings Ltd.	23.283	1.170.204	0,01 %
CommScope Holding Co., Inc.	51.140	1.934.626	0,02 %	Zillow Group, Inc. Klasse C	28.192	1.153.617	0,01 %
Acuity Brands, Inc.	10.891	1.916.816	0,02 %	Sabre Corp.	55.903	1.146.011	0,01 %
Helmerich & Payne, Inc.	29.553	1.910.306	0,02 %	Range Resources Corp.	65.216	1.112.585	0,01 %
Robert Half International, Inc.	34.309	1.905.522	0,02 %	Antero Resources Corp.	57.822	1.098.618	0,01 %
Liberty Media Corp. Series C- Liberty SiriusXM	47.579	1.886.983	0,02 %	Discovery Communications, Inc. Klasse A	47.362	1.059.962	0,01 %
Fluor Corp.	36.250	1.872.312	0,02 %	TripAdvisor, Inc.	30.697	1.057.819	0,01 %
SS&C Technologies Holdings, Inc.	45.746	1.851.798	0,02 %	Envision Healthcare Corp.	30.591	1.057.225	0,01 %
Arrow Electronics, Inc.	22.906	1.841.871	0,02 %	Discovery Communications, Inc. Klasse C	47.763	1.011.143	0,01 %
Axalta Coating Systems Ltd.	56.821	1.838.728	0,02 %	Liberty Media Corp.-Liberty SiriusXM	23.947	949.738	0,01 %
Parsley Energy, Inc. Klasse A	62.003	1.825.368	0,02 %	AutoNation, Inc.	17.573	902.022	0,01 %
Wabtec Corp.	22.406	1.824.521	0,02 %	TESARO, Inc.	9.962	825.551	0,01 %
Jones Lang LaSalle, Inc.	12.233	1.821.861	0,02 %	Plains GP Holdings LP Klasse A	35.658	782.693	0,01 %
WR Berkley Corp.	25.368	1.817.617	0,02 %	Spectrum Brands Holdings, Inc.	6.637	745.999	0,01 %
Zayo Group Holdings, Inc.	48.792	1.795.546	0,02 %	Under Armour, Inc. Klasse A	51.293	740.158	0,01 %
Eaton Vance Corp.	31.696	1.787.337	0,02 %	AMERCO	1.943	734.279	0,01 %
National Retail Properties, Inc. REIT	41.248	1.779.026	0,02 %	Under Armour, Inc. Klasse C	43.773	583.056	0,01 %
Liberty Media Corp.-Liberty Formula One Klasse C	51.888	1.772.494	0,02 %	Delphi Technologies plc	1	52	0,00 %
OGE Energy Corp.	53.723	1.768.024	0,02 %			6.376.390.339	58,43 %
Fortinet, Inc.	39.695	1.734.275	0,02 %	Summe Aktien		10.784.764.843	98,83 %
New York Community Bancorp, Inc.	133.032	1.732.077	0,02 %	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		10.784.764.843	98,83 %
People's United Financial, Inc.	92.485	1.729.469	0,02 %				
Liberty Property Trust REIT	40.180	1.728.142	0,02 %				
CIT Group, Inc.	34.627	1.704.687	0,02 %				
United Therapeutics Corp.	11.466	1.696.395	0,02 %				

	Anzahl der Kontrakte	Nominalbetrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt-nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures (0,00 %) (2016: (0,00 %))				
FTSE 100 Index März 2018	109	11.095.104	167.108	0,00 %
SPI 200 März 2018	45	5.295.622	1.489	0,00 %
Topix Index März 2018	63	10.216.499	(54.848)	(0,00 %)
Euro Stoxx 50 März 2018	403	17.137.443	(234.033)	(0,00 %)
S&P 500 E-mini März 2018	594	79.765.762	(288.562)	(0,00 %)
			(408.846)	(0,00 %)

Währung	Kauf-betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt-nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte 0,00 % (2016: (0,00 %))							
EUR	8.790.730	USD	(10.471.342)	JP Morgan	21.03.2018	133.955	0,00 %
EUR	6.338.370	USD	(7.525.959)	JP Morgan	21.03.2018	120.766	0,00 %
AUD	7.785.700	USD	(5.973.547)	BNP Paribas	20.03.2018	115.043	0,00 %
GBP	4.896.358	USD	(6.563.596)	Barclays Bank Plc	21.03.2018	76.875	0,00 %
GBP	3.670.250	USD	(4.919.838)	Bank of America	21.03.2018	57.778	0,00 %
EUR	2.519.790	USD	(2.988.413)	JP Morgan	21.03.2018	51.507	0,00 %
EUR	1.934.820	USD	(2.291.291)	JP Morgan	21.03.2018	42.911	0,00 %
AUD	2.381.700	USD	(1.826.592)	Bank of America	20.03.2018	35.950	0,00 %
AUD	4.820.800	USD	(3.743.317)	BNP Paribas	20.03.2018	26.655	0,00 %
EUR	2.726.570	USD	(3.263.214)	BNP Paribas	21.03.2018	26.169	0,00 %
USD	12.970.368	JPY	(1.453.200.000)	Barclays Bank Plc	13.03.2018	25.719	0,00 %
EUR	2.321.800	USD	(2.775.677)	UBS	21.03.2018	25.385	0,00 %
GBP	1.406.475	USD	(1.882.193)	JP Morgan	21.03.2018	25.277	0,00 %
JPY	524.175.000	USD	(4.647.568)	JP Morgan	13.03.2018	21.618	0,00 %
AUD	1.207.400	USD	(925.388)	Barclays Bank Plc	20.03.2018	18.826	0,00 %
GBP	1.581.090	USD	(2.126.539)	BNP Paribas	21.03.2018	17.745	0,00 %
JPY	418.370.000	USD	(3.710.099)	UBS	13.03.2018	16.610	0,00 %
GBP	1.041.880	USD	(1.398.014)	JP Morgan	21.03.2018	14.990	0,00 %
GBP	1.346.940	USD	(1.812.382)	Barclays Bank Plc	21.03.2018	14.347	0,00 %
JPY	272.850.000	USD	(2.419.290)	Barclays Bank Plc	13.03.2018	11.171	0,00 %
JPY	200.035.000	USD	(1.774.982)	Barclays Bank Plc	13.03.2018	6.867	0,00 %
JPY	200.970.000	USD	(1.783.521)	JP Morgan	13.03.2018	6.657	0,00 %
EUR	241.388	USD	(286.889)	UBS	21.03.2018	4.326	0,00 %
GBP	223.815	USD	(299.634)	BNP Paribas	21.03.2018	3.905	0,00 %
EUR	187.877	USD	(223.119)	UBS	21.03.2018	3.540	0,00 %
GBP	212.378	USD	(284.754)	Barclays Bank Plc	21.03.2018	3.274	0,00 %
EUR	212.340	USD	(253.395)	Barclays Bank Plc	21.03.2018	2.776	0,00 %
AUD	180.185	USD	(138.169)	BNP Paribas	20.03.2018	2.739	0,00 %
AUD	150.375	USD	(115.680)	BNP Paribas	20.03.2018	1.916	0,00 %
JPY	145.160.000	USD	(1.291.185)	JP Morgan	13.03.2018	1.855	0,00 %
USD	807.008	JPY	(90.425.000)	JP Morgan	13.03.2018	1.531	0,00 %
JPY	18.190.000	USD	(161.113)	BNP Paribas	13.03.2018	918	0,00 %
GBP	9.138	USD	(12.256)	BNP Paribas	21.03.2018	136	0,00 %
USD	615.071	GBP	(453.600)	UBS	21.03.2018	(104)	(0,00 %)
USD	648.308	JPY	(72.800.000)	UBS	13.03.2018	(171)	(0,00 %)
USD	854.177	EUR	(708.200)	UBS	21.03.2018	(208)	(0,00 %)
JPY	53.640.000	USD	(478.396)	BNP Paribas	13.03.2018	(588)	(0,00 %)
JPY	29.545.726	USD	(264.503)	Bank of America	13.03.2018	(1.318)	(0,00 %)
JPY	41.791.186	USD	(374.154)	BNP Paribas	13.03.2018	(1.892)	(0,00 %)
USD	304.238	GBP	(225.870)	JP Morgan	21.03.2018	(2.088)	(0,00 %)
USD	424.596	EUR	(354.100)	JP Morgan	21.03.2018	(2.596)	(0,00 %)
JPY	214.860.000	USD	(1.918.198)	JP Morgan	13.03.2018	(4.292)	(0,00 %)
USD	3.222.510	JPY	(362.300.000)	JP Morgan	13.03.2018	(4.745)	(0,00 %)
USD	802.809	GBP	(595.600)	JP Morgan	21.03.2018	(4.947)	(0,00 %)
JPY	105.750.000	USD	(947.182)	Barclays Bank Plc	13.03.2018	(5.194)	(0,00 %)
USD	1.754.506	JPY	(198.110.000)	Bank of America	13.03.2018	(10.196)	(0,00 %)
USD	3.208.435	JPY	(362.900.000)	JP Morgan	13.03.2018	(24.164)	(0,00 %)
USD	1.396.716	EUR	(1.178.100)	JP Morgan	21.03.2018	(24.565)	(0,00 %)
USD	1.498.752	AUD	(1.960.075)	JP Morgan	20.03.2018	(34.071)	(0,00 %)
USD	3.204.987	GBP	(2.391.840)	BNP Paribas	21.03.2018	(38.842)	(0,00 %)
USD	3.457.719	GBP	(2.585.800)	JP Morgan	21.03.2018	(49.159)	(0,00 %)
JPY	1.453.200.000	USD	(13.004.627)	BNP Paribas	13.03.2018	(59.979)	(0,00 %)

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
USD	5.260.529	EUR	(4.425.540)	JP Morgan	21.03.2018	(78.523)	(0,00 %)
USD	5.055.358	EUR	(4.281.600)	JP Morgan	21.03.2018	(110.042)	(0,00 %)
USD	5.964.843	AUD	(7.785.700)	Barclays Bank Plc	20.03.2018	(123.749)	(0,00 %)
						338.304	0,00 %
Offene Devisenterminkontrakte zu Absicherungszwecken auf Ebene der Anteilsklasse 0,07 % (2016: (0,05 %))							
EUR	1.075.823.061	USD	(1.285.414.910)	JP Morgan	03.01.2018	6.433.652	0,06 %
EUR	160.537.857	JPY	(21.430.835.837)	JP Morgan	05.01.2018	2.534.085	0,02 %
EUR	71.211.800	USD	(84.356.537)	BNP Paribas	03.01.2018	1.154.608	0,01 %
EUR	118.319.232	GBP	(104.294.972)	JP Morgan	03.01.2018	992.757	0,01 %
EUR	1.136.111.291	USD	(1.366.491.938)	JP Morgan	02.02.2018	347.280	0,00 %
EUR	39.589.385	USD	(47.296.373)	BNP Paribas	03.01.2018	242.569	0,00 %
EUR	10.310.116	USD	(12.152.060)	JP Morgan	03.01.2018	228.330	0,00 %
EUR	10.316.320	USD	(12.169.110)	JP Morgan	03.01.2018	218.729	0,00 %
EUR	10.333.556	USD	(12.214.573)	JP Morgan	03.01.2018	193.963	0,00 %
EUR	5.226.202	JPY	(694.029.227)	UBS	05.01.2018	114.787	0,00 %
EUR	12.051.274	USD	(14.357.044)	JP Morgan	03.01.2018	114.128	0,00 %
EUR	5.225.142	JPY	(694.029.227)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	113.514	0,00 %
EUR	3.736.843	JPY	(498.480.351)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	62.232	0,00 %
EUR	7.483.455	GBP	(6.601.552)	UBS	03.01.2018	55.886	0,00 %
EUR	120.407.471	GBP	(106.938.571)	JP Morgan	02.02.2018	45.985	0,00 %
EUR	2.048.957	USD	(2.421.252)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	39.135	0,00 %
EUR	1.509.240	JPY	(200.238.615)	JP Morgan	05.01.2018	34.795	0,00 %
EUR	1.503.739	JPY	(199.958.062)	UBS	05.01.2018	30.679	0,00 %
CAD	2.576.528	EUR	(1.689.439)	JP Morgan	03.01.2018	27.691	0,00 %
EUR	2.430.767	USD	(2.891.307)	JP Morgan	03.01.2018	27.558	0,00 %
EUR	3.481.120	CHF	(4.050.896)	BNP Paribas	04.01.2018	23.188	0,00 %
EUR	1.668.056	USD	(1.982.063)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	20.939	0,00 %
EUR	1.502.261	JPY	(200.986.692)	JP Morgan	05.01.2018	19.772	0,00 %
JPY	22.485.165.529	EUR	(166.205.500)	JP Morgan	05.01.2018	19.723	0,00 %
EUR	30.511.452	USD	(36.691.931)	BNP Paribas	02.02.2018	15.960	0,00 %
AUD	1.227.702	EUR	(788.640)	JP Morgan	03.01.2018	13.248	0,00 %
AUD	1.962.025	EUR	(1.268.344)	JP Morgan	03.01.2018	11.571	0,00 %
AUD	655.192	EUR	(417.744)	UBS	03.01.2018	10.832	0,00 %
EUR	1.080.023	GBP	(950.993)	JP Morgan	03.01.2018	10.437	0,00 %
CAD	1.739.807	EUR	(1.148.632)	JP Morgan	03.01.2018	9.291	0,00 %
CAD	711.351	EUR	(465.322)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	8.983	0,00 %
SEK	4.919.347	EUR	(493.643)	JP Morgan	03.01.2018	8.070	0,00 %
EUR	1.752.881	JPY	(236.240.340)	JP Morgan	05.01.2018	7.771	0,00 %
CAD	1.612.216	EUR	(1.065.702)	JP Morgan	03.01.2018	7.041	0,00 %
EUR	299.621	JPY	(39.840.886)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	6.121	0,00 %
EUR	1.081.652	GBP	(955.885)	JP Morgan	03.01.2018	5.774	0,00 %
AUD	363.237	EUR	(232.292)	JP Morgan	03.01.2018	5.170	0,00 %
EUR	1.077.125	GBP	(952.327)	JP Morgan	03.01.2018	5.152	0,00 %
AUD	541.694	EUR	(348.931)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	4.690	0,00 %
EUR	294.231	USD	(348.788)	JP Morgan	03.01.2018	4.525	0,00 %
CAD	860.397	EUR	(568.265)	Bank of America	03.01.2018	4.324	0,00 %
EUR	355.207	JPY	(47.575.483)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	4.208	0,00 %
SEK	3.321.801	EUR	(334.415)	JP Morgan	03.01.2018	4.150	0,00 %
EUR	501.966	CHF	(583.556)	JP Morgan	04.01.2018	3.929	0,00 %
EUR	66.188.950	CAD	(99.722.192)	JP Morgan	02.02.2018	3.561	0,00 %
AUD	1.324.862	EUR	(860.558)	JP Morgan	03.01.2018	2.883	0,00 %
SEK	3.078.192	EUR	(310.827)	JP Morgan	03.01.2018	2.721	0,00 %
SEK	1.642.751	EUR	(165.016)	UBS	03.01.2018	2.490	0,00 %
EUR	256.881	GBP	(226.267)	JP Morgan	03.01.2018	2.380	0,00 %
EUR	215.440	GBP	(189.482)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	2.379	0,00 %
EUR	49.371.705	AUD	(75.938.422)	JP Morgan	02.02.2018	2.033	0,00 %
SEK	1.358.178	EUR	(136.567)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	1.895	0,00 %
EUR	500.773	CHF	(584.374)	JP Morgan	04.01.2018	1.657	0,00 %
EUR	3.789.388	JPY	(512.612.480)	JP Morgan	02.02.2018	1.593	0,00 %
SEK	910.736	EUR	(91.317)	JP Morgan	03.01.2018	1.581	0,00 %
EUR	242.181	JPY	(32.614.188)	BNP Paribas	05.01.2018	1.297	0,00 %
EUR	168.173	USD	(200.770)	BNP Paribas	03.01.2018	1.172	0,00 %
EUR	502.180	CHF	(586.558)	JP Morgan	04.01.2018	1.105	0,00 %
CAD	477.002	EUR	(316.182)	JP Morgan	03.01.2018	1.031	0,00 %
NOK	1.161.801	EUR	(117.442)	JP Morgan	03.01.2018	1.016	0,00 %
EUR	4.574.319	NOK	(44.966.451)	JP Morgan	02.02.2018	577	0,00 %

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf- betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
NOK	320.761	EUR	(32.185)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	568	0,00 %
EUR	108.502	ILS	(450.437)	BNP Paribas	03.01.2018	541	0,00 %
EUR	42.780	JPY	(5.739.197)	JP Morgan	05.01.2018	424	0,00 %
EUR	520.004	AUD	(797.847)	JP Morgan	03.01.2018	385	0,00 %
EUR	118.968	CHF	(138.844)	JP Morgan	04.01.2018	378	0,00 %
EUR	1.749.395	ILS	(7.296.625)	JP Morgan	02.02.2018	336	0,00 %
EUR	18.543	ILS	(76.662)	JP Morgan	03.01.2018	184	0,00 %
AUD	75.938.422	EUR	(49.462.907)	JP Morgan	03.01.2018	174	0,00 %
NOK	215.088	EUR	(21.777)	JP Morgan	03.01.2018	146	0,00 %
EUR	1.283.447	CAD	(1.933.603)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	129	0,00 %
EUR	839.906	AUD	(1.291.750)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	117	0,00 %
EUR	24.509	JPY	(3.303.598)	JP Morgan	05.01.2018	105	0,00 %
EUR	30.815	GBP	(27.295)	JP Morgan	03.01.2018	79	0,00 %
EUR	1.434.762	CHF	(1.678.836)	JP Morgan	04.01.2018	77	0,00 %
EUR	15.644	ILS	(64.979)	JP Morgan	03.01.2018	69	0,00 %
EUR	8.134	NOK	(79.675)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	27	0,00 %
EUR	3.726	ILS	(15.439)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	27	0,00 %
EUR	15.664	ILS	(65.222)	JP Morgan	03.01.2018	22	0,00 %
EUR	2.556	ILS	(10.584)	BNP Paribas	03.01.2018	21	0,00 %
EUR	15.581	ILS	(64.888)	JP Morgan	03.01.2018	19	0,00 %
EUR	3.116	ILS	(12.929)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	18	0,00 %
EUR	7.280	AUD	(11.157)	JP Morgan	03.01.2018	16	0,00 %
EUR	9.748	CAD	(14.652)	JP Morgan	03.01.2018	11	0,00 %
EUR	8.248	CHF	(9.641)	JP Morgan	04.01.2018	11	0,00 %
EUR	451	ILS	(1.862)	JP Morgan	03.01.2018	5	0,00 %
EUR	258	ILS	(1.072)	JP Morgan	03.01.2018	1	0,00 %
ILS	117.965	EUR	(28.297)	JP Morgan	03.01.2018	-	0,00 %
USD	7.140.355	EUR	(5.946.332)	Brown Brothers Harriman	03.01.2018	(1)	(0,00 %)
EUR	671	NOK	(6.607)	JP Morgan	03.01.2018	(2)	(0,00 %)
NOK	44.966.451	EUR	(4.578.248)	JP Morgan	03.01.2018	(3)	(0,00 %)
SEK	187.998.137	EUR	(19.121.922)	JP Morgan	03.01.2018	(4)	(0,00 %)
EUR	1.164	NOK	(11.477)	JP Morgan	03.01.2018	(6)	(0,00 %)
EUR	124.761	NOK	(1.226.603)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(7)	(0,00 %)
EUR	12.620	AUD	(19.383)	JP Morgan	03.01.2018	(7)	(0,00 %)
EUR	14.306	CHF	(16.749)	JP Morgan	04.01.2018	(9)	(0,00 %)
EUR	2.837	SEK	(27.974)	JP Morgan	03.01.2018	(10)	(0,00 %)
EUR	19.335	ILS	(80.641)	JP Morgan	03.01.2018	(11)	(0,00 %)
SEK	2.400.765	EUR	(244.203)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(16)	(0,00 %)
EUR	17.685	GBP	(15.712)	JP Morgan	03.01.2018	(19)	(0,00 %)
EUR	81.137	ILS	(338.545)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(21)	(0,00 %)
EUR	40.753	NOK	(400.443)	JP Morgan	03.01.2018	(21)	(0,00 %)
EUR	99.340	CHF	(116.271)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	(27)	(0,00 %)
EUR	4.916	SEK	(48.598)	JP Morgan	03.01.2018	(33)	(0,00 %)
ILS	52.049	EUR	(12.520)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(41)	(0,00 %)
NOK	726.976	EUR	(74.052)	JP Morgan	03.01.2018	(42)	(0,00 %)
EUR	820.576	CHF	(959.926)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(45)	(0,00 %)
EUR	9.648	NOK	(95.143)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(46)	(0,00 %)
EUR	19.122.850	SEK	(187.998.137)	JP Morgan	02.02.2018	(52)	(0,00 %)
ILS	34.902	EUR	(8.426)	JP Morgan	03.01.2018	(64)	(0,00 %)
ILS	127.301	EUR	(30.592)	JP Morgan	03.01.2018	(66)	(0,00 %)
ILS	7.296.625	EUR	(1.750.378)	JP Morgan	03.01.2018	(80)	(0,00 %)
ILS	62.955	EUR	(15.174)	JP Morgan	03.01.2018	(87)	(0,00 %)
EUR	16.843	CAD	(25.453)	JP Morgan	03.01.2018	(89)	(0,00 %)
EUR	6.555	NOK	(65.223)	BNP Paribas	03.01.2018	(102)	(0,00 %)
EUR	40.571	NOK	(399.882)	JP Morgan	03.01.2018	(171)	(0,00 %)
NOK	387.968	EUR	(39.665)	JP Morgan	03.01.2018	(197)	(0,00 %)
EUR	47.936	NOK	(472.440)	JP Morgan	03.01.2018	(199)	(0,00 %)
USD	1.366.491.938	EUR	(1.137.984.625)	JP Morgan	03.01.2018	(243)	(0,00 %)
EUR	81.133	CHF	(95.181)	BNP Paribas	04.01.2018	(248)	(0,00 %)
EUR	174.515	GBP	(155.112)	BNP Paribas	03.01.2018	(270)	(0,00 %)
EUR	40.669	NOK	(401.939)	JP Morgan	03.01.2018	(305)	(0,00 %)
CHF	468.093	EUR	(400.281)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	(311)	(0,00 %)
ILS	188.523	EUR	(45.498)	JP Morgan	03.01.2018	(331)	(0,00 %)
EUR	40.580	SEK	(402.858)	UBS	03.01.2018	(475)	(0,00 %)
EUR	27.674	SEK	(276.169)	BNP Paribas	03.01.2018	(499)	(0,00 %)
EUR	71.324	AUD	(110.147)	BNP Paribas	03.01.2018	(506)	(0,00 %)

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
NOK	784.509	EUR	(80.303)	JP Morgan	03.01.2018	(514)	(0,00 %)
EUR	203.040	SEK	(2.000.426)	JP Morgan	03.01.2018	(516)	(0,00 %)
EUR	95.688	CAD	(144.645)	BNP Paribas	03.01.2018	(542)	(0,00 %)
GBP	106.938.571	EUR	(120.471.088)	JP Morgan	03.01.2018	(578)	(0,00 %)
EUR	33.794	SEK	(337.363)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(625)	(0,00 %)
EUR	1.687.002	ILS	(7.035.605)	JP Morgan	03.01.2018	(836)	(0,00 %)
EUR	56.096.383	CHF	(65.620.483)	JP Morgan	02.02.2018	(853)	(0,00 %)
CHF	566.170	EUR	(484.633)	BNP Paribas	04.01.2018	(955)	(0,00 %)
EUR	139.376	CAD	(210.998)	JP Morgan	03.01.2018	(1.038)	(0,00 %)
CHF	313.883	EUR	(269.135)	JP Morgan	04.01.2018	(1.077)	(0,00 %)
EUR	53.255.986	CHF	(62.319.463)	JP Morgan	04.01.2018	(1.093)	(0,00 %)
EUR	116.510	CAD	(176.695)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(1.118)	(0,00 %)
GBP	762.828	EUR	(860.329)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(1.168)	(0,00 %)
EUR	1.264.726	GBP	(1.123.550)	JP Morgan	03.01.2018	(1.198)	(0,00 %)
EUR	281.385	NOK	(2.775.877)	BNP Paribas	03.01.2018	(1.489)	(0,00 %)
EUR	694.736	CAD	(1.047.731)	JP Morgan	03.01.2018	(1.972)	(0,00 %)
CHF	65.620.483	EUR	(56.079.652)	JP Morgan	04.01.2018	(2.130)	(0,00 %)
EUR	170.346	SEK	(1.693.196)	JP Morgan	03.01.2018	(2.251)	(0,00 %)
EUR	85.671	AUD	(134.553)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(2.367)	(0,00 %)
EUR	102.566	AUD	(160.675)	JP Morgan	03.01.2018	(2.510)	(0,00 %)
EUR	438.341	AUD	(676.259)	JP Morgan	03.01.2018	(2.576)	(0,00 %)
EUR	586.671	CHF	(689.441)	JP Morgan	04.01.2018	(3.015)	(0,00 %)
EUR	169.543	SEK	(1.695.572)	JP Morgan	03.01.2018	(3.505)	(0,00 %)
EUR	587.209	CAD	(888.063)	JP Morgan	03.01.2018	(3.657)	(0,00 %)
CAD	99.722.192	EUR	(66.283.935)	JP Morgan	03.01.2018	(3.842)	(0,00 %)
EUR	169.892	SEK	(1.701.906)	JP Morgan	03.01.2018	(3.860)	(0,00 %)
EUR	585.715	CAD	(886.818)	JP Morgan	03.01.2018	(4.458)	(0,00 %)
EUR	436.136	AUD	(675.312)	JP Morgan	03.01.2018	(4.483)	(0,00 %)
CHF	1.144.850	EUR	(982.309)	JP Morgan	04.01.2018	(4.737)	(0,00 %)
CHF	1.060.891	EUR	(911.587)	BNP Paribas	04.01.2018	(5.971)	(0,00 %)
GBP	511.520	EUR	(581.314)	JP Morgan	03.01.2018	(6.083)	(0,00 %)
EUR	587.098	CAD	(891.380)	JP Morgan	03.01.2018	(6.437)	(0,00 %)
CHF	1.695.440	EUR	(1.454.563)	JP Morgan	04.01.2018	(6.816)	(0,00 %)
JPY	160.394.102	EUR	(1.191.396)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	(6.822)	(0,00 %)
EUR	4.272.363	GBP	(3.801.087)	JP Morgan	02.02.2018	(7.353)	(0,00 %)
EUR	433.097	AUD	(678.786)	JP Morgan	03.01.2018	(10.850)	(0,00 %)
GBP	2.762.978	EUR	(3.122.143)	JP Morgan	03.01.2018	(11.452)	(0,00 %)
JPY	107.553.426	EUR	(804.942)	JP Morgan	05.01.2018	(11.832)	(0,00 %)
GBP	922.660	EUR	(1.049.504)	UBS	03.01.2018	(12.117)	(0,00 %)
GBP	1.728.883	EUR	(1.962.027)	JP Morgan	03.01.2018	(17.256)	(0,00 %)
EUR	1.180.776	SEK	(11.753.741)	BNP Paribas	03.01.2018	(17.695)	(0,00 %)
EUR	661.661	CAD	(1.018.083)	JP Morgan	03.01.2018	(18.026)	(0,00 %)
EUR	3.037.255	AUD	(4.687.845)	BNP Paribas	03.01.2018	(19.462)	(0,00 %)
JPY	194.000.730	EUR	(1.453.905)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	(23.720)	(0,00 %)
EUR	166.138.330	JPY	(22.485.165.529)	JP Morgan	02.02.2018	(25.032)	(0,00 %)
GBP	1.865.707	EUR	(2.125.765)	JP Morgan	03.01.2018	(28.784)	(0,00 %)
EUR	4.432.325	NOK	(43.854.848)	JP Morgan	03.01.2018	(39.317)	(0,00 %)
EUR	1.418.216	AUD	(2.232.870)	JP Morgan	03.01.2018	(43.446)	(0,00 %)
JPY	363.519.233	EUR	(2.724.782)	JP Morgan	05.01.2018	(44.987)	(0,00 %)
EUR	4.046.688	CAD	(6.156.069)	BNP Paribas	03.01.2018	(53.996)	(0,00 %)
JPY	392.288.181	EUR	(2.955.639)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	(66.823)	(0,00 %)
JPY	580.950.502	EUR	(4.352.129)	Bank of America	05.01.2018	(68.987)	(0,00 %)
USD	6.536.349	EUR	(5.503.988)	JP Morgan	03.01.2018	(72.841)	(0,00 %)
USD	9.747.638	EUR	(8.189.605)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(86.441)	(0,00 %)
EUR	18.697.257	SEK	(185.692.104)	JP Morgan	03.01.2018	(228.282)	(0,00 %)
USD	11.790.015	EUR	(10.014.861)	BNP Paribas	03.01.2018	(235.832)	(0,00 %)
USD	23.840.547	EUR	(20.200.258)	JP Morgan	03.01.2018	(415.928)	(0,00 %)
USD	22.092.170	EUR	(18.794.281)	JP Morgan	03.01.2018	(476.007)	(0,00 %)
USD	35.306.130	EUR	(29.836.956)	JP Morgan	03.01.2018	(522.093)	(0,00 %)
EUR	45.621.665	AUD	(71.828.300)	JP Morgan	03.01.2018	(1.398.007)	(0,01 %)
EUR	62.545.432	CAD	(96.238.906)	JP Morgan	03.01.2018	(1.705.287)	(0,02 %)
						7.524.882	0,07 %
Summe Derivative Finanzinstrumente						7.454.340	0,07 %

	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva	120.493.063	1,10 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	10.912.712.246	100,00 %

ADR – American Depositary Receipt.

REIT – Real Estate Investment Trust.

Analyse des Gesamtvermögens	US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	10.730.208.446	98,33 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	54.556.397	0,50 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente	7.454.340	0,07 %
(e) Sonstige Aktiva und Passiva	120.493.063	1,10 %
Gesamtvermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	10.912.712.246	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Anteile	Kosten US-Dollar (\$)		Anteile	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
Apple, Inc.	187.676	27.912.063	Apple, Inc.	237.595	34.212.251
Microsoft Corp.	260.818	18.311.378	Microsoft Corp.	271.315	18.565.249
Amazon.com, Inc.	15.594	14.806.661	Yahoo!, Inc.	251.788	12.929.623
Facebook, Inc. Klasse A	96.011	14.604.547	Johnson & Johnson	101.253	12.863.447
Exxon Mobil Corp.	180.551	14.592.351	JPMorgan Chase & Co.	141.873	12.655.251
Johnson & Johnson	92.357	11.774.211	Exxon Mobil Corp.	148.617	12.361.320
Alphabet, Inc. Klasse C	12.725	11.499.082	Amazon.com, Inc.	13.489	12.200.426
JPMorgan Chase & Co.	123.653	11.135.243	Facebook, Inc. Klasse A	80.297	11.501.533
US Treasury Bill 0,00 % 20.7.2017	10.000.000	9.973.634	US Treasury Bill 0,00 % 12.1.2017	11.000.000	10.999.847
Alphabet, Inc. Klasse A	10.531	9.731.979	General Electric Co.	388.599	10.922.208
Wells Fargo & Co.	171.558	9.460.062	Wells Fargo & Co.	184.405	10.038.021
Bank of America Corp.	370.367	9.056.410	Alphabet, Inc. Klasse C	11.291	9.950.172
Berkshire Hathaway, Inc. Klasse B	50.860	8.855.187	Bank of America Corp.	403.627	9.488.783
General Electric Co.	324.007	8.810.505	Citigroup, Inc.	145.729	9.124.952
AT&T, Inc.	221.891	8.785.017	Home Depot, Inc.	57.403	8.715.533
Nestle SA	107.291	8.569.811	AT&T, Inc.	212.776	8.494.118
Procter & Gamble Co.	87.431	7.824.007	Alphabet, Inc. Klasse A	9.132	8.232.346
Chevron Corp.	71.264	7.780.993	Pfizer, Inc.	242.210	8.192.271
Walt Disney Co.	69.371	7.550.069	Nestle SA	100.354	7.996.157
Pfizer, Inc.	217.998	7.409.172	Procter & Gamble Co.	84.570	7.464.105

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	10.784.764.843	8.963.165.558
Derivative Finanzinstrumente	14.370.827	4.944.538
Barmittel	107.521.696	45.914.629
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	13.317.209	12.060.000
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	17.031.214	16.389.877
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	4.323.514	—
Bareinschüsse für Futures	4.950.895	5.189.217
Barsicherheiten	1.477.000	—
Sonstige Forderungen	2.373	—
Summe Umlaufvermögen	10.947.759.571	9.047.663.819
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	6.916.487	9.617.067
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	3.681	44.590
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	192.299	45.878
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	25.724.294	87.371.817
Zahlbare Verwaltungsgebühren	2.210.564	1.817.954
Summe kurzfristige Passiva	35.047.325	98.897.306
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	10.912.712.246	8.948.766.513

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	1.817.645.995	2.013.643.242	1.895.712.557
Nettovermögen	1.513.695.876	1.909.119.017	1.745.109.607
Anzahl der umlaufenden Anteile	66.501.948	90.058.961	91.007.796
Nettoinventarwert je Anteil	22,76	21,20	19,18
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	5.604.386.131	4.034.110.476	3.691.021.012
Anzahl der umlaufenden Anteile	204.096.268	179.586.700	176.374.343
Nettoinventarwert je Anteil	27,46	22,46	20,93
EUR-Anlegeranteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	155.700.644	115.950.842	106.423.400
Nettovermögen	129.664.095	109.932.064	97.968.702
Anzahl der umlaufenden Anteile	5.771.364	5.251.267	5.170.985
Nettoinventarwert je Anteil	22,47	20,93	18,95
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	6.800	—	—
Nettovermögen	5.027	—	—
Anzahl der umlaufenden Anteile	50	—	—
Nettoinventarwert je Anteil	100,54	—	—
USD-Anlegeranteile (\$)			
Nettovermögen	202.169.665	168.893.281	234.124.911
Anzahl der umlaufenden Anteile	7.491.719	7.646.807	11.372.641
Nettoinventarwert je Anteil	26,99	22,09	20,59
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	697.028.416	938.010.984	549.085.470
Nettovermögen	580.470.037	889.320.695	505.463.935
Anzahl der umlaufenden Anteile	3.617.116	5.956.252	3.746.287
Nettoinventarwert je Anteil	160,48	149,31	134,92
Institutionelle Plus USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	147.219.880	88.812.164	38.107.876
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.049.429	774.657	357.148
Nettoinventarwert je Anteil	140,29	114,65	106,70
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR (€)			
Gegenwert in US (\$)	2.288.554.715	1.589.345.524	2.104.537.263
Nettovermögen	1.905.858.370	1.506.845.751	1.937.344.447
Anzahl der umlaufenden Anteile	98.950.445	91.316.893	126.346.326
Nettoinventarwert je Anteil	19,26	16,50	15,33

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	316.085	342.410
Dividenden	245.815.818	223.222.039
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	1.764.364	2.605.760
Verschiedene Erträge	873.267	356.711
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	1.934.561.486	360.385.318
Summe Anlageerträge/(-verluste)	2.183.331.020	586.912.238
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	23.867.069	20.102.858
Transaktionsgebühren und Provisionen	1.102.628	698.728
Sonstige Aufwendungen	51.122	29.484
Summe Aufwendungen	25.020.819	20.831.070
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	6.850	20.556
Summe Finanzierungskosten	6.850	20.556
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2.158.303.351	566.060.612
Ausländische Quellensteuer	(44.756.666)	(41.371.984)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	2.113.546.685	524.688.628

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	2.113.546.685	524.688.628
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	3.209.949.940	3.034.156.589
Rücknahmen	(3.359.550.892)	(3.229.091.193)
Summe Kapitalgeschäfte	(149.600.952)	(194.934.604)
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	1.963.945.733	329.754.024
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	8.948.766.513	8.619.012.489
Zum Jahresende	10.912.712.246	8.948.766.513

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Japan Stock Index Fund

Verwaltet durch The Vanguard Group, Inc.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Anlageziel

Der Fonds strebt die Nachbildung der Wertentwicklung des MSCI Japan Index an, dessen Schwerpunkt auf den Aktien von Unternehmen liegt, die in Japan ansässig sind.

Portfoliomerkmale

	Fonds	MSCI Japan Index
Anzahl der Aktien	321	321
Mittlere Marktkapitalisierung		
US-Dollar	\$ 24,2 Mrd.	\$ 24,2 Mrd.
Euro	€ 20,1 Mrd.	€ 20,1 Mrd.
Yen	¥ 2.720,5 Mrd.	¥ 2.720,5 Mrd.
Britisches Pfund	£ 17,9 Mrd.	£ 17,9 Mrd.
Kurs/Gewinn-Verhältnis	16,0x	16,0x
Kurs/Buch-Verhältnis	1,5x	1,5x
Rendite	1,9 %	1,9 %
Eigenkapitalrendite	9,2 %	9,2 %
Ertragszuwachsrate	18,1 %	18,1 %
Portfolioumschlag ¹	-20 %	—
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,23 %	
Anlegeranteile	0,30 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,20 %	
Thesaurierende Anteile	0,23 %	
Ausschüttende Anteile	0,23 %	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,20 %	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,20 %	
Kurzfristige Reserven	0,0 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	MSCI Japan Index
R ²	1,00	1,00
Beta	1,00	1,00

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI Japan Index
Luxusgüter	20,2 %	20,2 %
Grundbedarfsgüter	7,6	7,6
Energie	1,1	1,1
Finanzwerte	12,8	12,8
Gesundheitswesen	7,0	7,0
Industriegüter	21,6	21,6
Informationstechnologie	12,7	12,7
Grundstoffe	6,7	6,7
Immobilien	3,9	3,9
Telekommunikationsdienste	4,8	4,8
Versorger	1,6	1,6

Die 10 grössten Positionen² (% des Gesamt Nettovermögens)

Toyota Motor Corp.	Automobilhersteller	4,6 %
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	Diversifizierte Banken	2,4
SoftBank Group Corp.	Mobilfunkdienste	1,8
Honda Motor Co. Ltd.	Automobilhersteller	1,6
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc.	Diversifizierte Banken	1,6
Sony Corp.	Verbraucherelektronik	1,6
Keyence Corp.	Elektronikgeräte	1,5
FANUC Corp.	Fabrikautomationsanlagen	1,3
KDDI Corp.	Mobilfunkdienste	1,2
Mizuho Financial Group Inc.	Diversifizierte Banken	1,2
Zehn grösste Positionen		18,8 %

Anlagefokus

Stil	Wert	Mischung	Wachstum
Marktkapitalisierung	Gross		
	Mittel		
	Klein		

¹ Ein negativer Portfolioumschlag deutet darauf hin, dass der Gesamtwert der Zeichnungen und Rückkäufe über dem Wert der Wertpapiertransaktionen gelegen hat.

² Die aufgeführten Positionen schliessen etwaige vorübergehende Baranlagen und Aktienindexprodukte aus.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

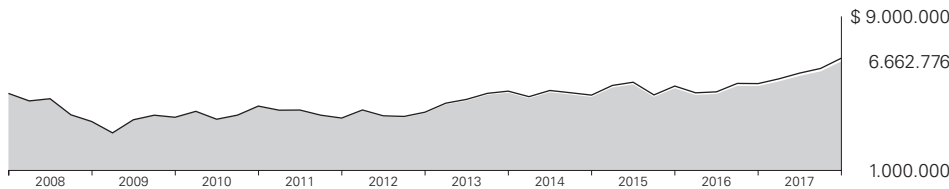
Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

Japan Stock Index Fund
Benchmark: MSCI Japan Index

In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000



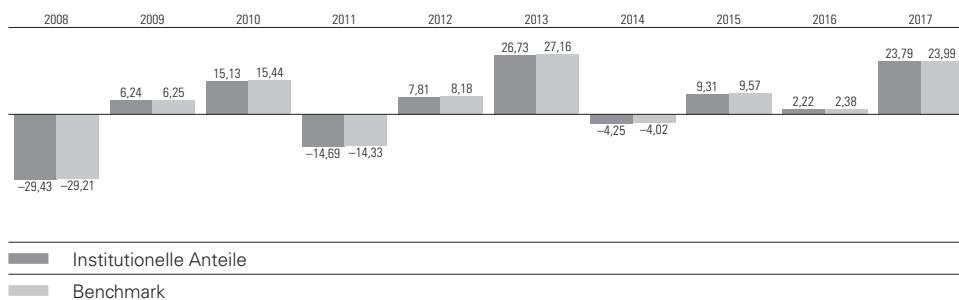
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
— Institutionelle Anteile	23,79 %	10,91 %	2,91 %	\$ 6.662.776
— Benchmark	23,99	11,16	3,17	6.829.472

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen			Endwert einer Anlage von \$ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Anlegeranteile	23,70 %	10,84 %	2,83 %	\$ 132.147
Benchmark	23,99	11,16	3,17	136.589

	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von \$ 200.000.000
	Institutionelle Plus-Anteile	23,82 %	
Benchmark	23,99	16,63	244.699.064

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,20 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,29 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,17 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



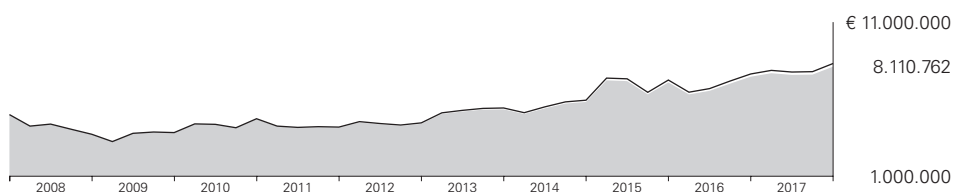
¹ 8. September 2016.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Japan Stock Index Fund
Benchmark: MSCI Japan Index

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



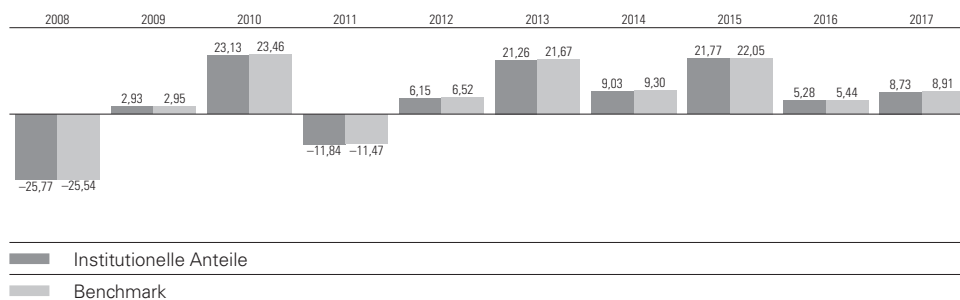
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
— Institutionelle Anteile	8,73 %	13,00 %	4,96 %	€ 8.110.762
— Benchmark	8,91	13,26	5,22	8.315.317

	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von € 100.000
				€ 192.113
Anlegeranteile	8,65 %	12,93 %	7,19 %	€ 192.113
Benchmark	8,91	13,26	7,54	198.062

	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von € 200.000.000
			€ 311.630.000
Institutionelle Plus-Anteile	8,76 %	11,52 %	€ 311.630.000
Benchmark	8,91	11,70	313.681.404

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,18 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,26 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,15 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



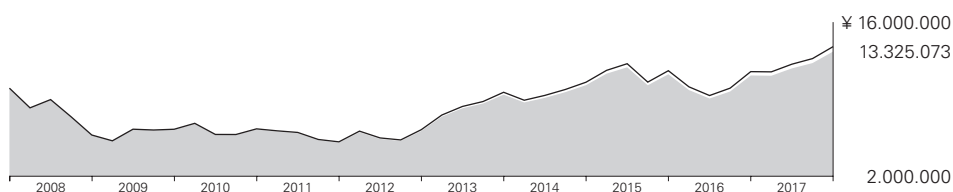
¹ Für Anlegeranteile, 6. August 2008; für Institutionelle Plus-Anteile, 6. Dezember 2013.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Japan Stock Index Fund
 Benchmark: MSCI Japan Index

In japanischen Yen

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. ¥ 10.000.000



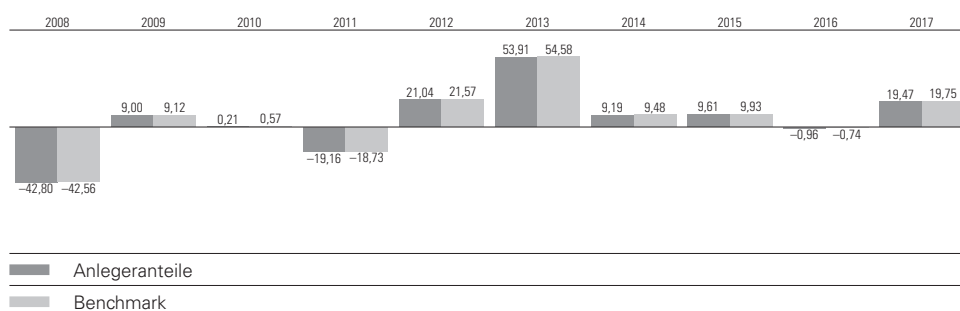
	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von ¥ 10.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
■ Anlegeranteile	19,47 %	16,86 %	2,91 %	¥ 13.325.073
— Benchmark	19,75	17,20	3,25	13.773.263

	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von ¥ 500.000.000
Benchmark	19,75	6,93	603.666.283

	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von ¥ 20.000.000.000
Benchmark	19,75	11,77	30.664.012.051

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,19 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,28 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,16 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



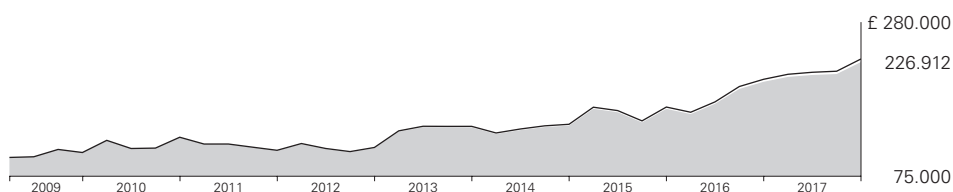
¹ Für institutionelle Anteile, 10. März 2015; für institutionelle Plus-Anteile, 27. Februar 2014.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Japan Stock Index Fund
Benchmark: MSCI Japan Index

In GBP

Kumulative Wertentwicklung: 23. Juni 2009–31. Dezember 2017
Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile	13,07 %	15,08 %	10,09 %	£ 226.912
Benchmark	13,25	15,32	10,32	231.006

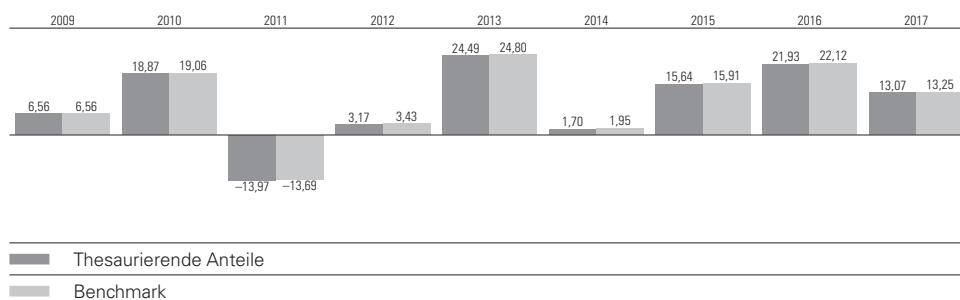
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Ausschüttende Anteile	13,07 %	15,08 %	10,09 %	£ 226.917
Benchmark	13,25	15,32	10,32	231.006

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	13,10 %	15,82 %	10,09 %	£ 326.062.800
Benchmark	13,25	16,00	10,32	327.805.358

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	13,10 %	15,82 %	10,09 %	£ 326.111.656
Benchmark	13,25	16,00	10,32	327.805.358

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,18 Prozentpunkte für Thesaurierungsanteile und Ertragsanteile und 0,15 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile und institutionelle Plus-Ertragsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 23. Juni 2009–31. Dezember 2017



¹ Für Thesaurierungs- und Ertragsanteile, 23. Juni 2009; für institutionelle Plus-Thesaurierungs- und institutionelle Plus-Ertragsanteile; 2. September 2014.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens
Aktien 99,45 % (2016: 99,38 %)				Nicht-zyklische Konsumgüter 7,58 % (2016: 7,44 %)			
Zyklische Konsumgüter 20,07 % (2016: 20,80 %)							
Toyota Motor Corp.	2.927.954	156.127.102	4,59 %	Japan Tobacco, Inc.	1.233.775	33.117.713	0,97 %
Honda Motor Co., Ltd.	1.930.147	55.106.239	1,62 %	KAO Corp.	555.218	31.272.286	0,92 %
Sony Corp.	1.418.166	53.289.948	1,57 %	Seven & i Holdings Co., Ltd.	845.104	29.257.178	0,86 %
Panasonic Corp.	2.476.326	30.196.615	0,89 %	Kirin Holdings Co., Ltd.	973.925	20.451.183	0,60 %
Bridgestone Corp.	729.559	28.250.363	0,83 %	Asahi Group Holdings Ltd.	433.959	17.933.234	0,53 %
Denso Corp.	534.366	26.716.301	0,79 %	Shiseido Co., Ltd.	426.260	17.161.306	0,51 %
Nissan Motor Co., Ltd.	2.603.788	21.626.031	0,64 %	Unicharm Corp.	452.606	9.801.937	0,29 %
Fast Retailing Co., Ltd.	59.494	19.752.149	0,58 %	MEIJI Holdings Co., Ltd.	136.982	9.711.364	0,29 %
Suzuki Motor Corp.	385.497	18.620.796	0,55 %	Aeon Co., Ltd.	684.574	9.628.157	0,28 %
Oriental Land Co., Ltd.	244.792	18.585.138	0,55 %	Ajinomoto Co., Inc.	609.328	9.554.103	0,28 %
Subaru Corp.	690.192	18.281.627	0,54 %	Yakult Honsha Co., Ltd.	98.664	6.199.773	0,18 %
Sumitomo Electric Industries Ltd.	845.972	11.913.767	0,35 %	Suntory Beverage & Food Ltd.	155.953	5.776.032	0,17 %
Nitori Holdings Co., Ltd.	89.898	10.676.499	0,31 %	Kikkoman Corp.	165.145	5.567.092	0,16 %
Sekisui House Ltd.	658.466	9.908.378	0,29 %	FamilyMart UNY Holdings Co., Ltd.	92.402	5.396.430	0,16 %
Toyota Industries Corp.	182.783	9.783.010	0,29 %	Tsuruha Holdings, Inc.	41.241	4.670.744	0,14 %
Shimano, Inc.	83.249	9.754.531	0,29 %	Kose Corp.	34.012	4.422.788	0,13 %
Aisin Seiki Co., Ltd.	198.291	9.279.078	0,27 %	Coca-Cola Bottlers Japan, Inc.	138.843	4.223.689	0,12 %
Isuzu Motors Ltd.	618.564	8.628.885	0,25 %	NH Foods Ltd.	203.213	4.128.253	0,12 %
Yamaha Motor Co., Ltd.	314.009	8.577.380	0,25 %	Nissin Foods Holdings Co., Ltd.	65.900	4.009.437	0,12 %
Dentsu, Inc.	242.665	8.566.011	0,25 %	Lion Corp.	251.672	3.972.198	0,12 %
Rakuten, Inc.	1.045.337	7.978.927	0,23 %	Nisshin Seifun Group, Inc.	222.022	3.735.652	0,11 %
Sekisui Chemical Co., Ltd.	449.097	7.509.843	0,22 %	Toyo Suisan Kaisha Ltd.	99.636	3.546.588	0,10 %
Koito Manufacturing Co., Ltd.	126.233	7.390.881	0,22 %	Sundrug Co., Ltd.	82.870	3.210.161	0,10 %
Mazda Motor Corp.	637.811	7.126.861	0,21 %	Lawson, Inc.	56.274	3.115.930	0,09 %
Ryohin Keikaku Co., Ltd.	26.788	6.950.972	0,20 %	Pola Orbis Holdings, Inc.	103.107	3.014.621	0,09 %
Nikon Corp.	382.229	6.414.275	0,19 %	Calbee, Inc.	90.105	2.441.299	0,07 %
Bandai Namco Holdings, Inc.	224.062	6.103.850	0,18 %	Yamazaki Baking Co., Ltd.	148.213	2.407.213	0,07 %
Don Quijote Holdings Co., Ltd.	133.060	5.793.766	0,17 %			257.726.361	7,58 %
Yamaha Corp.	188.082	5.784.138	0,17 %	Energie 1,09 % (2016: 0,87 %)			
Stanley Electric Co., Ltd.	158.209	5.350.821	0,16 %	JXTG Holdings, Inc.	3.459.380	18.592.201	0,55 %
Start Today Co., Ltd.	209.688	5.309.239	0,16 %	Inpex Corp.	1.066.131	11.105.029	0,32 %
Sharp Corp.	167.651	4.796.398	0,14 %	Idemitsu Kosan Co., Ltd.	151.620	5.071.929	0,15 %
Mitsubishi Motors Corp.	752.229	4.526.605	0,13 %	Showa Shell Sekiyu KK	211.300	2.389.951	0,07 %
USS Co., Ltd.	245.986	4.338.893	0,13 %			37.159.110	1,09 %
J Front Retailing Co., Ltd.	273.331	4.289.800	0,13 %	Finanztitel 12,68 % (2016: 13,85 %)			
Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd.	376.950	3.892.945	0,11 %	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	13.373.937	81.704.824	2,40 %
Toho Co., Ltd.	127.179	3.671.424	0,11 %	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	1.507.163	54.238.655	1,60 %
NGK Spark Plug Co., Ltd.	178.793	3.620.267	0,11 %	Mizuho Financial Group, Inc.	27.054.187	40.920.246	1,20 %
Marui Group Co., Ltd.	222.785	3.397.686	0,10 %	Tokio Marine Holdings, Inc.	760.131	28.889.110	0,85 %
Yamada Denki Co., Ltd.	706.713	3.244.388	0,10 %	ORIX Corp.	1.485.196	20.910.425	0,61 %
Sumitomo Rubber Industries Ltd.	191.862	2.972.887	0,09 %	Dai-ichi Life Holdings, Inc.	1.209.408	20.778.160	0,61 %
Takashimaya Co., Ltd.	338.218	2.965.374	0,09 %	Nomura Holdings, Inc.	4.073.163	20.027.044	0,59 %
Hikari Tsushin, Inc.	24.088	2.884.788	0,08 %	Japan Post Holdings Co., Ltd.	1.766.611	16.873.360	0,50 %
Rinnai Corp.	37.608	2.835.819	0,08 %	MS&AD Insurance Group Holdings, Inc.	532.358	15.010.066	0,44 %
Hakuhodo DY Holdings, Inc.	261.633	2.829.665	0,08 %	Sompo Holdings, Inc.	396.039	12.776.762	0,38 %
McDonald's Holdings Co. Japan Ltd.	74.600	2.732.629	0,08 %	Resona Holdings, Inc.	2.476.473	12.322.854	0,36 %
Yokohama Rubber Co., Ltd.	132.765	2.711.831	0,08 %	Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc.	372.136	12.305.484	0,36 %
Casio Computer Co., Ltd.	217.253	2.603.436	0,08 %	Daiwa Securities Group, Inc.	1.810.448	9.461.111	0,28 %
Iida Group Holdings Co., Ltd.	164.720	2.587.637	0,08 %	Japan Exchange Group, Inc.	585.102	8.482.176	0,25 %
Asics Corp.	179.470	2.382.848	0,07 %	T & D Holdings, Inc.	587.769	8.373.104	0,25 %
Benesse Holdings, Inc.	80.490	2.365.251	0,07 %	Concordia Financial Group Ltd.	1.372.000	6.897.015	0,20 %
Shimamura Co., Ltd.	24.855	2.278.419	0,07 %	Chiba Bank Ltd.	785.436	5.446.428	0,16 %
NOK Corp.	106.836	2.077.957	0,06 %	Shizuoka Bank Ltd.	579.082	4.983.003	0,15 %
Sega Sammy Holdings, Inc.	194.153	2.006.547	0,06 %	Japan Post Bank Co., Ltd.	454.296	4.926.825	0,14 %
ABC-Mart, Inc.	36.893	1.764.600	0,05 %	Aozora Bank Ltd.	132.669	4.300.680	0,13 %
Toyoda Gosei Co., Ltd.	72.696	1.540.765	0,04 %	Fukuoka Financial Group, Inc.	868.303	4.063.246	0,12 %
Sankyo Co., Ltd.	50.287	1.317.862	0,04 %				
		681.990.142	20,07 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens
Mebuki Financial Group, Inc.	1.124.119	3.963.956	0,12 %	Taisei Corp.	231.532	9.602.228	0,28 %
SBI Holdings, Inc.	226.698	3.948.400	0,12 %	Hankyu Hanshin Holdings, Inc.	270.941	9.073.421	0,27 %
Suruga Bank Ltd.	195.515	3.493.453	0,10 %	Makita Corp.	251.285	8.795.989	0,26 %
Bank of Kyoto Ltd.	67.829	2.943.416	0,09 %	Asahi Glass Co., Ltd.	224.213	8.088.700	0,24 %
Sony Financial Holdings, Inc.	194.506	2.870.065	0,08 %	Kajima Corp.	1.007.824	8.076.294	0,24 %
Credit Saison Co., Ltd.	176.831	2.679.849	0,08 %	Toyota Tsusho Corp.	238.312	7.989.532	0,23 %
Shinsei Bank Ltd.	184.573	2.659.366	0,08 %	Tokyu Corp.	595.746	7.918.610	0,23 %
Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co., Ltd.	502.376	2.492.009	0,07 %	TOTO Ltd.	158.788	7.806.160	0,23 %
AEON Financial Service Co., Ltd.	126.511	2.454.089	0,07 %	MISUMI Group, Inc.	316.093	7.664.553	0,22 %
Hachijuni Bank Ltd.	458.648	2.193.724	0,06 %	MinebeaMitsumi, Inc.	431.174	7.532.071	0,22 %
Yamaguchi Financial Group, Inc.	221.537	2.192.931	0,06 %	Obayashi Corp.	728.326	7.344.095	0,22 %
Kyushu Financial Group, Inc.	390.132	1.966.953	0,06 %	LIXIL Group Corp.	298.423	6.728.686	0,20 %
Seven Bank Ltd.	669.497	1.910.443	0,06 %	Yamato Holdings Co., Ltd.	392.126	6.573.112	0,19 %
Acom Co., Ltd.	448.334	1.574.321	0,05 %	Kintetsu Group Holdings Co., Ltd.	203.209	6.489.703	0,19 %
		431.033.553	12,68 %	Odakyu Electric Railway Co., Ltd.	330.682	5.891.498	0,17 %
				Tobu Railway Co., Ltd.	217.180	5.844.123	0,17 %
Gesundheitswesen 6,96 % (2016: 7,44 %)				NSK Ltd.	432.807	5.676.047	0,17 %
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	798.271	37.774.289	1,11 %	Dai Nippon Printing Co., Ltd.	290.921	5.404.626	0,16 %
Astellas Pharma, Inc.	2.320.467	24.650.758	0,73 %	Shimizu Corp.	619.060	5.327.014	0,16 %
Hoya Corp.	437.236	18.191.484	0,54 %	Daifuku Co., Ltd.	110.900	5.033.824	0,15 %
Otsuka Holdings Co., Ltd.	438.019	16.022.149	0,47 %	Nippon Express Co., Ltd.	89.509	4.956.175	0,15 %
Shionogi & Co., Ltd.	332.220	14.974.078	0,44 %	Kawasaki Heavy Industries Ltd.	168.616	4.929.960	0,14 %
Terumo Corp.	362.039	14.292.057	0,42 %	IHI Corp.	173.530	4.810.652	0,14 %
Eisai Co., Ltd.	299.365	14.199.188	0,42 %	Keio Corp.	129.789	4.754.224	0,14 %
Daiichi Sankyo Co., Ltd.	636.216	13.813.593	0,41 %	Kyushu Railway Co.	179.503	4.637.853	0,14 %
System Corp.	175.553	11.511.449	0,34 %	NGK Insulators Ltd.	293.970	4.624.585	0,14 %
Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	251.091	10.710.385	0,31 %	Sumitomo Heavy Industries Ltd.	130.939	4.617.273	0,14 %
Olympus Corp.	326.709	10.433.811	0,31 %	ANA Holdings, Inc.	130.147	4.527.768	0,13 %
Ono Pharmaceutical Co., Ltd.	462.672	8.981.855	0,26 %	Hoshizaki Corp.	60.993	4.504.469	0,13 %
M3, Inc.	236.060	6.919.325	0,20 %	Toppan Printing Co., Ltd.	588.440	4.432.763	0,13 %
Santen Pharmaceutical Co., Ltd.	410.005	5.367.917	0,16 %	Amada Holdings Co., Ltd.	381.723	4.328.843	0,13 %
Kyowa Hakko Kirin Co., Ltd.	291.080	4.688.865	0,14 %	Nagoya Railroad Co., Ltd.	206.380	4.328.377	0,13 %
Mitsubishi Tanabe Pharma Corp.	252.066	4.345.512	0,13 %	Japan Airlines Co., Ltd.	130.975	4.268.036	0,13 %
Alfresa Holdings Corp.	210.914	4.127.218	0,12 %	THK Co., Ltd.	135.084	4.224.180	0,12 %
Hisamitsu Pharmaceutical Co., Inc.	69.475	3.507.901	0,10 %	Keikyu Corp.	262.944	4.208.422	0,12 %
Medipal Holdings Corp.	192.657	3.143.296	0,09 %	Persol Holdings Co., Ltd.	199.100	4.156.560	0,12 %
Suzuken Co., Ltd.	80.842	2.770.033	0,08 %	Keisei Electric Railway Co., Ltd.	154.734	4.140.878	0,12 %
Taisho Pharmaceutical Holdings Co., Ltd.	35.260	2.345.972	0,07 %	Nabtesco Corp.	126.312	4.033.913	0,12 %
Sumitomo Dainippon Pharma Co., Ltd.	178.540	2.209.475	0,06 %	Fuji Electric Co., Ltd.	628.293	3.943.375	0,12 %
CYBERDYNE, Inc.	110.500	1.585.572	0,05 %	Seibu Holdings, Inc.	249.448	3.929.720	0,12 %
		236.566.182	6,96 %	JGC Corp.	232.729	3.748.917	0,11 %
				Nippon Yusen KK	181.363	3.685.713	0,11 %
Industrie 21,50 % (2016: 19,93 %)				Hitachi Construction Machinery Co., Ltd.	120.821	3.657.585	0,11 %
FANUC Corp.	217.429	43.495.405	1,28 %	Sohgo Security Services Co., Ltd.	80.261	3.637.166	0,11 %
Mitsubishi Corp.	1.694.276	38.990.733	1,15 %	JTEKT Corp.	250.530	3.585.611	0,10 %
Nidec Corp.	267.559	31.271.560	0,92 %	Mitsui OSK Lines Ltd.	128.717	3.577.848	0,10 %
Komatsu Ltd.	1.035.717	31.223.849	0,92 %	Hino Motors Ltd.	289.968	3.129.688	0,09 %
Mitsubishi Electric Corp.	2.167.529	29.988.370	0,88 %	Kurita Water Industries Ltd.	110.412	2.987.414	0,09 %
East Japan Railway Co.	367.732	29.889.922	0,88 %	Keihan Holdings Co., Ltd.	107.926	2.648.880	0,08 %
Daikin Industries Ltd.	279.421	27.545.470	0,81 %	Park24 Co., Ltd.	123.007	2.452.499	0,07 %
ITOCHU Corp.	1.678.690	26.098.040	0,77 %	Mabuchi Motor Co., Ltd.	54.146	2.445.714	0,07 %
Mitsui & Co., Ltd.	1.914.309	25.926.007	0,76 %	Kamigumi Co., Ltd.	130.447	2.404.111	0,07 %
Recruit Holdings Co., Ltd.	1.236.485	25.594.403	0,75 %	Japan Airport Terminal Co., Ltd.	51.922	1.604.449	0,05 %
Central Japan Railway Co.	161.775	24.134.077	0,71 %			730.687.589	21,50 %
SMC Corp.	64.183	22.006.394	0,65 %	Informationstechnologie 12,67 % (2016: 10,62 %)			
Kubota Corp.	1.183.300	19.328.003	0,57 %	Keyence Corp.	109.133	50.923.847	1,50 %
Sumitomo Corp.	1.332.640	18.865.996	0,55 %	Nintendo Co., Ltd.	127.131	38.711.622	1,14 %
Toshiba Corp.	7.314.042	17.140.158	0,50 %	Canon, Inc.	1.196.847	37.160.885	1,09 %
Secom Co., Ltd.	235.484	14.809.349	0,44 %	Hitachi Ltd.	5.421.670	35.186.514	1,03 %
West Japan Railway Co.	184.744	11.235.954	0,33 %	Tokyo Electron Ltd.	176.036	26.547.876	0,78 %
Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	359.457	11.187.348	0,33 %	Murata Manufacturing Co., Ltd.	214.754	24.004.417	0,71 %
Marubeni Corp.	1.851.887	11.172.644	0,33 %	Kyocera Corp.	359.976	19.620.763	0,58 %
				FUJIFILM Holdings Corp.	461.815	15.721.565	0,46 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens
Fujitsu Ltd.	2.205.594	13.088.111	0,38 %
Omron Corp.	216.021	10.731.572	0,32 %
Yaskawa Electric Corp.	284.140	10.429.170	0,31 %
Rohm Co., Ltd.	105.985	9.778.159	0,29 %
TDK Corp.	145.396	9.662.962	0,28 %
NET Data Corp.	707.898	7.007.279	0,21 %
NEC Corp.	292.117	6.564.906	0,19 %
Trend Micro, Inc.	133.735	6.317.483	0,19 %
Seiko Epson Corp.	313.777	6.167.903	0,18 %
Ricoh Co., Ltd.	793.744	6.143.633	0,18 %
Yahoo Japan Corp.	1.597.365	6.105.101	0,18 %
Disco Corp.	32.179	5.963.826	0,17 %
Nomura Research Institute Ltd.	148.083	5.736.336	0,17 %
SUMCO Corp.	263.200	5.619.287	0,16 %
Renesas Electronics Corp.	560.964	5.444.999	0,16 %
Brother Industries Ltd.	264.677	5.439.502	0,16 %
Nexon Co., Ltd.	221.751	5.376.969	0,16 %
Shimadzu Corp.	282.295	5.346.634	0,16 %
Alps Electric Co., Ltd.	222.282	5.291.250	0,16 %
Konami Holdings Corp.	104.587	4.793.663	0,14 %
Hamamatsu Photonics KK	159.751	4.475.906	0,13 %
Obic Co., Ltd.	72.647	4.446.785	0,13 %
Hirose Electric Co., Ltd.	35.918	4.373.246	0,13 %
Konica Minolta, Inc.	535.605	4.292.122	0,13 %
Yokogawa Electric Corp.	256.092	4.085.503	0,12 %
Otsuka Corp.	58.570	3.740.995	0,11 %
Nippon Electric Glass Co., Ltd.	94.597	3.007.073	0,09 %
Oracle Corp. Japan	42.877	2.960.529	0,09 %
Hitachi High-Technologies Corp.	77.243	2.712.382	0,08 %
Kakaku.com, Inc.	156.003	2.196.980	0,06 %
DeNA Co., Ltd.	118.416	2.033.563	0,06 %
Mixi, Inc.	48.100	1.799.259	0,05 %
LINE Corp.	49.632	1.685.953	0,05 %
		430.696.530	12,67 %

Grundstoffe 6,62 % (2016: 6,08 %)

Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	436.189	36.921.413	1,09 %
Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp.	852.695	18.223.841	0,54 %
Asahi Kasei Corp.	1.415.887	15.213.942	0,45 %
Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	1.605.075	14.671.941	0,43 %
Nitto Denko Corp.	185.189	13.704.001	0,40 %
Toray Industries, Inc.	1.646.944	12.936.175	0,38 %
JFE Holdings, Inc.	585.824	11.719.068	0,35 %
Sumitomo Metal Mining Co., Ltd.	277.303	10.614.871	0,31 %
Sumitomo Chemical Co., Ltd.	1.764.200	10.564.062	0,31 %
Kuraray Co., Ltd.	398.029	6.255.703	0,18 %
Tosoh Corp.	328.172	6.196.130	0,18 %
Mitsui Chemicals, Inc.	206.391	5.530.914	0,16 %
Oji Holdings Corp.	967.381	5.363.607	0,16 %
Kansai Paint Co., Ltd.	229.334	4.964.067	0,15 %
Taiheiyō Cement Corp.	135.473	4.872.297	0,14 %
Mitsubishi Gas Chemical Co., Inc.	203.397	4.864.262	0,14 %
Nippon Paint Holdings Co., Ltd.	182.506	4.809.886	0,14 %
Nissan Chemical Industries Ltd.	135.535	4.503.802	0,13 %
Teijin Ltd.	209.843	3.893.734	0,12 %
Mitsubishi Materials Corp.	125.447	3.718.800	0,11 %
JSR Corp.	215.724	3.537.188	0,10 %
Daicel Corp.	314.049	2.976.347	0,09 %
Air Water, Inc.	167.724	2.948.527	0,09 %
Hitachi Metals Ltd.	239.845	2.868.846	0,08 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens
Kobe Steel Ltd.	346.339	2.675.567	0,08 %
Hitachi Chemical Co., Ltd.	116.881	2.500.579	0,07 %
Toyo Seikan Group Holdings Ltd.	182.767	2.445.538	0,07 %
Kaneka Corp.	314.098	2.389.344	0,07 %
Taiyo Nippon Sanso Corp.	145.154	1.692.228	0,05 %
Maruichi Steel Tube Ltd.	63.319	1.544.707	0,05 %
		225.121.387	6,62 %

Immobilien 3,87 % (2016: 4,52 %)

Mitsubishi Estate Co., Ltd.	1.404.049	20.344.005	0,60 %
Daiwa House Industry Co., Ltd.	635.150	20.317.081	0,60 %
Mitsui Fudosan Co., Ltd.	1.000.866	18.682.519	0,55 %
Daito Trust Construction Co., Ltd.	77.560	13.173.205	0,39 %
Sumitomo Realty & Development Co., Ltd.	400.612	10.966.695	0,32 %
Nippon Building Fund, Inc. REIT	1.505	6.130.363	0,18 %
Japan Real Estate Investment Corp. REIT	1.395	5.517.294	0,16 %
Japan Retail Fund Investment Corp. REIT	2.993	4.571.252	0,14 %
Nomura Real Estate Master Fund, Inc. REIT	4.225	4.369.609	0,13 %
United Urban Investment Corp. REIT	3.427	4.106.721	0,12 %
Nippon Prologis, Inc. REIT	2.069	3.644.875	0,11 %
Tokyo Fudosan Holdings Corp.	576.050	3.470.691	0,10 %
Daiwa House Investment Corp. REIT Klasse A	1.611	3.188.174	0,09 %
Hulic Co., Ltd.	334.659	3.132.091	0,09 %
Nomura Real Estate Holdings, Inc.	139.479	2.604.596	0,08 %
Tokyo Tatemono Co., Ltd.	230.444	2.592.855	0,08 %
Japan Prime Realty Investment Corp. REIT	928	2.456.004	0,07 %
Aeon Mall Co., Ltd.	127.801	2.082.303	0,06 %
		131.350.333	3,87 %

Telekommunikationsdienstleistungen 4,82 % (2016: 5,78 %)

SoftBank Group Corp.	925.861	61.053.247	1,80 %
KDDI Corp.	2.031.385	42.115.873	1,24 %
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	775.953	30.408.244	0,89 %
NTT DOCOMO, Inc.	1.530.861	30.114.714	0,89 %
		163.692.078	4,82 %

Versorger 1,59 % (2016: 2,05 %)

Tokyo Gas Co., Ltd.	436.743	8.325.133	0,24 %
Kansai Electric Power Co., Inc.	789.733	8.056.706	0,24 %
Chubu Electric Power Co., Inc.	722.640	7.481.751	0,22 %
Osaka Gas Co., Ltd.	420.670	6.748.378	0,20 %
Tohoku Electric Power Co., Inc.	507.675	5.408.139	0,16 %
Tokyo Electric Power Co. Holdings, Inc.	1.622.266	5.348.784	0,16 %
Kyushu Electric Power Co., Inc.	479.000	4.181.995	0,12 %
Electric Power Development Co., Ltd.	164.259	3.685.412	0,11 %
Chugoku Electric Power Co., Inc.	312.117	2.794.214	0,08 %
Toho Gas Co., Ltd.	83.299	1.902.814	0,06 %
		53.933.326	1,59 %

Summe Aktien	3.379.956.591	99,45 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	3.379.956.591	99,45 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominalbetrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Euro (€)	% des Gesamt-nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures 0,00 % (2016: 0,01 %)				
Topix Index März 2018	136	18.259.978	8.062	0,00 %
			8.062	0,00 %

Währung	Kauf-betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs-datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Euro (€)	% des Gesamt-nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte (0,01 % (2016: (0,02 %)))							
JPY	731.200.000	USD	(6.499.989)	Barclays Bank Plc	13.03.2018	11.046	0,00 %
USD	4.400.910	JPY	(493.500.000)	JPMorgan Chase Bank	13.03.2018	4.116	0,00 %
JPY	417.795.000	USD	(3.718.069)	BNP Paribas	13.03.2018	2.920	0,00 %
JPY	163.305.000	USD	(1.452.583)	JPMorgan Chase Bank	13.03.2018	1.732	0,00 %
USD	86.930	EUR	(72.370)	Brown Brothers Harriman	09.01.2018	(1)	(0,00 %)
USD	574.135	GBP	(424.348)	Brown Brothers Harriman	09.01.2018	(8)	(0,00 %)
USD	801.296	JPY	(90.250.000)	Brown Brothers Harriman	09.01.2018	(90)	(0,00 %)
USD	2.419.290	JPY	(272.850.000)	Barclays Bank Plc	13.03.2018	(9.267)	(0,00 %)
JPY	424.997.500	USD	(3.797.095)	JPMorgan Chase Bank	13.03.2018	(9.410)	(0,00 %)
JPY	424.997.500	USD	(3.797.299)	JPMorgan Chase Bank	13.03.2018	(9.579)	(0,00 %)
JPY	433.610.344	USD	(3.882.093)	BNP Paribas	13.03.2018	(16.275)	(0,00 %)
USD	3.958.765	JPY	(447.000.000)	Bank of America	13.03.2018	(19.054)	(0,00 %)
JPY	734.105.000	USD	(6.569.476)	BNP Paribas	13.03.2018	(25.122)	(0,00 %)
USD	15.010.356	JPY	(1.692.940.000)	JPMorgan Chase Bank	13.03.2018	(57.920)	(0,00 %)
USD	20.137.535	JPY	(2.273.125.000)	BNP Paribas	13.03.2018	(91.868)	(0,00 %)
JPY	4.256.791.620	USD	(38.118.019)	Bank of America	13.03.2018	(165.715)	(0,01 %)
						(384.495)	(0,01 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente						(376.433)	(0,01 %)

	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt-nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva	19.115.992	0,56 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	3.398.696.150	100,00 %

REIT – Real Estate Investment Trust.

Analyse des Gesamtvermögens	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt-nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	3.379.956.591	99,45 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	—	0,00 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente	(376.433)	(0,01 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva	19.115.992	0,56 %
Gesamtvermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	3.398.696.150	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Anteile	Kosten Euro (€)		Anteile	Erlöse Euro (€)
Käufe			Verkäufe		
Toyota Motor Corp.	843.600	43.394.551	SoftBank Group Corp.	179.958	12.687.642
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	4.097.400	23.570.948	Toyota Motor Corp.	206.881	10.812.196
SoftBank Group Corp.	281.700	19.676.964	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	1.664.956	9.323.502
Honda Motor Co., Ltd.	640.100	16.945.836	KDDI Corp.	145.915	3.358.312
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	437.600	15.002.313	Sony Corp.	83.070	3.067.208
Japan Post Holdings Co., Ltd.	1.447.546	14.582.539	Honda Motor Co., Ltd.	108.783	2.950.482
KDDI Corp.	603.400	14.288.472	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	83.093	2.743.866
Sony Corp.	417.900	13.085.900	Keyence Corp.	5.539	2.599.368
Mizuho Financial Group, Inc.	7.963.800	12.788.559	Astellas Pharma, Inc.	229.158	2.490.296
Keyence Corp.	30.000	12.482.377	Miraca Holdings, Inc.	66.900	2.449.659
FANUC Corp.	62.700	11.294.367	Mizuho Financial Group, Inc.	1.602.512	2.428.613
Japan Tobacco, Inc.	363.100	10.821.620	NTT DOCOMO, Inc.	113.259	2.365.984
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	234.900	10.360.418	FANUC Corp.	11.649	2.286.003
Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	128.200	10.213.188	Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	25.715	2.280.031
Canon, Inc.	343.600	9.933.668	Kao Corp.	42.023	2.263.133
Mitsubishi Corp.	484.100	9.782.110	Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	46.915	2.216.554
NTT DOCOMO, Inc.	455.300	9.637.156	Chugoku Bank Ltd.	198.630	2.207.932
Nintendo Co., Ltd.	36.700	9.283.430	Nintendo Co., Ltd.	6.769	2.150.506
Toshiba Corp.	4.115.000	9.044.919	Japan Tobacco, Inc.	73.115	2.130.916
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	222.800	9.015.351	East Japan Railway Co.	25.257	2.081.383

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	Euro (€) Zum 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	3.379.956.591	2.399.338.539
Derivative Finanzinstrumente	27876	486.097
Barmittel	14.030.941	12.583.273
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	3.998.008	2.980.346
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	3.994.102	4.957.438
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	—	129.134
Bareinschüsse für Futures	444.631	570.104
Barsicherheiten	379.747	—
Summe Umlaufvermögen	3.402.831.896	2.421.044.931
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	404.309	837.129
Überziehungskredit	—	388.423
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	5.159	24.284
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	4.820	—
Zahlbare Dividenden	1.084.075	2.861.901
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	1.980.877	4.710.277
Zahlbare Verwaltungsgebühren	656.171	470.457
Sonstige Verbindlichkeiten	335	—
Summe kurzfristige Passiva	4.135.746	9.292.471
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	3.398.696.150	2.411.752.460

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Nettovermögen	547.148.637	332.726.143	323.155.369
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.840.619	1.877.864	1.920.127
Nettoinventarwert je Anteil	192,62	177,18	168,30
Institutionelle JPY-Anteile (¥)			
Gegenwert in Euro (€)	167.644.375	59.078.339	54.640.554
Nettovermögen	22.677.275.059	7.267.862.665	7.140.233.906
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.888.137	723.340	704.321
Nettoinventarwert je Anteil	12.010,40	10.047,64	10.137,75
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Gegenwert in Euro (€)	577.820.364	576.578.994	565.713.849
Nettovermögen	693.846.693	608.146.694	614.534.952
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.999.197	3.253.421	3.360.625
Nettoinventarwert je Anteil	231,34	186,93	182,86
EUR-Anlegeranteile (€)			
Nettovermögen	77.375.750	49.343.669	10.707.039
Anzahl der umlaufenden Anteile	402.840	279.077	63.709
Nettoinventarwert je Anteil	192,08	176,81	168,06
JPY-Anlegeranteile (¥)			
Gegenwert in Euro (€)	65.819.454	66.372.714	64.306.595
Nettovermögen	8.903.405.573	8.165.222.284	8.403.357.791
Anzahl der umlaufenden Anteile	344.787	377.704	384.996
Nettoinventarwert je Anteil	25.822,92	21.618,05	21.827,15

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Nettoinventarwert je Anteil (Fortsetzung)

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
USD-Anlegeranteile (\$)			
Gegenwert in Euro (€)	43.159.799	32.894.136	42.470.729
Nettovermögen	51.826.287	34.695.090	46.135.953
Anzahl der umlaufenden Anteile	226.865	187.833	255.142
Nettoinventarwert je Anteil	228,45	184,71	180,82
Thesaurierende GBP-Anteile (£)			
Gegenwert in Euro (€)	1.006.124.875	604.846.458	492.590.980
Nettovermögen	893.110.190	516.296.561	363.051.487
Anzahl der umlaufenden Anteile	3.936.685	2.572.726	2.205.851
Nettoinventarwert je Anteil	226,87	200,68	164,59
Ausschüttende GBP-Anteile (£)			
Gegenwert in Euro (€)	65.367.143	174.439.699	127.270.417
Nettovermögen	58.024.668	148.901.619	93.801.381
Anzahl der umlaufenden Anteile	291.561	832.914	629.545
Nettoinventarwert je Anteil	199,01	178,77	149,00
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Nettovermögen	816.686.464	503.342.637	352.568.944
Anzahl der umlaufenden Anteile	5.242.402	3.513.487	2.591.732
Nettoinventarwert je Anteil	155,78	143,26	136,04
Institutionelle Plus JPY-Anteile (¥)			
Gegenwert in Euro (€)	25.189.301	8.603.368	50.990.720
Nettovermögen	3.407.359.819	1.058.392.943	6.663.286.556
Anzahl der umlaufenden Anteile	223.666	83.072	518.499
Nettoinventarwert je Anteil	15.234,14	12.740,67	12.851,11
Institutionelle Plus USD-Anteile (\$)			
Gegenwert in Euro (€)	1.809.492	2.626.714	—
Nettovermögen	2.172.838	2.770.527	—
Anzahl der umlaufenden Anteile	17.798	28.095	—
Nettoinventarwert je Anteil	122,08	98,61	—
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile (£)			
Gegenwert in Euro (€)	26.591	7.471	7.095
Nettovermögen	23.604	6.377	5.229
Anzahl der umlaufenden Anteile	145	44	44
Nettoinventarwert je Anteil	162,79	144,93	118,19
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)			
Gegenwert in Euro (€)	4.523.905	892.118	30.281
Nettovermögen	4.015.750	761.511	22.318
Anzahl der umlaufenden Anteile	25.987	5.486	193
Nettoinventarwert je Anteil	154,53	138,81	115,69

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	128.648	—
Dividenden	63.442.510	48.827.752
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	733.013	646.363
Verschiedene Erträge	128	68
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	212.155.133	100.304.794
Summe Anlageerträge/(-verluste)	276.459.432	149.778.977
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	6.780.647	4.899.804
Transaktionsgebühren und Provisionen	211.618	146.725
Sonstige Aufwendungen	55.256	28.567
Summe Aufwendungen	7.047.521	5.075.096
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	2.028	5.126
Ausgezahlte Ausschüttungen	1.084.075	2.861.900
Ertragsausgleich	1.070.165	(1.573.069)
Summe Finanzierungskosten	2.156.268	1.293.957
Nettoanlageerträge/(-verluste)	267.255.643	143.409.924
Ausländische Quellensteuer	(9.512.332)	(7.311.568)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	257.743.311	136.098.356

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	257.743.311	136.098.356
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	1.583.856.147	723.360.035
Rücknahmen	(856.803.800)	(532.158.503)
Reinvestitionen	2.148.032	—
Summe Kapitalgeschäfte ¹	729.200.379	191.201.532
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	986.943.690	327.299.888
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	2.411.752.460	2.084.452.572
Zum Jahresende	3.398.696.150	2.411.752.460

1 Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Pacific ex-Japan Stock Index Fund

Verwaltet durch The Vanguard Group, Inc.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Anlageziel

Der Fonds strebt einen langfristigen Kapitalzuwachs durch Nachbildung der Performance des MSCI Pacific ex-Japan Index an. Dieser Index umfasst Stammaktien von Unternehmen mit Sitz im Pazifikraum.

Portfoliomerkmale

	Fonds	MSCI Pazifik ex-Japan Index
Anzahl der Aktien	152	150
Mittlere Marktkapitalisierung		
US-Dollar	\$ 32,9 Mrd.	\$ 32,9 Mrd.
Euro	€ 27,4 Mrd.	€ 27,4 Mrd.
Britisches Pfund	£ 24,3 Mrd.	£ 24,3 Mrd.
Kurs/Gewinn-Verhältnis	14,9x	14,9x
Kurs/Buch-Verhältnis	1,7x	1,7x
Rendite	3,6 %	3,6 %
Eigenkapitalrendite	12,0 %	12,0 %
Ertragszuwachsrate	3,9 %	3,9 %
Portfolioumschlag ¹	-20 %	—
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,23 %	
Anlegeranteile	0,30 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,20 %	
Thesaurierende Anteile	0,23 %	
Ausschüttende Anteile	0,23 %	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,20 %	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,20 %	
Kurzfristige Reserven	(0,1 %)	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	MSCI Pazifik ex-Japan Index
R ²	1,00	1,00
Beta	1,00	1,00

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI Pazifik ex-Japan Index
Australien	57,6 %	57,7 %
Hongkong	29,8	29,8
Singapur	11,1	11,1
Neuseeland	1,4	1,4
Sonstige	0,1	0,0

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds	MSCI Pazifik ex-Japan Index
Luxusgüter	6,2 %	6,2 %
Grundbedarfsgüter	5,3	5,3
Energie	3,2	3,2
Finanzwerte	39,1	39,1
Gesundheitswesen	4,7	4,7
Industriegüter	8,7	8,7
Informationstechnologie	0,7	0,7
Grundstoffe	10,4	10,4
Immobilien	14,6	14,6
Telekommunikationsdienste	2,7	2,7
Versorger	4,4	4,4

Die 10 größten Positionen² (% des Gesamtvermögens)

Commonwealth Bank of Australia	Diversifizierte Banken	6,0 %
AIA Group Ltd.	Lebens- und Gesundheitsversicherung	5,6
Westpac Banking Corp.	Diversifizierte Banken	4,6
BHP Billiton	Diversifizierte Metalle und Bergbau	4,1
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	Diversifizierte Banken	3,6
National Australia Bank Ltd.	Diversifizierte Banken	3,4
CSL Ltd.	Biotechnologie	2,7
Wesfarmers Ltd.	Verbraucherdienstleistungen	2,2
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	Spezialfinanzen	2,0
CK Hutchison Holdings Ltd.	Grundstückserschliessung	1,9
Zehn grösste Positionen		36,1 %

Anlagefokus

Stil	Wert	Mischung	Wachstum
Marktkapitalisierung	Gross		
	Mittel		
	Klein		

¹ Ein negativer Portfolioumschlag deutet darauf hin, dass der Gesamtwert der Zeichnungen und Rückkäufe über dem Wert der Wertpapiertransaktionen gelegen hat.

² Die aufgeführten Positionen schliessen etwaige vorübergehende Baranlagen und Aktienindexprodukte aus.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

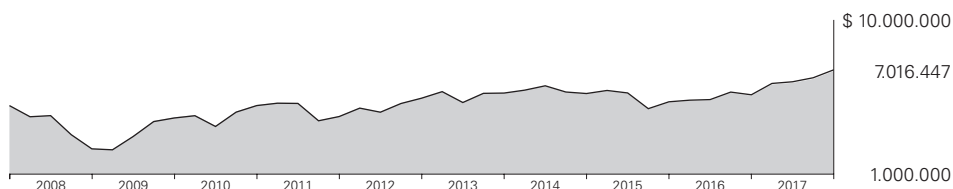
Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

Pacific ex-Japan Stock Index Fund
 Benchmark: MSCI Pacific ex-Japan Index

In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000



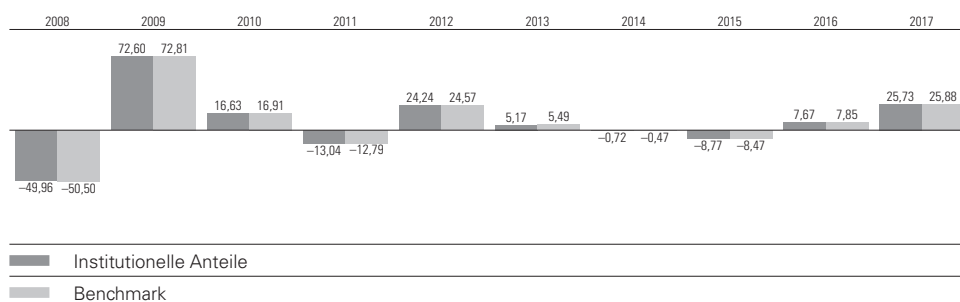
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
— Institutionelle Anteile	25,73 %	5,22 %	3,45 %	\$ 7.016.447
— Benchmark	25,88	5,46	3,55	7.087.750

	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von \$ 100.000
Anlegeranteile	25,64 %	7,36 %	\$ 122.098
Benchmark	25,88	7,65	123.011

	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von \$ 200.000.000
Institutionelle Plus-Anteile	25,76 %	5,45 %	\$ 248.162.000
Benchmark	25,88	5,63	249.894.980

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,15 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,24 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,12 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



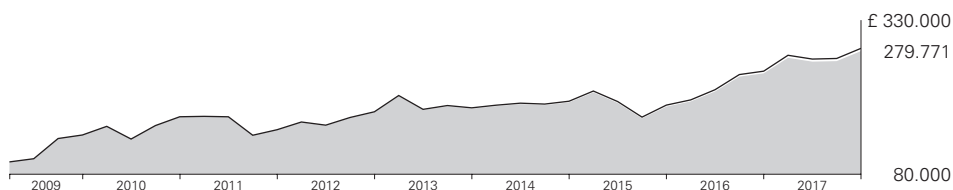
¹ Für Anlegeranteile, 10. März 2015; für Institutionelle Plus-Anteile, 6. Dezember 2013.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Pacific ex-Japan Stock Index Fund
 Benchmark: MSCI Pacific ex-Japan Index

In GBP

Kumulative Wertentwicklung: 23. Juni 2009–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile	14,84 %	9,17 %	12,83 %	£ 279.771
Benchmark	14,99	9,41	13,04	284.212

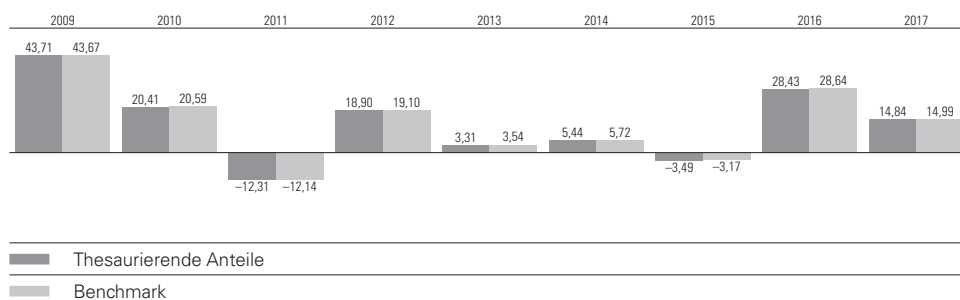
	Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Ausschüttende Anteile	14,84 %	9,17 %	12,83 %	£ 279.760
Benchmark	14,99	9,41	13,04	284.212

	Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	14,88 %	9,26 %	12,83 %	£ 268.577.200
Benchmark	14,99	9,48	13,04	270.336.064

	Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	14,88 %	9,26 %	12,83 %	£ 268.597.418
Benchmark	14,99	9,48	13,04	270.336.064

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,15 Prozentpunkte für Thesaurierungsanteile und Ertragsanteile und 0,11 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile und institutionelle Plus-Ertragsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 23. Juni 2009–31. Dezember 2017



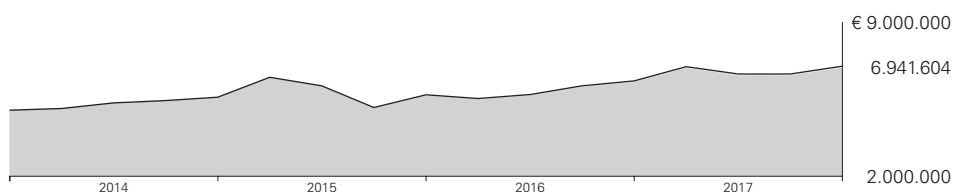
1 Für Thesaurierungs- und Ertragsanteile, 23. Juni 2009; für institutionelle Plus-Thesaurierungs- und institutionelle Plus-Ertragsanteile; 2. September 2014.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Pacific ex-Japan Stock Index Fund
 Benchmark: MSCI Pacific ex-Japan Index

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 27. Februar 2014–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



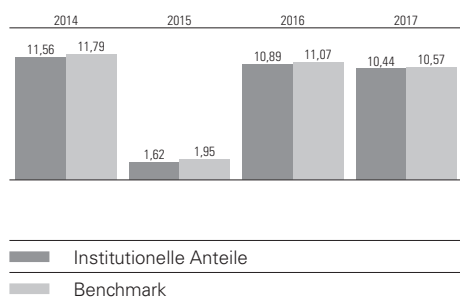
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
— Institutionelle Anteile	10,44 %	8,92 %	€ 6.941.604
— Benchmark	10,57	9,15	6.999.001

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Anlegeranteile	10,36 %	8,85 %	€ 138.486
Benchmark	10,57	9,15	139.980

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile	10,47 %	8,95 %	€ 278.034.000
Benchmark	10,57	9,15	279.960.051

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,13 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,21 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,10 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 27. Februar 2014–31. Dezember 2017



¹ 27. Februar 2014.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

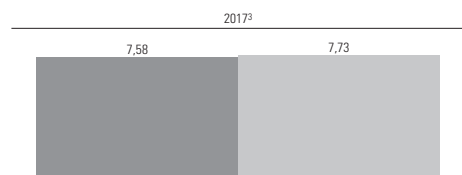
Pacific ex-Japan Stock Index Fund
 Benchmark: MSCI Pacific ex-Japan Index

In AUD

	Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017 Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von AUD 5.000.000
Institutionelle Anteile	7,58 %	AUD 5.378.805
Benchmark	7,73	5.386.344

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,15 Prozentpunkte für institutionelle Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 15. August 2017–31. Dezember 2017



■ Institutionelle Anteile
 ■ Benchmark

¹ 15. August 2017.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

³ Im Geschäftsjahr 2017 spiegeln die Renditen den Zeitraum seit Auflegung bis zum 31. Dezember 2017 wider.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens
Aktien 99,18 % (2016: 99,63 %)							
Australien 57,22 % (2016: 61,12 %)							
Commonwealth Bank of Australia	3.178.036	166.306.793	5,97 %	Bank of Queensland Ltd.	718.821	5.955.623	0,21 %
Westpac Banking Corp.	6.228.455	127.185.389	4,57 %	Crown Resorts Ltd.	695.199	5.895.756	0,21 %
BHP Billiton Ltd.	5.893.260	113.507.948	4,08 %	Coca-Cola Amatil Ltd.	1.014.131	5.621.380	0,20 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	5.389.981	100.900.506	3,62 %	REA Group Ltd.	96.677	4.826.749	0,17 %
National Australia Bank Ltd.	4.927.672	94.910.107	3,41 %	Healthscope Ltd.	3.185.530	4.357.329	0,16 %
CSL Ltd.	830.276	76.415.946	2,74 %	AusNet Services	3.312.406	3.894.396	0,14 %
Wesfarmers Ltd.	2.080.530	60.196.589	2,16 %	Domino's Pizza Enterprises Ltd.	114.157	3.472.472	0,12 %
Woolworths Group Ltd.	2.375.178	42.235.550	1,52 %	Flight Centre Travel Group Ltd.	101.986	2.938.834	0,11 %
Macquarie Group Ltd.	593.311	38.502.761	1,38 %	TPG Telecom Ltd.	679.517	2.907.937	0,10 %
Rio Tinto Ltd.	778.369	38.435.397	1,38 %	Harvey Norman Holdings Ltd.	1.021.196	2.773.732	0,10 %
Woodside Petroleum Ltd.	1.545.837	33.307.999	1,20 %	Transurban Group Klasse NEW	308.361	2.496.606	0,09 %
Transurban Group	3.768.353	30.509.989	1,10 %	Newcrest Mining Ltd. ADR	20.172	299.523	0,01 %
Scentre Group REIT	9.769.764	26.663.518	0,96 %	BGP Holdings Beneficial	3.231.283	—	0,00 %
Westfield Corp. REIT	3.622.512	22.392.129	0,80 %			1.593.021.230	57,22 %
South32 Ltd.	9.574.569	21.765.267	0,78 %	China 0,24 % (2016: 0,00 %)			
Suncorp Group Ltd.	2.372.028	21.414.226	0,77 %	Minth Group Ltd.	1.362.000	6.841.185	0,24 %
Amcor Ltd.	2.125.121	21.344.569	0,77 %			6.841.185	0,24 %
Newcrest Mining Ltd.	1.387.430	20.622.726	0,74 %	Hongkong 29,29 % (2016: 26,79 %)			
Insurance Australia Group Ltd.	4.344.266	20.486.809	0,74 %	AIA Group Ltd.	22.155.332	157.308.053	5,65 %
Origin Energy Ltd.	3.221.163	19.764.369	0,71 %	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	2.146.970	54.846.345	1,97 %
Brambles Ltd.	2.916.586	19.130.380	0,69 %	CK Hutchison Holdings Ltd.	4.955.664	51.789.701	1,86 %
AGL Energy Ltd.	1.203.401	19.094.443	0,69 %	Sun Hung Kai Properties Ltd.	2.658.063	36.924.566	1,33 %
Goodman Group REIT	3.304.295	18.122.172	0,65 %	CK Asset Holdings Ltd.	4.749.710	34.558.934	1,24 %
AMP Ltd.	5.355.216	18.103.548	0,65 %	Link REIT	4.044.120	31.212.961	1,12 %
Telstra Corp., Ltd.	7.638.220	18.060.016	0,65 %	Hang Seng Bank Ltd.	1.403.326	29.002.327	1,04 %
QBE Insurance Group Ltd.	2.517.598	17.513.663	0,63 %	Galaxy Entertainment Group Ltd.	4.320.495	28.858.489	1,04 %
Aristocrat Leisure Ltd.	995.938	15.374.465	0,55 %	BOC Hong Kong Holdings Ltd.	6.790.716	28.647.273	1,03 %
Treasury Wine Estates Ltd.	1.354.435	14.080.251	0,51 %	CLP Holdings Ltd.	3.013.670	25.667.685	0,92 %
Stockland REIT	4.437.620	12.949.335	0,46 %	Hong Kong & China Gas Co., Ltd.	15.400.486	25.134.238	0,90 %
Oil Search Ltd.	2.516.196	12.767.365	0,46 %	Jardine Matheson Holdings Ltd.	398.100	20.140.386	0,72 %
Tabcorp Holdings Ltd.	3.503.963	12.735.414	0,46 %	Sands China Ltd.	4.444.424	19.104.319	0,69 %
ASX Ltd.	355.237	12.693.850	0,46 %	Power Assets Holdings Ltd.	2.546.026	17.887.522	0,64 %
Santos Ltd.	3.440.330	12.212.820	0,44 %	WH Group Ltd.	16.138.500	15.163.669	0,55 %
Aurizon Holdings Ltd.	3.764.831	12.163.163	0,44 %	Techtronic Industries Co., Ltd.	2.524.500	13.702.257	0,49 %
James Hardie Industries plc	809.020	11.919.861	0,43 %	New World Development Co., Ltd.	10.809.353	13.518.868	0,49 %
Dexus REIT	1.866.878	11.856.047	0,43 %	MTR Corp., Ltd.	2.753.959	13.436.789	0,48 %
Ramsay Health Care Ltd.	259.567	11.855.251	0,43 %	Jardine Strategic Holdings Ltd.	406.600	13.402.089	0,48 %
Cochlear Ltd.	105.545	11.771.637	0,42 %	Hongkong Land Holdings Ltd.	2.158.700	12.655.936	0,46 %
APA Group	2.044.688	11.094.083	0,40 %	Wharf Real Estate Investment Co., Ltd.	2.227.403	12.338.850	0,44 %
GPT Group REIT	3.305.881	11.003.414	0,40 %	Henderson Land Development Co., Ltd.	2.203.554	12.089.364	0,43 %
Vicinity Centres REIT	6.174.303	10.938.964	0,39 %	Melco Resorts & Entertainment Ltd. ADR	452.140	10.960.856	0,39 %
Boral Ltd.	2.151.160	10.915.145	0,39 %	Wheelock & Co., Ltd.	1.498.753	8.909.161	0,32 %
Sonic Healthcare Ltd.	730.776	10.881.277	0,39 %	CK Infrastructure Holdings Ltd.	1.216.580	8.702.804	0,31 %
Lend Lease Group	1.017.102	10.831.825	0,39 %	Sino Land Co., Ltd.	5.797.030	8.547.009	0,31 %
Medibank Pvt Ltd.	5.053.431	10.829.330	0,39 %	Bank of East Asia Ltd.	2.249.320	8.111.150	0,29 %
Caltex Australia Ltd.	478.573	10.614.136	0,38 %	Hang Lung Properties Ltd.	3.714.832	7.558.665	0,27 %
Mirvac Group REIT	6.809.227	10.422.815	0,37 %	Wynn Macau Ltd.	2.860.812	7.542.878	0,27 %
BlueScope Steel Ltd.	1.029.607	10.307.770	0,37 %	HKT Trust & HKT Ltd.	6.947.389	7.371.460	0,27 %
Challenger Ltd.	1.063.868	9.722.205	0,35 %	Swire Pacific Ltd. Klasse A	914.154	7.045.802	0,25 %
Sydney Airport	2.024.346	9.295.938	0,33 %	Wharf Holdings Ltd.	2.229.403	6.412.463	0,23 %
Fortescue Metals Group Ltd.	2.856.817	9.080.747	0,33 %	Kingston Financial Group Ltd.	7.496.000	5.989.125	0,22 %
Computershare Ltd.	852.106	9.046.916	0,32 %	Swire Properties Ltd.	2.147.079	5.763.962	0,21 %
Orica Ltd.	691.846	8.156.566	0,29 %	ASM Pacific Technology Ltd.	487.056	5.650.402	0,20 %
Incitec Pivot Ltd.	3.095.858	7.864.389	0,28 %	Hysan Development Co., Ltd.	1.151.989	5.086.809	0,18 %
Seek Ltd.	609.955	7.552.648	0,27 %	Hang Lung Group Ltd.	1.625.000	4.976.955	0,18 %
Alumina Ltd.	4.491.690	7.109.440	0,26 %				
Bendigo & Adelaide Bank Ltd.	876.047	6.659.132	0,24 %				
CIMIC Group Ltd.	178.498	5.981.885	0,21 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- netto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- netto- vermögens
Li & Fung Ltd.	10.881.584	4.973.040	0,18 %	Keppel Corp., Ltd.	2.668.735	12.223.220	0,44 %
Kerry Properties Ltd.	1.192.169	4.464.118	0,16 %	CapitaLand Ltd.	4.706.043	10.351.980	0,37 %
Yue Yuen Industrial Holdings Ltd.	1.362.090	4.454.682	0,16 %	Global Logistic Properties Ltd.	4.889.078	10.267.145	0,37 %
MGM China Holdings Ltd.	1.743.604	4.392.902	0,16 %	Genting Singapore plc	11.095.997	9.057.962	0,32 %
Shangri-La Asia Ltd.	2.302.355	4.351.094	0,16 %	Ascendas REIT	4.564.751	7.737.111	0,28 %
NWS Holdings Ltd.	2.855.628	4.289.368	0,15 %	Singapore Exchange Ltd.	1.474.882	6.837.905	0,25 %
PCCW Ltd.	7.791.912	3.768.534	0,14 %	Singapore Airlines Ltd.	990.889	6.588.435	0,24 %
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd.	4.864.500	3.705.244	0,13 %	Suntec REIT	4.618.400	6.187.609	0,22 %
SJM Holdings Ltd.	3.609.720	2.691.808	0,10 %	CapitaLand Mall Trust REIT	4.554.486	6.045.216	0,22 %
First Pacific Co., Ltd.	3.986.200	2.250.648	0,08 %	City Developments Ltd.	750.966	5.844.879	0,21 %
		815.361.560	29,29 %	Singapore Technologies Engineering Ltd.	2.864.855	5.819.867	0,21 %
Neuseeland 1,43 % (2016: 1,48 %)				Wilmar International Ltd.	2.937.585	5.656.422	0,20 %
Fisher & Paykel Healthcare Corp., Ltd.	1.047.006	8.898.608	0,32 %	CapitaLand Commercial Trust REIT	4.624.398	5.561.672	0,20 %
Spark New Zealand Ltd.	3.363.159	7.230.612	0,26 %	UOL Group Ltd.	895.445	4.949.432	0,18 %
Auckland International Airport Ltd.	1.751.591	6.722.468	0,24 %	ComfortDelGro Corp., Ltd.	3.969.299	4.897.471	0,18 %
Fletcher Building Ltd.	1.276.975	5.748.003	0,21 %	Singapore Press Holdings Ltd.	2.937.195	4.850.332	0,17 %
Ryman Healthcare Ltd.	733.978	4.603.626	0,16 %	Jardine Cycle & Carriage Ltd.	181.455	4.598.709	0,16 %
Meridian Energy Ltd.	2.351.477	4.073.687	0,15 %	SATS Ltd.	1.237.600	4.010.297	0,14 %
Mercury NZ Ltd.	1.265.401	2.525.685	0,09 %	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.	4.224.603	3.869.867	0,14 %
		39.802.689	1,43 %	Sembcorp Industries Ltd.	1.804.143	3.406.485	0,12 %
Singapur 11,00 % (2016: 10,24 %)				Hutchison Port Holdings Trust	9.590.716	3.314.580	0,12 %
DBS Group Holdings Ltd.	3.290.970	50.961.613	1,83 %	Golden Agri-Resources Ltd.	12.955.952	2.987.197	0,11 %
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	5.771.651	44.561.953	1,60 %	StarHub Ltd.	1.110.631	1.972.457	0,07 %
United Overseas Bank Ltd.	2.450.685	40.392.991	1,45 %			306.281.653	11,00 %
Singapore Telecommunications Ltd.	14.981.635	33.328.846	1,20 %	Summe Aktien		2.761.308.317	99,18 %
				Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		2.761.308.317	99,18 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures 0,00 % (2016: 0,00 %)				
Hang Seng Index Januar 2018	54	8.515.650	98.335	0,00 %
SPI 200 März 2018	170	16.701.905	(36.926)	(0,00 %)
			61.409	0,00 %

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte 0,01 % (2016: (0,03 %))							
AUD	15.995.250	USD	(12.261.959)	BNP Paribas	20.03.2018	204.481	0,01 %
AUD	4.523.250	USD	(3.469.551)	BNP Paribas	20.03.2018	56.144	0,00 %
AUD	4.667.050	USD	(3.635.835)	Barclays Bank Plc	20.03.2018	11.522	0,00 %
AUD	430.952	USD	(330.411)	BNP Paribas	20.03.2018	5.473	0,00 %
						277.620	0,01 %
Summe Derivative Finanzinstrumente						339.029	0,01 %

	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva	22.390.326	0,81 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	2.784.037.672	100,00 %

ADR – American Depositary Receipt.

REIT – Real Estate Investment Trust.

Analyse des Gesamtvermögens	Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	2.761.008.794	99,17 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	299.523	0,01 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente	339.029	0,01 %
(e) Sonstige Aktiva und Passiva	22.390.326	0,81 %
Gesamtnettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	2.784.037.672	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Anteile	Kosten Euro (€)		Anteile	Erlöse Euro (€)
Käufe			Verkäufe		
Commonwealth Bank of Australia	1.232.702	72.021.088	Commonwealth Bank of Australia	210.481	11.470.082
Westpac Banking Corp.	2.420.879	56.379.126	AIA Group Ltd.	1.562.000	9.697.249
AIA Group Ltd.	8.572.000	52.413.668	Westpac Banking Corp.	398.324	8.872.652
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	2.091.453	44.896.178	Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	380.907	7.762.026
National Australia Bank Ltd.	1.918.552	42.382.026	BHP Billiton Ltd.	420.163	7.419.040
BHP Billiton Ltd.	2.276.550	39.990.170	National Australia Bank Ltd.	330.403	7.001.697
CSL Ltd.	322.958	28.395.927	CSL Ltd.	66.173	5.604.100
Wesfarmers Ltd.	806.229	24.183.032	Jardine Matheson Holdings Ltd.	89.300	5.043.917
CK Hutchison Holdings Ltd.	1.910.500	21.842.930	Contact Energy Ltd.	1.387.650	4.347.143
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	823.200	19.358.378	Wesfarmers Ltd.	141.168	4.055.067
Woolworths Group Ltd.	925.087	16.881.909	CK Hutchison Holdings Ltd.	351.000	3.853.157
DBS Group Holdings Ltd.	1.263.100	16.376.634	Qantas Airways Ltd.	911.597	3.253.461
Macquarie Group Ltd.	249.633	15.296.965	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	129.900	3.063.185
Jardine Strategic Holdings Ltd.	424.600	15.203.397	Wharf Holdings Ltd.	418.000	2.987.014
Singapore Telecommunications Ltd.	5.953.400	15.140.524	Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	410.600	2.808.613
Woodside Petroleum Ltd.	692.923	14.892.819	Cathay Pacific Airways Ltd.	2.087.128	2.727.174
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	2.228.800	14.717.349	Woolworths Group Ltd.	157.220	2.699.751
United Overseas Bank Ltd.	966.200	14.177.699	DBS Group Holdings Ltd.	199.500	2.619.649
Sun Hung Kai Properties Ltd.	1.017.000	13.781.894	Macquarie Group Ltd.	41.326	2.540.728
Rio Tinto Ltd.	300.668	13.182.766	Rio Tinto Ltd.	55.479	2.446.272
Transurban Group	1.466.227	11.655.361	Link REIT	349.500	2.410.171
Cheung Kong Property Holdings Ltd.	1.787.000	11.574.622	Sun Hung Kai Properties Ltd.	178.000	2.408.026
Scentre Group REIT	3.774.043	11.213.295	Singapore Telecommunications Ltd.	991.800	2.373.344
			Cheung Kong Property Holdings Ltd.	339.500	2.261.776
			Telstra Corp., Ltd.	707.968	2.140.516
			United Overseas Bank Ltd.	144.100	2.130.241

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	Euro (€) Zum 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.761.308.317	1.756.499.412
Derivative Finanzinstrumente	375.955	77.932
Barmittel	18.662.702	9.999.235
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	3.076.466	2.026.250
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	2.566.962	7.520.961
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	—	102.734
Bareinschüsse für Futures	1.166.595	363.086
Barsicherheiten	308.128	—
Sonstige Forderungen	117	—
Summe Umlaufvermögen	2.787.465.242	1.776.589.610
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	36.926	493.966
Überziehungskredit	—	1.237.589
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	8.047	22.906
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	—	7.152.262
Zahlbare Dividenden	2.623.022	3.698.532
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	239.069	1.093.570
Zahlbare Verwaltungsgebühren	520.506	331.702
Summe kurzfristige Passiva	3.427.570	14.030.527
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	2.784.037.672	1.762.559.083

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Nettovermögen	557.452.329	52.802.760	7.962.112
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.623.185	274.239	45.857
Nettoinventarwert je Anteil	212,51	192,54	173,63
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Gegenwert in Euro (€)	844.023.069	1.032.483.659	800.093.582
Nettovermögen	1.013.502.901	1.089.012.139	869.141.655
Anzahl der umlaufenden Anteile	3.972.150	5.362.976	4.608.562
Nettoinventarwert je Anteil	255,15	203,06	188,59
EUR-Anlegeranteile (€)			
Nettovermögen	3.092.888	1.990.455	4.674.795
Anzahl der umlaufenden Anteile	14.590	10.356	26.953
Nettoinventarwert je Anteil	211,99	192,20	173,44
Institutionelle AUD-Thesaurierungsanteile (\$)			
Gegenwert in Euro (€)	4.169.727	—	—
Nettovermögen	6.401.596	—	—
Anzahl der umlaufenden Anteile	59.543	—	—
Nettoinventarwert je Anteil	107,51	—	—
USD-Anlegeranteile (\$)			
Gegenwert in Euro (€)	3.506.524	2.720.739	1.002.979
Nettovermögen	4.210.634	2.869.699	1.089.536
Anzahl der umlaufenden Anteile	34.506	29.530	12.063
Nettoinventarwert je Anteil	122,03	97,18	90,32
Thesaurierende GBP-Anteile (£)			
Gegenwert in Euro (€)	574.656.034	335.610.433	272.874.409
Nettovermögen	510.106.819	286.476.857	201.115.050
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.824.390	1.175.971	1.060.292
Nettoinventarwert je Anteil	279,60	243,61	189,68
Ausschüttende GBP-Anteile (£)			
Gegenwert in Euro (€)	35.859.641	97.577.244	77.348.972
Nettovermögen	31.831.646	83.291.875	57.008.067
Anzahl der umlaufenden Anteile	158.540	456.504	386.647
Nettoinventarwert je Anteil	200,78	182,46	147,44
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Nettovermögen	466.825.772	239.076.497	13.028.624
Anzahl der umlaufenden Anteile	3.360.052	1.899.808	114.843
Nettoinventarwert je Anteil	138,93	125,84	113,45
Institutionelle Plus USD-Anteile (\$)			
Gegenwert in Euro (€)	265.399.988	4.677	4.216
Nettovermögen	318.692.306	4.933	4.580
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.569.949	50	50
Nettoinventarwert je Anteil	124,01	98,66	91,60
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile (£)			
Gegenwert in Euro (€)	4.077.271	143.353	86.173
Nettovermögen	3.619.285	122.366	63.512
Anzahl der umlaufenden Anteile	26.968	1.047	698
Nettoinventarwert je Anteil	134,21	116,87	90,99
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)			
Gegenwert in Euro (€)	24.974.429	149.266	6.567.206
Nettovermögen	22.169.134	127.413	4.840.190
Anzahl der umlaufenden Anteile	187.598	1.187	56.057
Nettoinventarwert je Anteil	118,17	107,34	86,34

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	45.097	28.863
Dividenden	113.578.839	59.526.086
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	232.303	306.757
Verschiedene Erträge	—	6.553
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	93.301.812	115.805.652
Summe Anlageerträge/(-verluste)	207.158.051	175.673.911
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5.503.680	3.290.241
Transaktionsgebühren und Provisionen	840.079	557.237
Sonstige Aufwendungen	3.253	824
Summe Aufwendungen	6.347.012	3.848.302
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	385	3.274
Ausgezahlte Ausschüttungen	2.623.022	3.698.532
Ertragsausgleich	1.205.148	(316.532)
Summe Finanzierungskosten	3.828.555	3.385.274
Nettoanlageerträge/(-verluste)	196.982.484	168.440.335
Ausländische Quellensteuer	(1.695.199)	(1.198.958)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	195.287.285	167.241.377

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	195.287.285	167.241.377
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	1.690.165.474	862.661.301
Rücknahmen	(866.425.354)	(450.986.663)
Reinvestitionen	2.451.184	—
Summe Kapitalgeschäfte ¹	826.191.304	411.674.638
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	1.021.478.589	578.916.015
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	1.762.559.083	1.183.643.068
Zum Jahresende	2.784.037.672	1.762.559.083

1 Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

SRI European Stock Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Asset Management, Limited.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Anlageziel

Der Fonds strebt ein langfristiges Kapitalwachstum durch die Nachbildung der Performance des FTSE Developed Europe an, eines nach Marktkapitalisierung gewichteten Index aus Stammaktien von grossen und mittleren Unternehmen in europäischen Industrieländern.

Portfoliomerkmale

	Fonds	FTSE Developed Europe Index
Anzahl der Aktien	516	554
Mittlere Marktkapitalisierung		
US-Dollar	\$ 43,3 Mrd.	\$ 49,0 Mrd.
Euro	€ 36,1 Mrd.	€ 40,8 Mrd.
Britisches Pfund	£ 32,0 Mrd.	£ 36,2 Mrd.
Kurs/Gewinn-Verhältnis	17,1x	17,4x
Kurs/Buch-Verhältnis	1,9x	1,9x
Rendite	3,0 %	3,1 %
Eigenkapitalrendite	12,2 %	12,0 %
Ertragszuwachsrate	3,2 %	1,2 %
Portfolioumschlag ¹	-34 %	—
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,30 %	
Anlegeranteile	0,35 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,20 %	
Thesaurierende Anteile	0,30 %	
Ausschüttende Anteile	0,30 %	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,20 %	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,20 %	
Kurzfristige Reserven	0,0 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	FTSE Developed Europe Index
R ²	1,00	1,00
Beta	1,00	1,00

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds	FTSE Developed Europe Index
Grundstoffe	6,9 %	7,1 %
Konsumgüter	19,1	19,0
Verbraucherdienstleistungen	6,6	6,3
Finanzwerte	22,5	22,7
Gesundheitswesen	12,5	12,4
Industriegüter	14,3	14,1
Öl und Gas	6,7	7,2
Technologie	3,8	3,9
Telekommunikation	3,7	3,6
Versorger	3,9	3,7

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	FTSE Developed Europe Index
Europa		
Vereinigtes Königreich	28,7 %	29,1 %
Frankreich	15,2	15,8
Deutschland	15,1	15,2
Schweiz	13,0	12,8
Niederlande	5,5	5,3
Spanien	5,4	5,2
Schweden	4,4	4,3
Italien	4,1	4,1
Dänemark	2,7	2,8
Belgien	1,8	1,8
Finnland	1,6	1,6
Norwegen	1,2	1,0
Sonstige	1,3	1,0

Die 10 grössten Positionen² (% des Gesamtvermögens)

Royal Dutch Shell plc	Integrierter Öl- und Gaskonzern	3,6 %
Nestle SA	Nahrungsmittelerzeugnisse	2,8
Novartis AG	Pharma	2,2
Roche Holding AG	Pharma	2,0
Unilever	Körperpflegeprodukte	1,7
British American Tobacco plc	Tabak	1,6
Banco Santander SA	Banken	1,1
Sanofi	Pharma	1,1
AstraZeneca plc	Pharma	1,1
Allianz SE	Mehrspararten-Versicherung	1,1
Zehn grösste Positionen		18,3 %

Anlagefokus

Stil	Wert	Mischung	Wachstum
Marktkapitalisierung	Gross		
	Mittel		
	Klein		

¹ Ein negativer Portfolioumschlag deutet darauf hin, dass der Gesamtwert der Zeichnungen und Rückkäufe über dem Wert der Wertpapiertransaktionen gelegen hat.

² Die aufgeführten Positionen schliessen etwaige vorübergehende Baranlagen und Aktienindexprodukte aus.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

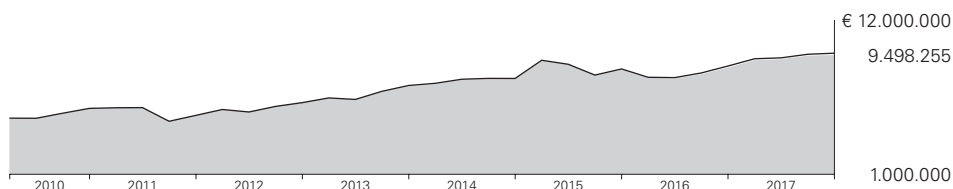
Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

SRI European Stock Fund
 Benchmark: FTSE Developed Europe Index

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 29. Juni 2010–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



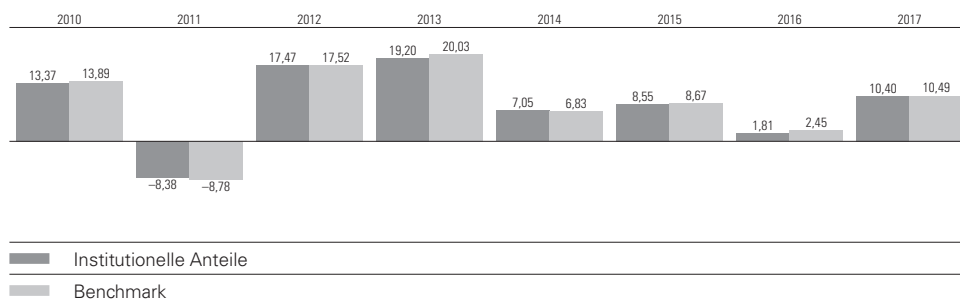
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
— Institutionelle Anteile	10,40 %	9,26 %	8,92 %	€ 9.498.255
— Benchmark	10,49	9,54	9,12	9.627.810

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Anlegeranteile	10,34 %	6,42 %	€ 126.980
Benchmark	10,49	6,62	127.903

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile	10,51 %	7,85 %	€ 271.985.200
Benchmark	10,49	7,90	272.549.719

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,09 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,15 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,02 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 29. Juni 2010–31. Dezember 2017



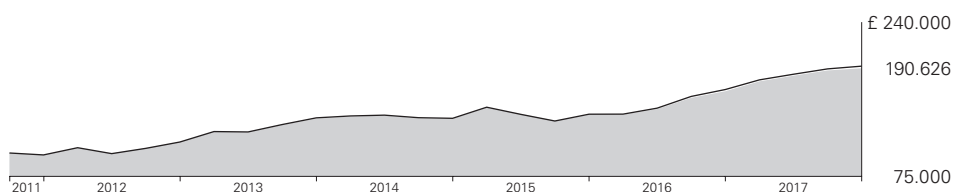
1 Für institutionelle Anteile, 29. Juni 2010; für Anlegeranteile, 27. Februar 2014; für institutionelle Plus-Anteile, 6. Dezember 2013.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

SRI European Stock Fund
 Benchmark: FTSE Developed Europe Index

In GBP

Kumulative Wertentwicklung: 25. Oktober 2011–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile	14,81 %	11,27 %	11,00 %	£ 190.626
Benchmark	14,90	11,54	11,21	192.904

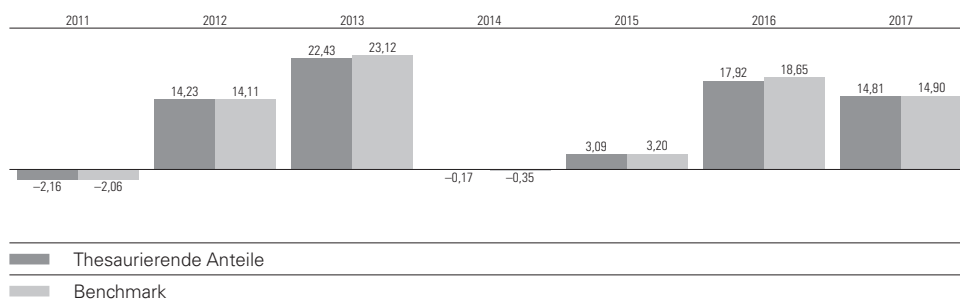
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Ausschüttende Anteile	14,81 %	11,27 %	11,00 %	£ 190.613
Benchmark	14,90	11,54	11,21	192.904

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	14,92 %	11,27 %	9,88 %	£ 273.649.200
Benchmark	14,90	11,54	10,03	274.928.541

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	14,92 %	11,27 %	9,88 %	£ 273.706.588
Benchmark	14,90	11,54	10,03	274.928.541

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,09 Prozentpunkte für Thesaurierungsanteile, 0,09 Prozentpunkte für Ertragsanteile, 0,02 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile und 0,02 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Ertragsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 25. Oktober 2011–31. Dezember 2017



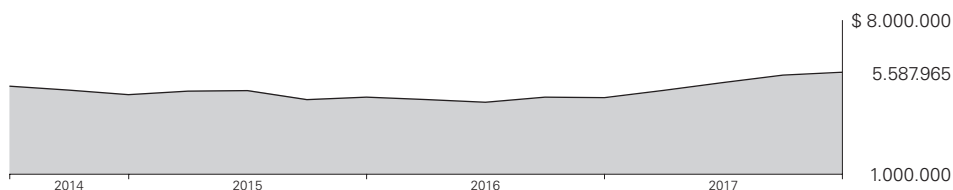
1 Für Thesaurierungs- und Ertragsanteile, 25. Oktober 2011; für institutionelle Plus-Thesaurierungs- und institutionelle Plus-Ertragsanteile, 2. September 2014.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

SRI European Stock Fund
 Benchmark: FTSE Developed Europe Index

In US-Dollar

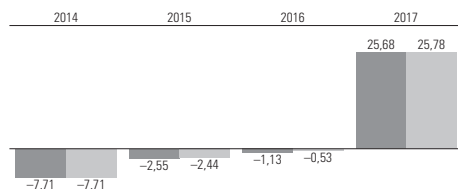
Kumulative Wertentwicklung: 2. September 2014–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
■ Institutionelle Anteile	25,68 %	3,40 %	\$ 5.587.965
— Benchmark	25,78	3,64	5.632.604

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,10 Prozentpunkte für institutionelle Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 2. September 2014–31. Dezember 2017



■ Institutionelle Anteile
■ Benchmark

1 2. September 2014.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens
Aktien 99,43 % (2016: 99,36 %)				Frankreich 15,31 % (2016: 14,85 %)			
Österreich 0,67 % (2016: 0,70 %)							
OMV AG	25.889	1.367.716	0,23 %	Sanofi	92.208	6.625.145	1,12 %
Voestalpine AG	27.197	1.355.634	0,23 %	BNP Paribas SA	89.001	5.540.312	0,94 %
Erste Group Bank AG	23.054	832.365	0,14 %	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	19.670	4.827.018	0,82 %
Raiffeisen Bank International AG	12.581	379.946	0,07 %	AXA SA	150.912	3.732.808	0,63 %
ANDRITZ AG	525	24.720	0,00 %	L'Oreal SA (Prime De Fidelite)	19.578	3.620.951	0,61 %
		3.960.381	0,67 %	Air Liquide SA (Prime De Fidelite)	32.860	3.451.943	0,59 %
				Vinci SA	38.314	3.262.437	0,55 %
Belgien 1,83 % (2016: 1,92 %)				Schneider Electric SE	45.261	3.207.194	0,54 %
Anheuser-Busch InBev SA	55.326	5.152.510	0,88 %	Danone SA	45.108	3.155.305	0,54 %
KBC Group NV	25.894	1.841.322	0,31 %	Societe Generale SA	59.495	2.561.260	0,44 %
Solvay SA	6.743	781.514	0,13 %	Kering	6.031	2.370.183	0,40 %
UCB SA	9.871	653.263	0,11 %	Orange SA	162.783	2.356.284	0,40 %
Groupe Bruxelles Lambert SA	6.749	607.342	0,10 %	Cie Generale des Etablissements Michelin	17.644	2.109.340	0,36 %
Umicore SA	15.120	596.560	0,10 %	Pernod Ricard SA	15.970	2.107.241	0,36 %
Ageas	12.729	518.261	0,09 %	Cie de Saint-Gobain	44.376	2.040.408	0,35 %
Proximus SADP	10.862	297.076	0,05 %	Vivendi SA	80.031	1.794.295	0,30 %
Colruyt SA	3.446	149.419	0,03 %	Essilor International Cie Generale d'Optique SA	14.681	1.687.581	0,29 %
Sofina SA	662	86.821	0,02 %	Dassault Aviation SA	1.249	1.621.077	0,28 %
Ackermans & van Haaren NV	565	82.010	0,01 %	Legrand SA	22.951	1.473.225	0,25 %
		10.766.098	1,83 %	Unibail-Rodamco SE REIT	6.921	1.453.410	0,25 %
				Renault SA	16.927	1.420.345	0,24 %
Dänemark 2,67 % (2016: 2,38 %)				Credit Agricole SA (Prime De Fidelite)	101.749	1.404.136	0,24 %
Novo Nordisk A/S Klasse B	132.111	5.935.328	1,01 %	Valeo SA	19.551	1.217.441	0,21 %
Danske Bank A/S	75.083	2.436.398	0,41 %	Capgemini SE	11.501	1.137.334	0,19 %
AP Moller-Maersk A/S Klasse B	747	1.087.576	0,19 %	Atos SE	8.665	1.051.498	0,18 %
Vestas Wind Systems A/S	13.767	792.873	0,14 %	Publicis Groupe SA	17.946	1.016.641	0,17 %
DSV A/S	11.425	749.755	0,13 %	Hermes International	2.276	1.015.665	0,17 %
Coloplast A/S Klasse B	10.003	663.021	0,11 %	STMicroelectronics NV	49.781	906.263	0,15 %
Novozymes A/S Klasse B	12.086	575.451	0,10 %	Dassault Systemes SE	10.197	903.352	0,15 %
Genmab A/S	3.956	546.740	0,09 %	Veolia Environnement SA	40.215	855.574	0,15 %
Orsted A/S	10.598	482.113	0,08 %	Bouygues SA	19.470	843.246	0,14 %
Carlsberg A/S Klasse B	4.740	474.290	0,08 %	TechnipFMC plc (XPAR)	31.960	826.166	0,14 %
Jyske Bank A/S	8.190	388.521	0,07 %	Carrefour SA	42.661	769.604	0,13 %
ISS A/S	11.786	380.391	0,06 %	Zodiac Aerospace	30.313	755.703	0,13 %
Chr Hansen Holding A/S	4.539	354.807	0,06 %	Arkema SA	6.655	675.815	0,11 %
H Lundbeck A/S	6.013	254.397	0,04 %	Ipsen SA	6.575	654.673	0,11 %
TDC A/S	48.658	249.190	0,04 %	Peugeot SA	35.320	598.851	0,10 %
Pandora A/S	2.640	239.518	0,04 %	Eurofins Scientific SE	1.130	573.588	0,10 %
Tryg A/S	5.147	107.289	0,02 %	Aeroports de Paris	3.416	541.436	0,09 %
AP Moller-Maersk A/S Klasse A	18	25.046	0,00 %	Sodexo SA (Prime De Fidelite)	4.830	541.202	0,09 %
		15.742.704	2,67 %	Natixis SA	81.964	540.635	0,09 %
				Wendel SA	3.613	521.717	0,09 %
Finnland 1,63 % (2016: 1,76 %)				CNP Assurances	26.441	509.121	0,09 %
Nokia OYJ	406.046	1.581.143	0,27 %	Eiffage SA	5.375	490.952	0,08 %
Sampo OYJ Klasse A	30.948	1.417.419	0,24 %	Suez	31.306	459.102	0,08 %
Kone OYJ Klasse B	28.860	1.292.351	0,22 %	Accor SA	10.540	453.220	0,08 %
UPM-Kymmene OYJ	41.233	1.068.347	0,18 %	Gecina SA REIT	2.862	440.462	0,08 %
Neste OYJ	16.741	893.132	0,15 %	Bollere SA	95.747	433.542	0,07 %
Fortum OYJ	47.432	782.628	0,13 %	Klepierre SA REIT	11.417	418.604	0,07 %
Stora Enso OYJ Klasse R	51.110	675.674	0,11 %	Eurazeo SA	5.421	417.417	0,07 %
Wartsila OYJ Abp	11.925	627.255	0,11 %	Edenred	17.045	412.148	0,07 %
Nokian Renkaat OYJ	8.308	314.042	0,05 %	Faurecia	6.161	401.266	0,07 %
Orion OYJ Klasse B	9.057	281.492	0,05 %	Bureau Veritas SA	16.649	379.431	0,06 %
Metso OYJ	7.638	217.454	0,04 %	Teleperformance	3.064	365.995	0,06 %
Kesko OYJ Klasse B	3.885	175.796	0,03 %	Imerys SA	4.603	361.520	0,06 %
Elisa OYJ	4.457	145.833	0,03 %	Orpea	3.593	353.192	0,06 %
Huhtamaki OYJ	3.496	122.360	0,02 %				
		9.594.926	1,63 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens
SCOR SE	10.158	340.750	0,06 %	Porsche Automobil Holding SE - Vorzugsaktien	12.556	876.158	0,15 %
Ingenico Group SA	3.798	338.060	0,06 %	Covestro AG	9.991	859.526	0,15 %
Iliad SA	1.688	337.178	0,06 %	Deutsche Wohnen SE	21.369	779.114	0,13 %
Rexel SA	22.016	332.882	0,06 %	RWE AG	38.831	660.127	0,11 %
Amundi SA	4.496	317.642	0,05 %	MAN SE	6.304	601.402	0,10 %
Ubisoft Entertainment SA	4.947	317.301	0,05 %	Beiersdorf AG	5.952	582.701	0,10 %
SES SA Klasse A	23.221	302.105	0,05 %	Symrise AG	7.706	551.904	0,09 %
BioMerieux	3.925	293.158	0,05 %	Wirecard AG	5.779	537.851	0,09 %
Getlink SE	27.021	289.665	0,05 %	GEA Group AG	12.409	496.484	0,09 %
Rubis SCA	4.515	266.295	0,05 %	QIAGEN NV	18.437	482.865	0,08 %
Casino Guichard Perrachon SA	4.952	250.373	0,04 %	LANXESS AG	7.143	473.509	0,08 %
Euler Hermes Group	1.940	236.311	0,04 %	Uniper SE	17.061	443.586	0,08 %
Societe BIC SA	2.443	223.925	0,04 %	Brenntag AG	7.667	404.588	0,07 %
Eutelsat Communications SA	11.105	214.271	0,04 %	Deutsche Lufthansa AG	12.805	393.370	0,07 %
Sodexo SA	1.858	208.189	0,04 %	Innogy SE	11.617	379.585	0,07 %
L'Oreal SA (XPAR)	1.045	193.273	0,03 %	OSRAM Licht AG	4.671	349.998	0,06 %
SEB SA	1.228	189.665	0,03 %	United Internet AG	6.041	346.391	0,06 %
Remy Cointreau SA	1.574	181.797	0,03 %	Evonik Industries AG	9.206	288.792	0,05 %
Electricite de France SA	17.224	179.474	0,03 %	ProSiebenSat.1 Media SE	9.547	274.047	0,05 %
JCDecaux SA	5.299	178.073	0,03 %	Zalando SE	5.743	253.352	0,04 %
Lagardere SCA	6.563	175.429	0,03 %	Hochtief AG	1.646	242.950	0,04 %
Electricite de France SA (Prime De Fidelite)	15.860	165.261	0,03 %	KION Group AG	3.368	242.429	0,04 %
ICADE REIT	1.791	146.737	0,03 %	K+S AG	11.538	239.471	0,04 %
Air Liquide SA	1.285	134.989	0,02 %	Telefonica Deutschland Holding AG	56.665	237.200	0,04 %
SEB SA (Prime De Fidelite)	871	134.526	0,02 %	HUGO BOSS AG	3.128	221.900	0,04 %
Credit Agricole SA (XPAR)	7.147	98.629	0,02 %	Hannover Rueck SE	1.606	168.469	0,03 %
Cie Plastic Omnium SA	2.449	92.805	0,02 %	Sartorius AG - Vorzugsaktien	2.003	159.319	0,03 %
Sartorius Stedim Biotech	1.449	87.360	0,02 %	METRO AG	9.501	158.192	0,03 %
Fonciere Des Regions REIT	797	75.301	0,01 %	Bayerische Motoren Werke AG - Vorzugsaktien	2.084	155.550	0,03 %
ALD SA	5.717	73.835	0,01 %	Axel Springer SE	2.263	147.389	0,03 %
Electricite de France SA (XPAR)	6.552	68.272	0,01 %	Wacker Chemie AG	869	140.952	0,02 %
Elior Group SA	3.897	67.126	0,01 %	Fielmann AG	1.896	139.394	0,02 %
		90.174.931	15,31 %	LEG Immobilien AG	1.454	138.552	0,02 %
Deutschland 15,01 % (2016: 14,64 %)				RTL Group SA	1.891	126.829	0,02 %
Allianz SE	34.006	6.512.149	1,11 %	Ceconomy AG	9.501	119.760	0,02 %
Bayer AG	62.444	6.494.176	1,10 %	Fuchs Petrolub SE - Vorzugsaktien	2.044	90.447	0,02 %
BASF SE	70.668	6.483.082	1,10 %	Suedzucker AG	4.766	86.169	0,02 %
Siemens AG	55.600	6.457.940	1,10 %	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	914	83.960	0,01 %
SAP SE	67.517	6.309.464	1,07 %	Rational AG	138	74.134	0,01 %
Daimler AG	75.178	5.322.602	0,90 %	Fuchs Petrolub SE	1.470	59.344	0,01 %
Deutsche Telekom AG	236.838	3.504.018	0,60 %	Delivery Hero AG	1.109	36.597	0,01 %
Deutsche Post AG	80.390	3.195.502	0,54 %	RWE AG - Vorzugsaktien	1.451	20.793	0,00 %
Linde AG	13.997	2.724.516	0,46 %	Puma SE	42	15.246	0,00 %
Adidas AG	14.123	2.360.659	0,40 %			88.405.376	15,01 %
Bayerische Motoren Werke AG	26.477	2.298.998	0,39 %	Irland 0,51 % (2016: 0,41 %)			
Deutsche Bank AG	131.136	2.081.784	0,35 %	Kerry Group plc Klasse A	10.563	987.640	0,17 %
Fresenius SE & Co. KGaA	30.251	1.968.433	0,33 %	Paddy Power Betfair plc	6.211	617.480	0,11 %
Infineon Technologies AG	80.587	1.840.204	0,31 %	Bank of Ireland Group plc	68.377	485.135	0,08 %
Continental AG	7.848	1.766.192	0,30 %	Smurfit Kappa Group plc (XDUB)	12.716	358.464	0,06 %
thyssenkrupp AG	72.547	1.756.726	0,30 %	AIB Group plc	40.435	222.393	0,04 %
MTU Aero Engines AG	11.585	1.730.799	0,29 %	Kingspan Group plc	5.197	189.197	0,03 %
Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen	9.550	1.726.162	0,29 %	Glanbia plc	9.690	144.381	0,02 %
E.ON SE	156.249	1.415.772	0,24 %			3.004.690	0,51 %
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA	15.777	1.384.905	0,24 %	Italien 4,11 % (2016: 3,51 %)			
Vonovia SE	31.872	1.319.182	0,22 %	Eni SpA	321.706	4.439.543	0,75 %
Deutsche Börse AG	13.227	1.280.374	0,22 %	Enel SpA	567.025	2.908.838	0,49 %
Merck KGaA	13.992	1.255.782	0,21 %	Intesa Sanpaolo SpA	1.014.676	2.810.653	0,48 %
Henkel AG & Co. KGaA - Vorzugsaktien	10.304	1.137.046	0,19 %	UniCredit SpA	167.188	2.604.789	0,44 %
HeidelbergCement AG	11.530	1.040.582	0,18 %	Assicurazioni Generali SpA	86.694	1.317.749	0,22 %
Commerzbank AG	76.220	953.131	0,16 %	Snam SpA	292.788	1.194.575	0,20 %
Henkel AG & Co. KGaA	9.448	944.800	0,16 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens
Fiat Chrysler Automobiles NV	76.711	1.143.761	0,19 %	Portugal 0,34 % (2016: 0,37 %)			
Ferrari NV	9.859	862.170	0,15 %	Galp Energia SGPS SA	120.546	1.847.367	0,31 %
Tenaris SA	63.228	832.081	0,14 %	EDP-Energias de Portugal SA	35.878	103.508	0,02 %
CNH Industrial NV	70.583	788.412	0,13 %	Jeronimo Martins SGPS SA	1.466	23.742	0,01 %
Atlantia SpA	29.885	786.573	0,13 %	EDP Renovaveis SA	2.767	19.278	0,00 %
Telecom Italia SpA	748.497	539.292	0,09 %	Banco Espirito Santo SA	430.102	412	0,00 %
Mediobanca SpA	48.526	459.056	0,08 %			1.994.307	0,34 %
Luxottica Group SpA	8.707	445.363	0,08 %	Spanien 5,43 % (2016: 5,22 %)			
FinecoBank Banca Fineco SpA	41.481	354.040	0,06 %	Banco Santander SA	1.228.741	6.732.272	1,14 %
Saipem SpA	90.519	344.515	0,06 %	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	493.778	3.511.749	0,60 %
EXOR NV	6.644	339.508	0,06 %	Repsol SA (XMCE)	193.947	2.859.749	0,49 %
Recordati SpA	8.808	326.424	0,06 %	Iberdrola SA	441.448	2.851.754	0,48 %
Unione di Banche Italiane SpA	71.324	260.047	0,04 %	Telefonica SA	301.091	2.446.364	0,42 %
Prysmian SpA	8.230	223.774	0,04 %	Industria de Diseno Textil SA	75.405	2.190.138	0,37 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	45.590	220.838	0,04 %	Amadeus IT Group SA Klasse A	25.521	1.534.067	0,26 %
Telecom Italia SpA (Non CVA)	280.414	167.127	0,03 %	CaixaBank SA	280.602	1.091.261	0,19 %
Davide Campari-Milano SpA	25.921	167.061	0,03 %	Bankinter SA	103.328	816.704	0,14 %
Banco BPM SpA	63.042	165.170	0,03 %	Banco de Sabadell SA	444.061	735.365	0,12 %
A2A SpA	93.203	143.719	0,02 %	Grifols SA	29.804	727.963	0,12 %
Moncler SpA	4.561	118.951	0,02 %	Abertis Infraestructuras SA	38.703	717.941	0,12 %
Italgas SpA	17.186	87.477	0,02 %	Aena SME SA	4.117	695.773	0,12 %
Buzzi Unicem SpA-RSP	6.034	76.813	0,01 %	Ferrovial SA	34.704	656.773	0,11 %
Mediaset SpA	11.819	38.175	0,01 %	International Consolidated Airlines Group SA	84.939	622.924	0,11 %
Parmalat SpA	9.181	28.461	0,01 %	Acerinox SA	51.033	608.058	0,10 %
		24.194.955	4,11 %	Enagas SA	20.925	499.480	0,08 %
Niederlande 5,17 % (2016: 4,74 %)				Gas Natural SDG SA	25.295	486.929	0,08 %
Unilever NV	114.252	5.364.703	0,91 %	Endesa SA	25.489	455.106	0,08 %
ING Groep NV	321.553	4.927.800	0,84 %	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	12.879	420.113	0,07 %
ASML Holding NV	23.527	3.414.944	0,58 %	Bankia SA	96.634	385.280	0,07 %
Koninklijke Philips NV	67.285	2.122.169	0,36 %	Red Electrica Corp. SA	17.529	327.968	0,06 %
ArcelorMittal	75.952	2.059.438	0,35 %	Grifols SA - Vorzugsaktien Klasse B	10.996	209.089	0,04 %
Koninklijke Ahold Delhaize NV	90.014	1.650.407	0,28 %	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	11.025	126.016	0,02 %
Heineken NV	16.641	1.446.602	0,24 %	Mapfre SA	45.764	122.556	0,02 %
Akzo Nobel NV	17.803	1.299.975	0,22 %	Repsol SA - Rights Issue 5.1.2018	193.947	73.506	0,01 %
ABN AMRO Group NV	43.384	1.167.030	0,20 %	Zardoya Otis SA	6.537	59.617	0,01 %
Koninklijke DSM NV	13.064	1.040.809	0,18 %	Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	2.707	11.648	0,00 %
RELX NV	54.076	1.036.366	0,17 %			31.976.163	5,43 %
Wolters Kluwer NV	17.222	748.813	0,13 %	Schweden 4,39 % (2016: 4,78 %)			
NN Group NV	20.628	745.083	0,13 %	Nordea Bank AB	273.521	2.762.599	0,47 %
Aegon NV	114.485	608.488	0,10 %	Atlas Copco AB Klasse A	68.520	2.468.561	0,42 %
Koninklijke KPN NV	207.004	601.968	0,10 %	Swedbank AB Klasse A	104.053	2.094.491	0,36 %
Heineken Holding NV	7.037	580.482	0,10 %	Volvo AB Klasse B	108.703	1.688.335	0,29 %
Koninklijke Vopak NV	14.299	522.914	0,09 %	Skandinaviska Enskilda Banken AB Klasse A	171.634	1.681.154	0,29 %
Altice NV Klasse A	32.986	288.496	0,05 %	Investor AB Klasse B	39.600	1.506.818	0,26 %
Randstad Holding NV	5.503	281.974	0,05 %	Svenska Handelsbanken AB Klasse A	129.868	1.482.085	0,25 %
Gemalto NV	4.213	208.543	0,03 %	Boliden AB	49.244	1.405.462	0,24 %
Boskalis Westminster	3.984	125.217	0,02 %	Sandvik AB	80.383	1.174.895	0,20 %
Altice NV Klasse B	14.016	123.831	0,02 %	Telefonaktiebolaget LM Ericsson Klasse B	209.185	1.145.762	0,19 %
Philips Lighting NV	2.049	62.699	0,01 %	Hennes & Mauritz AB Klasse B	62.549	1.077.098	0,18 %
OCI NV	2.405	50.577	0,01 %	Assa Abloy AB Klasse B	58.301	1.010.470	0,17 %
GrandVision NV	846	18.016	0,00 %	Essity AB Klasse B	34.805	824.851	0,14 %
		30.497.344	5,17 %	Hexagon AB Klasse B	16.820	702.975	0,12 %
Norwegen 1,19 % (2016: 1,07 %)				Telia Co. AB	183.794	683.277	0,12 %
Statoil A.S.A	148.429	2.647.667	0,45 %	Lundin Petroleum AB	29.354	560.713	0,09 %
DNB A.S.A	96.081	1.487.912	0,25 %	Skanska AB Klasse B	27.326	472.501	0,08 %
Norsk Hydro A.S.A	140.905	894.486	0,15 %				
Telenor A.S.A	41.014	734.528	0,13 %				
Yara International A.S.A	10.161	389.711	0,07 %				
Orkla A.S.A	33.971	301.084	0,05 %				
Aker BP A.S.A	12.239	251.590	0,04 %				
Marine Harvest A.S.A	14.051	198.853	0,03 %				
Schibsted A.S.A Klasse A	4.015	95.901	0,02 %				
		7.001.732	1,19 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens
SKF AB Klasse B	23.061	427.371	0,07 %	Logitech International SA	4.279	120.306	0,02 %
Kinnevik AB Klasse B	14.120	398.256	0,07 %	Sulzer AG	868	87.677	0,01 %
Alfa Laval AB	17.309	341.196	0,06 %	DKSH Holding AG	1.109	80.793	0,01 %
Industrivarden AB Klasse A	15.071	324.366	0,05 %	Barry Callebaut AG	46	79.918	0,01 %
Svenska Cellulosa AB SCA Klasse B	35.751	307.454	0,05 %	Pargesa Holding SA	100	7.221	0,00 %
Electrolux AB	10.356	278.399	0,05 %			76.160.661	12,93 %
Svenska Handelsbanken AB Klasse B	18.322	210.586	0,04 %	Vereinigtes Königreich 28,24 % (2016: 29,33 %)			
Tele2 AB Klasse B	19.995	205.003	0,03 %	Royal Dutch Shell plc Klasse B	466.327	13.178.061	2,24 %
Atlas Copco AB Klasse B	6.193	198.170	0,03 %	British American Tobacco plc	168.387	9.518.884	1,62 %
Securitas AB Klasse B	12.413	180.800	0,03 %	Royal Dutch Shell plc Klasse A	295.324	8.250.823	1,40 %
Trelleborg AB Klasse B	4.833	93.400	0,02 %	AstraZeneca plc	113.340	6.538.601	1,11 %
Saab AB Klasse B	1.753	71.143	0,01 %	Diageo plc	207.726	6.376.821	1,08 %
Getinge AB Klasse B	3.074	37.207	0,01 %	Vodafone Group plc	2.183.223	5.779.800	0,98 %
ICA Gruppen AB	819	24.816	0,00 %	Lloyds Banking Group plc	5.985.404	4.589.150	0,78 %
Industrivarden AB Klasse C	714	14.706	0,00 %	Prudential plc	209.847	4.504.624	0,76 %
Arjo AB	3.074	7.320	0,00 %	Unilever plc	94.570	4.395.182	0,75 %
		25.862.240	4,39 %	Reckitt Benckiser Group plc	53.913	4.202.267	0,71 %
Schweiz 12,93 % (2016: 13,68 %)				Rolls-Royce Holdings plc	344.056	3.282.913	0,56 %
Nestle SA	229.764	16.454.075	2,79 %	Barclays plc	1.422.756	3.255.271	0,55 %
Novartis AG	184.782	13.011.709	2,21 %	Shire plc	70.842	3.112.449	0,53 %
Roche Holding AG	54.445	11.468.917	1,95 %	National Grid plc	308.437	3.040.682	0,52 %
UBS Group AG	257.408	3.946.317	0,67 %	Imperial Brands plc	79.491	2.835.148	0,48 %
ABB Ltd.	147.586	3.294.320	0,56 %	Compass Group plc	140.431	2.531.219	0,43 %
Zurich Insurance Group AG	11.104	2.814.479	0,48 %	Anglo American plc	133.893	2.337.202	0,40 %
Cie Financiere Richemont SA	36.680	2.767.818	0,47 %	RELX plc	117.041	2.292.896	0,39 %
Credit Suisse Group AG	184.306	2.740.540	0,47 %	Standard Chartered plc	250.623	2.202.511	0,37 %
Swiss Re AG	22.760	1.774.813	0,30 %	Aviva plc	363.068	2.071.640	0,35 %
LafargeHolcim Ltd.	37.251	1.749.255	0,30 %	BT Group plc Klasse A	666.218	2.039.167	0,35 %
Givaudan SA	646	1.243.221	0,21 %	CRH plc	64.753	1.938.199	0,33 %
Lonza Group AG	5.364	1.206.944	0,21 %	Experian plc	101.006	1.861.561	0,32 %
Sika AG	141	932.626	0,16 %	Legal & General Group plc	586.469	1.805.641	0,31 %
Swisscom AG	2.044	905.685	0,15 %	SSE plc	111.666	1.660.511	0,28 %
Geberit AG	2.396	878.603	0,15 %	WPP plc	107.229	1.619.899	0,27 %
Banque Cantonale Vaudoise	1.364	856.740	0,15 %	Smith & Nephew plc	104.979	1.523.229	0,26 %
Swatch Group AG	2.036	691.438	0,12 %	Tesco plc	639.745	1.508.062	0,26 %
Partners Group Holding AG	1.189	678.744	0,12 %	London Stock Exchange Group plc	29.578	1.263.859	0,21 %
Julius Baer Group Ltd.	11.878	604.974	0,10 %	Sky plc	108.719	1.239.461	0,21 %
Adecco Group AG	9.312	593.250	0,10 %	Standard Life Aberdeen plc	246.343	1.211.632	0,21 %
Schindler Holding AG REG	2.934	552.861	0,09 %	Randgold Resources Ltd.	14.458	1.206.905	0,20 %
SGS SA	240	521.151	0,09 %	Ferguson plc	19.445	1.167.567	0,20 %
Kuehne + Nagel International AG	3.274	482.631	0,08 %	Meggitt plc	203.143	1.103.509	0,19 %
Schindler Holding AG	2.324	445.464	0,08 %	Associated British Foods plc	34.655	1.100.935	0,19 %
Swiss Life Holding AG	1.458	429.857	0,07 %	Old Mutual plc	406.697	1.061.558	0,18 %
Clariant AG	17.406	405.334	0,07 %	Royal Bank of Scotland Group plc	324.661	1.016.768	0,17 %
Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	76	386.436	0,07 %	RSA Insurance Group plc	141.136	1.005.646	0,17 %
Baloise Holding AG	2.948	382.173	0,06 %	Rentokil Initial plc	277.409	993.790	0,17 %
Vifor Pharma AG	3.498	373.362	0,06 %	Sage Group plc	102.609	922.434	0,16 %
Sonova Holding AG	2.798	363.923	0,06 %	Micro Focus International plc	32.442	922.087	0,16 %
Swiss Prime Site AG	4.379	336.794	0,06 %	Croda International plc	17.872	890.707	0,15 %
EMS-Chemie Holding AG	551	306.300	0,05 %	Antofagasta plc	78.443	888.111	0,15 %
Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG REG	5	301.172	0,05 %	Intertek Group plc	15.141	885.256	0,15 %
Dufry AG	2.240	277.373	0,05 %	Centrica plc	563.489	871.571	0,15 %
PSP Swiss Property AG	3.295	260.040	0,04 %	Kingfisher plc	228.642	869.829	0,15 %
Flughafen Zurich AG	1.167	222.294	0,04 %	Johnson Matthey plc	24.889	862.183	0,15 %
Straumann Holding AG	323	190.044	0,03 %	Bunzl plc	35.737	834.170	0,14 %
Temenos Group AG	1.641	175.294	0,03 %	GKN plc	228.459	822.034	0,14 %
ams AG	2.292	173.245	0,03 %	Mondi plc	37.684	819.759	0,14 %
Swatch Group AG REG	2.583	164.448	0,03 %	InterContinental Hotels Group plc	15.387	817.995	0,14 %
Helvetia Holding AG	314	147.182	0,03 %	Land Securities Group plc REIT	71.878	816.213	0,14 %
Roche Holding AG BR	666	140.123	0,02 %	Ashtead Group plc	36.349	815.697	0,14 %
Aryzta AG	4.020	132.777	0,02 %	Segro plc REIT	122.449	809.730	0,14 %
				Schroders plc	20.145	797.927	0,14 %
				John Wood Group plc	106.860	782.484	0,13 %
				Carnival plc	14.140	779.261	0,13 %
				British Land Co., plc REIT	99.827	777.655	0,13 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens
Burberry Group plc	38.511	777.445	0,13 %	Bellway plc	10.166	408.049	0,07 %
Persimmon plc	24.770	764.023	0,13 %	Booker Group plc	153.698	396.507	0,07 %
St James's Place plc	55.210	762.527	0,13 %	Marks & Spencer Group plc	111.745	396.287	0,07 %
Informa plc	93.154	757.679	0,13 %	Intu Properties plc REIT	137.860	392.921	0,07 %
CYBG plc	195.816	749.360	0,13 %	Just Eat plc	43.646	384.010	0,07 %
Worldpay Group plc	154.094	739.507	0,13 %	Rightmove plc	7.356	372.907	0,06 %
Coca-Cola HBC AG	26.871	732.565	0,12 %	Spirax-Sarco Engineering plc	5.867	371.449	0,06 %
DS Smith plc	122.163	712.192	0,12 %	easyJet plc	22.209	366.283	0,06 %
Severn Trent plc	28.639	697.526	0,12 %	Polymetal International plc	33.246	344.755	0,06 %
TUI AG	39.195	679.983	0,12 %	Investec plc	56.353	339.639	0,06 %
WM Morrison Supermarkets plc	272.927	676.112	0,11 %	Derwent London plc REIT	9.460	332.288	0,06 %
DCC plc	8.015	674.031	0,11 %	Travis Perkins plc	18.529	327.090	0,06 %
Fresnillo plc	40.957	659.337	0,11 %	Pennon Group plc	36.623	323.045	0,05 %
3i Group plc	63.921	657.808	0,11 %	RPC Group plc	30.371	301.598	0,05 %
Taylor Wimpey plc	266.928	620.656	0,11 %	Merlin Entertainments plc	64.256	262.692	0,04 %
Whitbread plc	13.699	617.299	0,10 %	Capital & Counties Properties plc	70.615	254.323	0,04 %
Pearson plc	72.643	602.308	0,10 %	ConvaTec Group plc	108.012	250.052	0,04 %
Weir Group plc	24.818	593.559	0,10 %	Auto Trader Group plc	58.902	234.102	0,04 %
Barratt Developments plc	80.704	588.683	0,10 %	Mediclinic International plc	31.865	233.152	0,04 %
Hammerson plc REIT	95.363	587.644	0,10 %	Capita plc	49.230	222.337	0,04 %
Halma plc	40.449	574.150	0,10 %	Howden Joinery Group plc	41.780	219.708	0,04 %
IMI plc	37.372	561.207	0,10 %	Hikma Pharmaceuticals plc	16.005	204.463	0,03 %
Royal Mail plc	106.760	544.219	0,09 %	Ashmore Group plc	44.560	203.355	0,03 %
Smiths Group plc	32.181	540.173	0,09 %	Aggreko plc	22.390	201.534	0,03 %
ITV plc	287.527	536.072	0,09 %	Inmarsat plc	36.328	200.860	0,03 %
United Utilities Group plc	57.184	534.365	0,09 %	William Hill plc	52.707	191.193	0,03 %
Direct Line Insurance Group plc	124.163	533.902	0,09 %	Daily Mail & General Trust plc	24.267	163.070	0,03 %
Cobham plc	360.456	512.864	0,09 %	NMC Health plc	4.167	135.430	0,02 %
Admiral Group plc	21.946	494.956	0,08 %	Dixons Carphone plc	42.680	95.681	0,02 %
Melrose Industries plc	202.969	485.201	0,08 %	Smurfit Kappa Group plc	518	14.629	0,00 %
Berkeley Group Holdings plc	10.035	474.464	0,08 %	Rolls-Royce Holdings plc Entil	18.703.600	211	0,00 %
Next plc	9.268	472.445	0,08 %			166.378.222	28,24 %
Tate & Lyle plc	54.916	434.912	0,07 %	Summe Aktien		585.714.730	99,43 %
J Sainsbury plc	158.679	431.523	0,07 %	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		585.714.730	99,43 %
Hargreaves Lansdown plc	21.197	430.305	0,07 %				
Inchcape plc	47.016	414.454	0,07 %				

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures (0,00 %) (2016: 0,01 %)				
FTSE 100 Index März 2018	15	1.258.208	32.470	0,01 %
Euro Stoxx 50 März 2018	58	2.059.891	(33.951)	(0,01 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente			(1.481)	(0,00 %)

	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva	3.336.138	0,57 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	589.049.387	100,00 %

REIT – Real Estate Investment Trust.

Analyse des Gesamtvermögens	Euro (€)	% des Gesamtnetto- vermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	585.580.204	99,41 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	—	0,00 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	134.526	0,02 %
(d) Derivative Finanzinstrumente	(1.481)	(0,00 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva	3.336.138	0,57 %
Gesamtnettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	589.049.387	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Anteile	Kosten Euro (€)		Anteile	Erlöse Euro (€)
Käufe			Verkäufe		
Royal Dutch Shell plc Klasse B	210.016	5.269.976	Nestle SA	126.482	9.304.931
Rolls-Royce Holdings plc	225.945	2.374.672	Novartis AG	103.153	7.403.036
Dassault Aviation SA	1.681	2.011.224	Roche Holding AG	30.124	6.858.137
British American Tobacco plc	29.450	1.777.092	Royal Dutch Shell plc Klasse A	243.252	5.913.165
BNP Paribas SA	19.734	1.239.982	Royal Dutch Shell plc Klasse B	211.950	5.267.933
Novartis AG	16.969	1.221.422	British American Tobacco plc	82.898	5.057.502
AstraZeneca plc	17.972	1.031.120	Bayer AG	35.891	4.133.873
Lloyds Banking Group plc	1.234.779	975.483	Sanofi	49.609	4.102.348
Nestle SA	12.341	943.921	Siemens AG	33.223	4.038.759
Sanofi	10.961	936.857	Banco Santander SA	648.980	3.632.750
Melrose Industries plc	279.895	739.006	BASF SE	39.100	3.398.083
Enagas SA	27.616	720.225	SAP SE	35.386	3.257.223
Sky plc	58.367	645.611	Allianz SE	18.853	3.190.960
Heineken Holding NV	7.576	606.233	BNP Paribas SA	52.034	3.179.830
Unilever NV	11.772	584.855	Anheuser-Busch InBev SA	31.682	3.174.027
ConvaTec Group plc	148.949	553.249	Vodafone Group plc	1.296.429	3.150.470
Heineken NV	6.471	552.358	Diageo plc	113.550	3.015.318
Innogy SE	15.398	529.837	AstraZeneca plc	49.944	2.913.708
UniCredit SpA	33.205	528.681	Unilever NV	62.792	2.889.950
Reckitt Benckiser Group plc	5.689	515.176	Reckitt Benckiser Group plc	33.285	2.848.308

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	Euro (€) Zum 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	585.714.730	793.825.829
Derivative Finanzinstrumente	32.470	77.523
Barmittel	1.063.354	3.082.648
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	1.793.551	2.074.248
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	586.421	177.814
Bareinschüsse für Futures	174.012	270.138
Summe Umlaufvermögen	589.364.538	799.508.200
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	33.951	—
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	184	510
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	3	224
Zahlbare Dividenden	14.916	11.278
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	117.601	372.690
Zahlbare Verwaltungsgebühren	148.496	196.550
Summe kurzfristige Passiva	315.151	581.252
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	589.049.387	798.926.948

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Nettovermögen	530.966.189	748.985.963	798.367.090
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.795.073	4.352.801	4.723.853
Nettoinventarwert je Anteil	189,97	172,07	169,01
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Gegenwert in Euro (€)	357.115	53.050	4.875
Nettovermögen	428.824	55.954	5.296
Anzahl der umlaufenden Anteile	3.837	629	59
Nettoinventarwert je Anteil	111,76	88,96	89,94
EUR-Anlegeranteile (€)			
Nettovermögen	9.885.735	7.388.608	8.682.528
Anzahl der umlaufenden Anteile	52.121	42.985	51.402
Nettoinventarwert je Anteil	189,67	171,89	168,91
Thesaurierende GBP-Anteile (£)			
Gegenwert in Euro (€)	19.640.610	11.760.924	10.091.301
Nettovermögen	17.434.445	10.039.117	7.437.534
Anzahl der umlaufenden Anteile	91.459	60.462	52.818
Nettoinventarwert je Anteil	190,63	166,04	140,81
Ausschüttende GBP-Anteile (£)			
Gegenwert in Euro (€)	5.804.382	3.778.416	3.259.537
Nettovermögen	5.152.395	3.225.254	2.402.358
Anzahl der umlaufenden Anteile	32.326	22.580	19.230
Nettoinventarwert je Anteil	159,39	142,84	124,93
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Nettovermögen	22.371.647	26.438.380	37.128.981
Anzahl der umlaufenden Anteile	164.506	214.844	307.491
Nettoinventarwert je Anteil	135,99	123,06	120,75
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile (£)			
Gegenwert in Euro (€)	16.030	14.506	14.233
Nettovermögen	14.229	12.382	10.490
Anzahl der umlaufenden Anteile	104	104	104
Nettoinventarwert je Anteil	136,82	119,06	100,87
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)			
Gegenwert in Euro (€)	7.679	507.101	539.992
Nettovermögen	6.816	432.861	397.987
Anzahl der umlaufenden Anteile	55	3.867	4.066
Nettoinventarwert je Anteil	123,93	111,94	97,89

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	Euro (€) Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	Euro (€) Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	726	69.487
Dividenden	23.996.321	29.499.037
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	192.358	490.955
Verschiedene Erträge	180	2.840
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	51.911.089	(14.510.933)
Summe Anlageerträge/(-verluste)	76.100.674	15.551.386
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	1.980.408	2.414.847
Transaktionsgebühren und Provisionen	207.405	119.947
Sonstige Aufwendungen	3.974	1.507
Summe Aufwendungen	2.191.787	2.536.301
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	26.008	11.355
Ausgezahlte Ausschüttungen	157.609	120.980
Ertragsausgleich	(13.090)	(2.294)
Summe Finanzierungskosten	170.527	130.041
Nettoanlageerträge/(-verluste)	73.738.360	12.885.044
Ausländische Quellensteuer	(1.951.700)	(2.421.747)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	71.786.660	10.463.297

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	71.786.660	10.463.297
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	171.457.954	67.058.564
Rücknahmen	(453.122.393)	(136.683.594)
Reinvestitionen	218	144
Summe Kapitalgeschäfte ¹	(281.664.221)	(69.624.886)
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	(209.877.561)	(59.161.589)
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	798.926.948	858.088.537
Zum Jahresende	589.049.387	798.926.948

1 Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

SRI Global Stock Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Asset Management, Limited.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Anlageziel

Der Fonds strebt ein langfristiges Kapitalwachstum durch die Nachbildung der Performance des FTSE Developed Index an, eines nach Marktkapitalisierung gewichteten Index aus Stammaktien von grossen und mittleren Unternehmen in Industrieländern.

Portfoliomerkmale

	Fonds	FTSE Developed Index
Anzahl der Aktien	1.689	2.127
Mittlere Marktkapitalisierung		
US-Dollar	\$ 53,1 Mrd.	\$ 57,7 Mrd.
Euro	€ 44,2 Mrd.	€ 48,1 Mrd.
Britisches Pfund	£ 39,2 Mrd.	£ 42,7 Mrd.
Kurs/Gewinn-Verhältnis	19,5x	19,6x
Kurs/Buch-Verhältnis	2,3x	2,3x
Rendite	2,2 %	2,2 %
Eigenkapitalrendite	13,5 %	13,6 %
Ertragszuwachsrate	8,4 %	7,9 %
Portfolioumschlag ¹	-35 %	—
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,35 %	
Anlegeranteile	0,40 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,25 %	
Thesaurierende Anteile	0,35 %	
Ausschüttende Anteile	0,35 %	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,25 %	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,25 %	
Kurzfristige Reserven	0,0 %	—

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	FTSE Developed Index
Europa		
Vereinigtes Königreich	6,7 %	6,8 %
Deutschland	3,7	3,6
Frankreich	3,6	3,7
Schweiz	3,0	3,0
Niederlande	1,3	1,2
Spanien	1,2	1,2
Italien	1,0	0,9
Schweden	1,0	1,0
Sonstige	2,0	1,9
Zwischensumme	22,5 %	22,4 %
Pazifik		
Japan	9,5 %	9,5 %
Australien	2,6	2,7
Südkorea	2,0	2,0
Hongkong	1,5	1,5
Sonstige	0,6	0,6
Zwischensumme	16,2 %	16,3 %
Nordamerika		
USA	56,8 %	57,0 %
Kanada	3,3	3,2
Zwischensumme	60,1 %	60,2 %
Naher Osten	0,2 %	0,2 %

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	FTSE Developed Index
R ²	1,00	1,00
Beta	0,99	1,00

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds	FTSE Developed Index
Grundstoffe	4,5 %	4,5 %
Konsumgüter	13,4	13,4
Verbraucherdienstleistungen	10,5	10,6
Finanzwerte	22,2	22,0
Gesundheitswesen	10,9	11,1
Industriegüter	13,4	13,4
Öl und Gas	5,9	6,0
Technologie	13,3	13,3
Telekommunikation	2,8	2,7
Versorger	3,1	3,0

Die 10 grössten Positionen² (% des Gesamtvermögens)

Apple Inc.	Computer-Hardware	2,1 %
Alphabet Inc.	Internet	1,6
Microsoft Corp.	Software	1,6
Amazon.com Inc.	Einzelhandel	1,1
Exxon Mobil Corp.	Integrierter Öl- und Gaskonzern	1,0
Facebook Inc.	Internet	1,0
Berkshire Hathaway Inc.	Rückversicherung	1,0
JPMorgan Chase & Co.	Banken	1,0
Royal Dutch Shell plc	Integrierter Öl- und Gaskonzern	0,8
Bank of America Corp.	Banken	0,7
Zehn grösste Positionen		11,9 %

Allokation nach Region (% des Portfolios)



Anlagefokus

Stil	Wert	Mischung	Wachstum
Marktkapitalisierung	Gross		
	Mittel		
	Klein		

¹ Ein negativer Portfolioumschlag deutet darauf hin, dass der Gesamtwert der Zeichnungen und Rückkäufe über dem Wert der Wertpapiertransaktionen gelegen hat.

² Die aufgeführten Positionen schliessen etwaige vorübergehende Baranlagen und Aktienindexprodukte aus.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

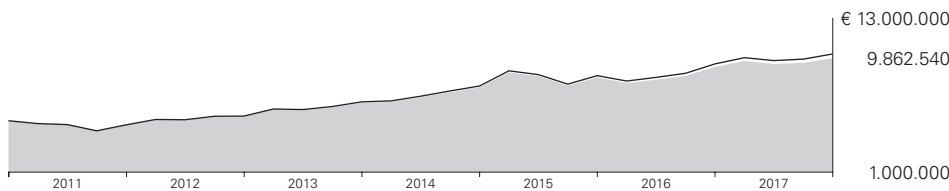
Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

SRI Global Stock Fund
Benchmark: FTSE Developed Index

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 7. Februar 2011–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



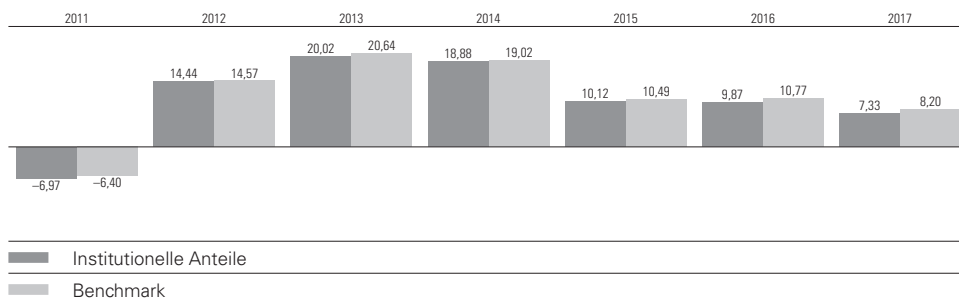
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
— Institutionelle Anteile	7,33 %	13,13 %	10,35 %	€ 9.862.540
— Benchmark	8,20	13,72	10,88	10.194.834

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Anlegeranteile	7,28 %	11,59 %	€ 152.365
Benchmark	8,20	12,21	155.651

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile	7,44 %	12,02 %	€ 317.377.599
Benchmark	8,20	12,47	322.614.725

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,87 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,92 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,76 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 7. Februar 2011–31. Dezember 2017



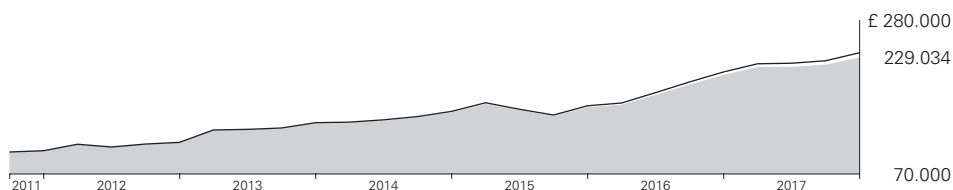
¹ Für institutionelle Anteile, 7. Februar 2011; für Anlegeranteile, 27. Februar 2014; für institutionelle Plus-Anteile, 6. Dezember 2013.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

SRI Global Stock Fund
Benchmark: FTSE Developed Index

In GBP

Kumulative Wertentwicklung: 25. Oktober 2011–31. Dezember 2017
Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile	11,62 %	15,20 %	14,34 %	£ 229.034
Benchmark	12,52	15,79	14,85	235.462

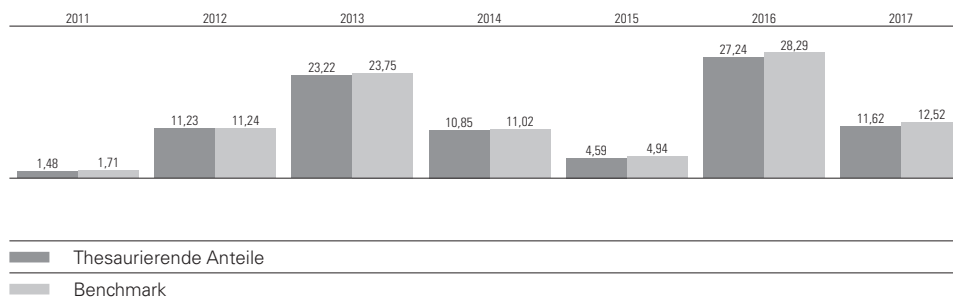
	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Ausschüttende Anteile	11,62 %	15,20 %	14,34 %	£ 228.983
Benchmark	12,52	15,79	14,85	235.462

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	11,73 %	13,99 %	13,99 %	£ 309.242.400
Benchmark	12,52	14,57	14,57	314.512.376

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	11,73 %	13,99 %	13,99 %	£ 309.260.955
Benchmark	12,52	14,57	14,57	314.512.376

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,90 Prozentpunkte für Thesaurierungsanteile, 0,90 Prozentpunkte für Ertragsanteile, 0,79 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile und 0,79 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Ertragsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 25. Oktober 2011–31. Dezember 2017



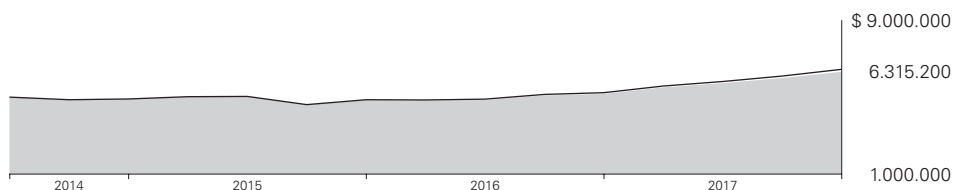
1 Für Thesaurierungs- und Ertragsanteile, 25. Oktober 2011; für institutionelle Plus-Thesaurierungs- und institutionelle Plus-Ertragsanteile, 2. September 2014.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

SRI Global Stock Fund
 Benchmark: FTSE Developed Index

In US-Dollar

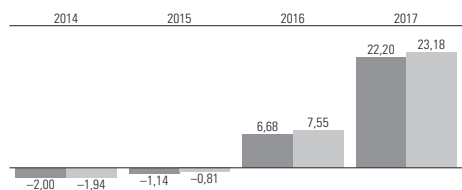
Kumulative Wertentwicklung: 2. September 2014–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von \$ 5,000,000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
■ Institutionelle Anteile	22,20 %	7,27 %	\$ 6.315.200
— Benchmark	23,18	7,92	6.443.579

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,98 Prozentpunkte für institutionelle Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 2. September 2014–31. Dezember 2017



■ Institutionelle Anteile
■ Benchmark

1 2. September 2014.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Aktien 99,66 % (2016: 98,53 %)							
Australien 2,63 % (2016: 2,71 %)							
Commonwealth Bank of Australia	30.395	1.909.959	0,29 %	Crown Resorts Ltd.	5.364	54.625	0,01 %
Westpac Banking Corp.	59.715	1.464.236	0,22 %	Orica Ltd.	3.772	53.400	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	52.419	1.178.326	0,18 %	Challenger Ltd.	4.785	52.509	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	48.658	1.125.371	0,17 %	ASX Ltd.	1.163	49.903	0,01 %
CSL Ltd.	7.542	833.525	0,13 %	Star Entertainment Group Ltd.	10.011	47.607	0,01 %
Wesfarmers Ltd.	22.986	798.605	0,12 %	Qantas Airways Ltd.	10.840	42.732	0,01 %
Woolworths Group Ltd.	29.507	630.054	0,10 %	Downer EDI Ltd.	7.612	41.259	0,01 %
Woodside Petroleum Ltd.	19.571	506.371	0,08 %	ALS Ltd.	6.332	34.619	0,01 %
Macquarie Group Ltd.	5.250	409.109	0,06 %	Adelaide Brighton Ltd.	6.332	32.291	0,01 %
Transurban Group	34.208	332.574	0,05 %	Computershare Ltd.	2.490	31.745	0,01 %
South32 Ltd.	119.346	325.779	0,05 %	Transurban Group Klasse NEW	3.241	31.509	0,01 %
Newcrest Mining Ltd.	17.499	312.334	0,05 %	Harvey Norman Holdings Ltd.	8.529	27.818	0,00 %
Origin Energy Ltd.	40.629	299.349	0,05 %	Orora Ltd.	8.881	23.548	0,00 %
Scentre Group REIT	89.338	292.779	0,05 %	Bank of Queensland Ltd.	2.333	23.211	0,00 %
Westfield Corp. REIT	32.382	240.359	0,04 %	Domino's Pizza Enterprises Ltd.	549	20.053	0,00 %
Telstra Corp., Ltd.	78.095	221.728	0,03 %	Vocus Group Ltd.	7.435	17.620	0,00 %
Brambles Ltd.	28.116	221.449	0,03 %	TPG Telecom Ltd.	3.181	16.346	0,00 %
Amcor Ltd.	18.306	220.784	0,03 %	Healthscope Ltd.	9.944	16.333	0,00 %
Suncorp Group Ltd.	20.337	220.465	0,03 %	Flight Centre Travel Group Ltd.	265	9.170	0,00 %
Goodman Group REIT	31.993	210.696	0,03 %	CSR Ltd.	2.266	8.436	0,00 %
AMP Ltd.	51.880	210.600	0,03 %	REA Group Ltd.	94	5.635	0,00 %
Insurance Australia Group Ltd.	36.342	205.796	0,03 %	Fairfax Media Ltd.	2.489	1.519	0,00 %
BlueScope Steel Ltd.	17.061	205.101	0,03 %			17.218.389	2,63 %
Oil Search Ltd.	33.376	203.358	0,03 %	Österreich 0,13 % (2016: 0,11 %)			
Aristocrat Leisure Ltd.	10.187	188.836	0,03 %	Voestalpine AG	5.249	314.173	0,05 %
AGL Energy Ltd.	9.790	186.531	0,03 %	OMV AG	3.662	232.311	0,04 %
Alumina Ltd.	92.608	176.013	0,03 %	Erste Group Bank AG	4.883	211.702	0,03 %
QBE Insurance Group Ltd.	19.356	161.688	0,02 %	Raiffeisen Bank International AG	2.406	87.252	0,01 %
Santos Ltd.	37.522	159.946	0,02 %	ANDRITZ AG	182	10.290	0,00 %
Stockland REIT	44.045	154.335	0,02 %			855.728	0,13 %
Caltex Australia Ltd.	5.715	152.203	0,02 %	Belgien 0,41 % (2016: 0,43 %)			
Fortescue Metals Group Ltd.	36.996	141.210	0,02 %	Anheuser-Busch InBev SA	12.450	1.392.290	0,21 %
James Hardie Industries plc	7.906	139.875	0,02 %	KBC Group NV	5.296	452.219	0,07 %
Dexus REIT	17.866	136.245	0,02 %	UCB SA	3.016	239.678	0,04 %
GPT Group REIT	33.592	134.260	0,02 %	Solvay SA	1.196	166.451	0,03 %
APA Group	20.012	130.384	0,02 %	Umicore SA	2.540	120.339	0,02 %
Boral Ltd.	21.317	129.883	0,02 %	Ageas	1.952	95.434	0,01 %
Treasury Wine Estates Ltd.	10.224	127.627	0,02 %	Proximus SADP	2.569	84.371	0,01 %
Iluka Resources Ltd.	15.960	126.953	0,02 %	Colruyt SA	1.452	75.601	0,01 %
Aurizon Holdings Ltd.	30.903	119.887	0,02 %	Groupe Bruxelles Lambert SA	566	61.162	0,01 %
LendLease Group	9.349	119.556	0,02 %			2.687.545	0,41 %
Vicinity Centres REIT	52.613	111.931	0,02 %	Kanada 3,27 % (2016: 3,27 %)			
Mirvac Group REIT	59.295	108.987	0,02 %	Royal Bank of Canada	27.548	2.256.887	0,34 %
Tabcorp Holdings Ltd.	24.458	106.744	0,02 %	Toronto-Dominion Bank	31.803	1.869.421	0,29 %
Cochlear Ltd.	796	106.606	0,02 %	Bank of Nova Scotia	21.743	1.407.712	0,21 %
OZ Minerals Ltd.	14.526	104.071	0,02 %	Suncor Energy, Inc.	32.133	1.183.557	0,18 %
CIMIC Group Ltd.	2.557	102.898	0,02 %	Canadian National Railway Co.	12.706	1.051.101	0,16 %
Sonic Healthcare Ltd.	5.683	101.612	0,02 %	Bank of Montreal	11.644	934.810	0,14 %
Sydney Airport	17.409	95.996	0,01 %	Canadian Natural Resources Ltd.	22.046	790.380	0,12 %
Ramsay Health Care Ltd.	1.684	92.358	0,01 %	TransCanada Corp.	15.792	771.104	0,12 %
Medibank Pvt Ltd.	33.383	85.904	0,01 %	Canadian Imperial Bank of Commerce	7.820	764.805	0,12 %
Sims Metal Management Ltd.	6.666	82.222	0,01 %	Manulife Financial Corp.	31.659	662.516	0,10 %
Incitec Pivot Ltd.	25.042	76.388	0,01 %	Enbridge, Inc.	16.288	637.024	0,10 %
Seek Ltd.	5.118	76.098	0,01 %	Brookfield Asset Management, Inc. Klasse A	13.906	607.316	0,09 %
Bendigo & Adelaide Bank Ltd.	7.636	69.699	0,01 %	Enbridge, Inc. - CAD	11.939	468.432	0,07 %
WorleyParsons Ltd.	6.071	68.140	0,01 %	Canadian Pacific Railway Ltd.	2.335	427.995	0,07 %
Whitehaven Coal Ltd.	17.937	62.571	0,01 %	Alimentation Couche-Tard, Inc. Klasse B	7.474	391.252	0,06 %
Metcash Ltd.	24.643	60.137	0,01 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Franco-Nevada Corp.	4.826	386.943	0,06 %	TDC A/S	8.270	50.857	0,01 %
Sun Life Financial, Inc.	9.197	380.814	0,06 %	Jyske Bank A/S	864	49.217	0,01 %
Magna International, Inc.	6.511	370.201	0,06 %			3.901.941	0,60 %
Pembina Pipeline Corp.	9.991	362.896	0,06 %	Finnland 0,39 % (2016: 0,41 %)			
BCE, Inc.	6.175	297.575	0,05 %	Nokia OYJ	92.482	432.438	0,07 %
Wheaton Precious Metals Corp.	12.235	271.368	0,04 %	Sampo OYJ Klasse A	7.156	393.556	0,06 %
Goldcorp, Inc.	20.683	264.614	0,04 %	Kone OYJ Klasse B	6.875	369.681	0,06 %
Teck Resources Ltd. Klasse B	10.080	264.440	0,04 %	UPM-Kymmene OYJ	9.561	297.469	0,04 %
National Bank of Canada	5.260	263.304	0,04 %	Neste OYJ	3.029	194.046	0,03 %
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	12.638	260.032	0,04 %	Wartsila OYJ Abp	2.905	183.486	0,03 %
Agrium, Inc.	2.229	257.208	0,04 %	Stora Enso OYJ Klasse R	10.882	172.747	0,03 %
Agnico Eagle Mines Ltd.	5.467	253.246	0,04 %	Fortum OYJ	6.057	120.008	0,02 %
Loblaw Cos., Ltd.	4.523	246.266	0,04 %	Nokian Renkaat OYJ	2.135	96.908	0,01 %
Encana Corp.	17.470	233.826	0,04 %	Orion OYJ Klasse B	2.490	92.929	0,01 %
Rogers Communications, Inc. Klasse B	4.480	229.015	0,03 %	Kesko OYJ Klasse B	1.553	84.384	0,01 %
Imperial Oil Ltd.	6.862	214.850	0,03 %	Metso OYJ	1.481	50.631	0,01 %
Cenovus Energy, Inc.	20.070	183.889	0,03 %	Elisa OYJ	1.119	43.966	0,01 %
Dollarama, Inc.	1.422	178.239	0,03 %			2.532.249	0,39 %
Fairfax Financial Holdings Ltd.	310	165.606	0,02 %	Frankreich 3,58 % (2016: 3,24 %)			
Thomson Reuters Corp.	3.660	160.047	0,02 %	Sanofi	20.718	1.787.497	0,27 %
Restaurant Brands International, Inc.	2.536	155.913	0,02 %	BNP Paribas SA	18.923	1.414.490	0,22 %
CGI Group, Inc. Klasse A	2.675	145.818	0,02 %	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	4.396	1.295.397	0,20 %
Inter Pipeline Ltd.	6.751	140.252	0,02 %	Zodiac Aerospace	39.359	1.178.249	0,18 %
Husky Energy, Inc.	9.726	137.784	0,02 %	Dassault Aviation SA	717	1.117.458	0,17 %
Fortis, Inc.	3.242	119.309	0,02 %	AXA SA	34.224	1.016.514	0,16 %
Metro, Inc.	3.630	116.611	0,02 %	Vinci SA	9.538	975.243	0,15 %
Turquoise Hill Resources Ltd.	33.881	116.006	0,02 %	L'Oreal SA (Prime De Fidelite)	4.151	921.887	0,14 %
Saputo, Inc.	3.083	111.170	0,02 %	Danone SA	10.471	879.522	0,13 %
Canadian Tire Corp., Ltd. Klasse A	823	107.658	0,02 %	Air Liquide SA (Prime De Fidelite)	6.942	875.692	0,13 %
Shaw Communications, Inc. Klasse B	4.214	96.492	0,01 %	Schneider Electric SE	9.663	822.212	0,13 %
George Weston Ltd.	1.066	92.872	0,01 %	Orange SA	38.005	660.587	0,10 %
TELUS Corp.	1.979	75.214	0,01 %	Societe Generale SA	12.385	640.236	0,10 %
Tourmaline Oil Corp.	4.056	73.743	0,01 %	Kering	1.317	621.511	0,10 %
BlackBerry Ltd.	6.569	73.609	0,01 %	Pernod Ricard SA	3.473	550.281	0,08 %
Great-West Lifeco, Inc.	2.546	71.323	0,01 %	Vivendi SA	17.988	484.272	0,07 %
Crescent Point Energy Corp.	9.221	70.503	0,01 %	Cie Generale des Etablissements Michelin	3.321	476.748	0,07 %
ARC Resources Ltd.	5.673	66.784	0,01 %	Cie de Saint-Gobain	7.749	427.844	0,07 %
Power Corp. of Canada	2.216	57.250	0,01 %	Essilor International Cie Generale d'Optique SA	3.062	422.654	0,07 %
Constellation Software, Inc.	89	54.128	0,01 %	Legrand SA	5.224	402.662	0,06 %
Power Financial Corp.	1.267	34.927	0,01 %	Renault SA	3.542	356.889	0,06 %
Restaurant Brands International, Inc. - CAD	293	18.069	0,00 %	Valeo SA	4.215	315.172	0,05 %
Restaurant Brands International LP	28	1.732	0,00 %	Credit Agricole SA (Prime De Fidelite)	18.863	312.579	0,05 %
		21.405.858	3,27 %	Capgemini SE	2.421	287.487	0,04 %
China 0,02 % (2016: 0,01 %)				Hermes International	496	265.785	0,04 %
Semiconductor Manufacturing International Corp.	39.200	67.796	0,01 %	Publicis Groupe SA	3.361	228.633	0,04 %
Minth Group Ltd.	8.000	48.252	0,01 %	Bouygues SA	4.383	227.945	0,04 %
		116.048	0,02 %	STMicroelectronics NV	10.076	220.267	0,03 %
Dänemark 0,60 % (2016: 0,53 %)				Carrefour SA	9.788	212.032	0,03 %
Novo Nordisk A/S Klasse B	30.587	1.650.112	0,25 %	Atos SE	1.385	201.818	0,03 %
Danske Bank A/S	12.960	504.989	0,08 %	TechnipFMC plc	6.207	194.341	0,03 %
AP Moller-Maersk A/S Klasse B	173	302.451	0,05 %	Dassault Systemes SE	1.777	189.035	0,03 %
DSV A/S	2.790	219.856	0,03 %	Eiffage SA	1.661	182.180	0,03 %
Vestas Wind Systems A/S	2.843	196.613	0,03 %	Veolia Environnement SA	6.257	159.848	0,02 %
Novozymes A/S Klasse B	3.087	176.495	0,03 %	Peugeot SA	7.305	148.727	0,02 %
Pandora A/S	1.390	151.433	0,02 %	Sodexo SA (Prime De Fidelite)	1.023	137.644	0,02 %
Genmab A/S	667	110.693	0,02 %	Ipsen SA	1.135	135.705	0,02 %
Orsted A/S	1.729	94.448	0,02 %	Natixis SA	16.815	133.183	0,02 %
Carlsberg A/S Klasse B	770	92.518	0,01 %	Accor SA	2.556	131.977	0,02 %
ISS A/S	2.198	85.185	0,01 %	Faurecia	1.556	121.692	0,02 %
Coloplast A/S Klasse B	1.035	82.377	0,01 %	Arkema SA	982	119.746	0,02 %
Chr Hansen Holding A/S	759	71.244	0,01 %	Klepierre SA REIT	2.659	117.069	0,02 %
H Lundbeck A/S	1.249	63.453	0,01 %	TechnipFMC plc - EUR	3.503	108.735	0,02 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens
Gecina SA REIT	572	105.707	0,02 %	Henkel AG & Co. KGaA	1.431	171.834	0,03 %
Edenred	3.453	100.259	0,02 %	RWE AG	8.014	163.595	0,03 %
Casino Guichard Perrachon SA	1.558	94.590	0,01 %	Deutsche Lufthansa AG	4.266	157.367	0,02 %
Air Liquide SA	741	93.473	0,01 %	Wirecard AG	1.249	139.586	0,02 %
Teleperformance	644	92.372	0,01 %	Covestro AG	1.302	134.503	0,02 %
Bureau Veritas SA	3.246	88.831	0,01 %	Brenntag AG	2.122	134.463	0,02 %
Rexel SA	4.891	88.801	0,01 %	GEA Group AG	2.698	129.623	0,02 %
Iliad SA	359	86.110	0,01 %	Uniper SE	4.134	129.067	0,02 %
L'Oreal SA	366	81.284	0,01 %	Beiersdorf AG	987	116.030	0,02 %
Bollore SA	14.617	79.476	0,01 %	Symrise AG	1.300	111.802	0,02 %
Aeroports de Paris	409	77.844	0,01 %	OSRAM Licht AG	1.235	111.120	0,02 %
Ingenico Group SA	683	73.001	0,01 %	United Internet AG	1.351	93.022	0,01 %
SES SA Klasse A	4.654	72.707	0,01 %	LEG Immobilien AG	756	86.505	0,01 %
Electricite de France SA (Prime De Fidelite)	5.742	71.846	0,01 %	LANXESS AG	1.082	86.128	0,01 %
Eurofins Scientific SE	112	68.267	0,01 %	QIAGEN NV	2.556	80.384	0,01 %
Imerys SA	708	66.772	0,01 %	KION Group AG	907	78.395	0,01 %
SCOR SE	1.581	63.684	0,01 %	ProSiebenSat.1 Media SE	2.261	77.934	0,01 %
CNP Assurances	2.740	63.353	0,01 %	Evonik Industries AG	2.005	75.527	0,01 %
Getlink SE	4.493	57.836	0,01 %	Hochtief AG	389	68.946	0,01 %
Ubisoft Entertainment SA	743	57.225	0,01 %	Zalando SE	1.095	58.006	0,01 %
Amundi SA	662	56.162	0,01 %	Hannover Rueck SE	403	50.763	0,01 %
Credit Agricole SA	3.379	55.994	0,01 %	HUGO BOSS AG	565	48.129	0,01 %
SEB SA	294	54.526	0,01 %	METRO AG	2.323	46.444	0,01 %
Eutelsat Communications SA	1.864	43.188	0,01 %	K+S AG	1.808	45.060	0,01 %
Sodexo SA	283	38.078	0,01 %	Ceconomy AG	1.728	26.155	0,00 %
Suez	2.024	35.642	0,01 %	Telefonica Deutschland Holding AG	2.746	13.803	0,00 %
JCDecaux SA	641	25.866	0,00 %				
BioMerieux	246	22.063	0,00 %			23.975.781	3,66 %
Electricite de France SA	1.722	21.546	0,00 %				
ICADE REIT	188	18.496	0,00 %				
Societe BIC SA	137	15.079	0,00 %				
SEB SA (XPAR)	10	1.855	0,00 %				
		23.451.378	3,58 %				
Deutschland 3,66 % (2016: 3,45 %)							
Bayer AG	14.951	1.867.129	0,29 %	Hongkong 1,49 % (2016: 1,30 %)			
Siemens AG	13.259	1.849.271	0,28 %	AIA Group Ltd.	197.400	1.683.025	0,26 %
Allianz SE	7.784	1.789.956	0,27 %	CK Hutchison Holdings Ltd.	56.040	703.251	0,11 %
BASF SE	16.149	1.778.996	0,27 %	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	20.100	616.579	0,09 %
SAP SE	15.310	1.718.008	0,26 %	CK Asset Holdings Ltd.	54.040	472.149	0,07 %
Daimler AG	17.098	1.453.615	0,22 %	Link REIT	41.500	384.618	0,06 %
MTU Aero Engines AG	6.417	1.151.207	0,18 %	BOC Hong Kong Holdings Ltd.	75.000	379.927	0,06 %
Deutsche Telekom AG	54.871	974.829	0,15 %	Hang Seng Bank Ltd.	15.200	377.215	0,06 %
Deutsche Post AG	15.901	758.983	0,12 %	Hong Kong & China Gas Co., Ltd.	177.817	348.478	0,05 %
Linde AG	3.161	738.839	0,11 %	Galaxy Entertainment Group Ltd.	37.000	296.765	0,05 %
Bayerische Motoren Werke AG	6.950	724.645	0,11 %	Jardine Matheson Holdings Ltd.	4.200	255.150	0,04 %
Adidas AG	3.087	619.603	0,09 %	CLP Holdings Ltd.	24.000	245.456	0,04 %
Deutsche Bank AG	30.501	581.431	0,09 %	AAC Technologies Holdings, Inc.	12.000	213.987	0,03 %
Continental AG	2.065	558.046	0,09 %	Sands China Ltd.	37.600	194.077	0,03 %
Fresenius SE & Co. KGaA	6.264	489.444	0,07 %	Power Assets Holdings Ltd.	23.000	194.038	0,03 %
Infineon Technologies AG	16.989	465.843	0,07 %	MTR Corp., Ltd.	32.500	190.411	0,03 %
Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen	2.116	459.266	0,07 %	Hongkong Land Holdings Ltd.	25.600	180.224	0,03 %
Vonovia SE	9.138	454.169	0,07 %	Henderson Land Development Co., Ltd.	27.186	179.100	0,03 %
E.ON SE	35.077	381.654	0,06 %	New World Development Co., Ltd.	112.741	169.314	0,03 %
Merck KGaA	3.369	363.083	0,06 %	Wharf Real Estate Investment Co., Ltd.	24.700	164.302	0,03 %
Deutsche Börse AG	3.104	360.801	0,06 %	Jardine Strategic Holdings Ltd.	4.100	162.278	0,03 %
Henkel AG & Co. KGaA - Vorzugsaktien	2.614	346.377	0,05 %	Swire Pacific Ltd. Klasse A	16.500	152.709	0,02 %
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA	3.041	320.540	0,05 %	China Mengniu Dairy Co., Ltd.	47.000	139.786	0,02 %
thyssenkrupp AG	9.815	285.394	0,04 %	Sino Land Co., Ltd.	76.200	134.907	0,02 %
Commerzbank AG	18.427	276.700	0,04 %	WH Group Ltd.	117.201	132.234	0,02 %
HeidelbergCement AG	2.469	267.571	0,04 %	Wheellock & Co., Ltd.	18.000	128.484	0,02 %
Deutsche Wohnen SE	6.002	262.775	0,04 %	Techtronic Industries Co., Ltd.	19.500	127.093	0,02 %
Porsche Automobil Holding SE - Vorzugsaktien	2.905	243.415	0,04 %	Hang Lung Properties Ltd.	50.000	122.165	0,02 %
				Swire Properties Ltd.	34.300	110.570	0,02 %
				Bank of East Asia Ltd.	22.200	96.129	0,01 %
				CK Infrastructure Holdings Ltd.	10.000	85.899	0,01 %
				Wharf Holdings Ltd.	24.700	85.311	0,01 %
				Want Want China Holdings Ltd.	95.000	79.599	0,01 %
				Hysan Development Co., Ltd.	15.000	79.535	0,01 %
				Hopewell Holdings Ltd.	21.000	77.233	0,01 %
				Samsonite International SA	15.300	70.263	0,01 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Wynn Macau Ltd.	21.200	67.120	0,01 %	Italgas SpA	5.158	31.526	0,01 %
ASM Pacific Technology Ltd.	4.600	64.081	0,01 %	Davide Campari-Milano SpA	2.807	21.724	0,00 %
Hang Lung Group Ltd.	17.000	62.522	0,01 %			6.467.624	0,99 %
Sun Art Retail Group Ltd.	56.500	59.700	0,01 %				
NWS Holdings Ltd.	32.000	57.718	0,01 %	Japan 9,49 % (2016: 9,23 %)			
Kerry Properties Ltd.	8.000	35.971	0,01 %	Toyota Motor Corp.	44.512	2.850.111	0,44 %
Yue Yuen Industrial Holdings Ltd.	9.000	35.345	0,01 %	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	222.000	1.628.591	0,25 %
Prada SpA	9.000	32.582	0,01 %	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	26.000	1.123.551	0,17 %
Li & Fung Ltd.	58.000	31.829	0,01 %	Honda Motor Co., Ltd.	32.500	1.114.203	0,17 %
Shangri-La Asia Ltd.	14.000	31.771	0,01 %	SoftBank Group Corp.	13.700	1.084.811	0,17 %
Shougang Fushan Resources Group Ltd.	140.000	30.087	0,00 %	Sony Corp.	20.660	932.222	0,14 %
Orient Overseas International Ltd.	3.000	28.936	0,00 %	Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	16.400	931.881	0,14 %
Xinyi Glass Holdings Ltd.	22.000	28.649	0,00 %	Mizuho Financial Group, Inc.	509.420	925.232	0,14 %
Brightoil Petroleum Holdings Ltd.	126.000	24.177	0,00 %	Keyence Corp.	1.560	874.099	0,13 %
Melco International Development Ltd.	8.000	23.537	0,00 %	FANUC Corp.	3.400	816.724	0,13 %
Tingyi Cayman Islands Holding Corp.	12.000	23.333	0,00 %	KDDI Corp.	29.100	724.465	0,11 %
Kingston Financial Group Ltd.	24.000	23.026	0,00 %	Mitsubishi Corp.	25.700	710.201	0,11 %
Great Eagle Holdings Ltd.	4.000	20.953	0,00 %	Shin-Etsu Chemical Co., Ltd.	6.700	681.003	0,10 %
VTech Holdings Ltd.	1.400	18.339	0,00 %	Seven & i Holdings Co., Ltd.	16.000	665.140	0,10 %
Shui On Land Ltd.	60.833	16.809	0,00 %	East Japan Railway Co.	6.800	663.702	0,10 %
Shun Tak Holdings Ltd.	30.000	11.705	0,00 %	Canon, Inc.	17.700	659.920	0,10 %
		9.760.451	1,49 %	Hitachi Ltd.	84.000	654.626	0,10 %
				ITOCHU Corp.	33.700	629.127	0,10 %
Irland 0,10 % (2016: 0,08 %)				Nintendo Co., Ltd.	1.700	621.598	0,10 %
Kerry Group plc Klasse A	2.285	256.548	0,04 %	Komatsu Ltd.	16.500	597.310	0,09 %
Paddy Power Betfair plc	1.233	147.196	0,02 %	Central Japan Railway Co.	3.300	591.158	0,09 %
Bank of Ireland Group plc	15.265	130.053	0,02 %	Mitsubishi Electric Corp.	35.100	583.131	0,09 %
Smurfit Kappa Group plc	3.209	108.626	0,02 %	Nidec Corp.	4.100	575.419	0,09 %
Kingspan Group plc	523	22.863	0,00 %	Japan Tobacco, Inc.	17.600	567.293	0,09 %
Glanbia plc	34	608	0,00 %	Nippon Telegraph & Telephone Corp.	12.000	564.687	0,09 %
		665.894	0,10 %	Daikin Industries Ltd.	4.700	556.365	0,09 %
				NTT DOCOMO, Inc.	23.300	550.389	0,08 %
Israel 0,18 % (2016: 0,24 %)				Astellas Pharma, Inc.	43.000	548.522	0,08 %
Elbit Systems Ltd.	4.676	626.313	0,10 %	Tokio Marine Holdings, Inc.	12.000	547.643	0,08 %
Teva Pharmaceutical Industries Ltd.	15.029	284.203	0,04 %	Denso Corp.	8.900	534.316	0,08 %
Bank Leumi Le-Israel BM	18.279	110.412	0,02 %	Daiwa House Industry Co., Ltd.	13.800	530.072	0,08 %
Bank Hapoalim BM	12.449	91.763	0,02 %	Panasonic Corp.	35.830	524.648	0,08 %
Nice Ltd.	271	24.550	0,00 %	Kao Corp.	7.700	520.784	0,08 %
Paz Oil Co., Ltd.	136	23.583	0,00 %	Recruit Holdings Co., Ltd.	19.900	494.629	0,08 %
Oil Refineries Ltd.	47.082	22.581	0,00 %	Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp.	19.258	494.229	0,08 %
		1.183.405	0,18 %	Otsuka Holdings Co., Ltd.	10.400	456.806	0,07 %
				Tokyo Electron Ltd.	2.500	452.730	0,07 %
Italien 0,99 % (2016: 0,80 %)				JXTG Holdings, Inc.	67.200	433.683	0,07 %
Eni SpA	62.413	1.034.248	0,16 %	Sumitomo Corp.	25.100	426.689	0,07 %
Enel SpA	138.274	851.782	0,13 %	Suzuki Motor Corp.	7.200	417.619	0,06 %
Intesa Sanpaolo SpA	239.053	795.142	0,12 %	SMC Corp.	1.000	411.718	0,06 %
UniCredit SpA	36.147	676.255	0,10 %	Kubota Corp.	20.900	409.929	0,06 %
Assicurazioni Generali SpA	20.174	368.219	0,06 %	Daiichi Sankyo Co., Ltd.	15.500	404.115	0,06 %
Fiat Chrysler Automobiles NV	18.489	331.026	0,05 %	Murata Manufacturing Co., Ltd.	3.000	402.663	0,06 %
Snam SpA	59.227	290.169	0,04 %	Nissan Motor Co., Ltd.	39.400	392.951	0,06 %
Atlantia SpA	8.931	282.265	0,04 %	Mitsui Fudosan Co., Ltd.	17.500	392.255	0,06 %
CNH Industrial NV	19.409	260.332	0,04 %	Shionogi & Co., Ltd.	7.200	389.688	0,06 %
Ferrari NV	2.324	244.043	0,04 %	ORIX Corp.	22.700	383.774	0,06 %
Recordati SpA	4.988	221.974	0,03 %	Mitsubishi Estate Co., Ltd.	21.600	375.819	0,06 %
Tenaris SA	10.967	173.306	0,03 %	Dai-ichi Life Holdings, Inc.	18.100	373.408	0,06 %
Luxottica Group SpA	2.477	152.139	0,02 %	Kyocera Corp.	5.700	373.068	0,06 %
Telecom Italia SpA	169.787	146.896	0,02 %	Kirin Holdings Co., Ltd.	14.100	355.535	0,05 %
Mediobanca SpA	9.556	108.552	0,02 %	Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc.	8.243	327.305	0,05 %
Exor NV	1.655	101.552	0,02 %	JFE Holdings, Inc.	13.500	324.288	0,05 %
Telecom Italia SpA (Non CVA)	104.888	75.066	0,01 %	Fast Retailing Co., Ltd.	800	318.935	0,05 %
Prismian SpA	2.163	70.621	0,01 %	Subaru Corp.	10.000	318.065	0,05 %
Saipem SpA	14.397	65.798	0,01 %	Nomura Holdings, Inc.	53.000	312.919	0,05 %
Banco BPM SpA	18.636	58.631	0,01 %	Impex Corp.	24.800	310.193	0,05 %
Unione di Banche Italiane SpA	13.226	57.905	0,01 %				
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	8.330	48.453	0,01 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Oriental Land Co., Ltd.	3.400	309.969	0,05 %	Idemitsu Kosan Co., Ltd.	3.500	140.590	0,02 %
Eisai Co., Ltd.	5.400	307.558	0,05 %	Kansai Electric Power Co., Inc.	11.400	139.654	0,02 %
Hoya Corp.	6.100	304.756	0,05 %	Hitachi Metals Ltd.	9.700	139.322	0,02 %
Sumitomo Metal Mining Co., Ltd.	6.600	303.372	0,05 %	Daiwa Securities Group, Inc.	22.000	138.054	0,02 %
Shiseido Co., Ltd.	6.200	299.735	0,05 %	Dai Nippon Printing Co., Ltd.	6.000	133.848	0,02 %
Asahi Group Holdings Ltd.	6.000	297.736	0,05 %	Rohm Co., Ltd.	1.200	132.943	0,02 %
Resona Holdings, Inc.	48.300	288.599	0,04 %	Yamato Kogyo Co., Ltd.	4.500	130.826	0,02 %
Aeon Co., Ltd.	16.900	285.417	0,04 %	Sekisui Chemical Co., Ltd.	6.500	130.519	0,02 %
Asahi Kasei Corp.	21.900	282.571	0,04 %	Asahi Glass Co., Ltd.	3.000	129.960	0,02 %
MS&AD Insurance Group Holdings, Inc.	8.300	281.014	0,04 %	Japan Exchange Group, Inc.	7.400	128.818	0,02 %
Secom Co., Ltd.	3.700	279.413	0,04 %	MINEBEA MITSUMI, Inc.	5.900	123.761	0,02 %
Chugai Pharmaceutical Co., Ltd.	5.400	276.591	0,04 %	LIXIL Group Corp.	4.500	121.838	0,02 %
Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	24.500	268.924	0,04 %	Shimizu Corp.	11.500	118.828	0,02 %
Japan Post Holdings Co., Ltd.	23.417	268.573	0,04 %	Stanley Electric Co., Ltd.	2.900	117.776	0,02 %
Daito Trust Construction Co., Ltd.	1.300	265.135	0,04 %	Chiba Bank Ltd.	14.000	116.573	0,02 %
Sumitomo Realty & Development Co., Ltd.	8.000	262.974	0,04 %	Mazda Motor Corp.	8.600	115.392	0,02 %
FUJIFILM Holdings Corp.	6.100	249.361	0,04 %	NTT Data Corp.	9.700	115.298	0,02 %
Sumitomo Electric Industries Ltd.	14.500	245.206	0,04 %	Dowa Holdings Co., Ltd.	2.800	114.336	0,02 %
Marubeni Corp.	33.700	244.142	0,04 %	Shizuoka Bank Ltd.	11.000	113.662	0,02 %
Ono Pharmaceutical Co., Ltd.	10.100	235.443	0,04 %	Tokyu Corp.	7.100	113.323	0,02 %
Toray Industries, Inc.	24.700	232.967	0,04 %	TOTO Ltd.	1.900	112.162	0,02 %
West Japan Railway Co.	3.100	226.398	0,04 %	Nikon Corp.	5.500	110.830	0,02 %
Toyota Industries Corp.	3.500	224.945	0,03 %	Sumitomo Dainippon Pharma Co., Ltd.	7.400	109.965	0,02 %
Nitto Denko Corp.	2.500	222.148	0,03 %	Tosoh Corp.	4.800	108.826	0,02 %
Fujitsu Ltd.	30.400	216.619	0,03 %	NSK Ltd.	6.900	108.660	0,02 %
Sompo Holdings, Inc.	5.350	207.256	0,03 %	Kuraray Co., Ltd.	5.700	107.574	0,02 %
Toyota Tsusho Corp.	5.000	201.287	0,03 %	Yamato Holdings Co., Ltd.	5.300	106.682	0,02 %
Mitsubishi Tanabe Pharma Corp.	9.700	200.803	0,03 %	Bandai Namco Holdings, Inc.	3.200	104.678	0,02 %
Terumo Corp.	4.200	199.095	0,03 %	Yahoo Japan Corp.	22.800	104.639	0,02 %
Omron Corp.	3.300	196.858	0,03 %	Sumitomo Heavy Industries Ltd.	2.400	101.625	0,02 %
Aisin Seiki Co., Ltd.	3.500	196.671	0,03 %	Showa Denko KK	2.300	98.309	0,02 %
Taisei Corp.	3.900	194.221	0,03 %	Seiko Epson Corp.	4.100	96.777	0,02 %
Sumitomo Chemical Co., Ltd.	27.000	194.141	0,03 %	Tsuruha Holdings, Inc.	700	95.198	0,02 %
Makita Corp.	4.600	193.351	0,03 %	Rohto Pharmaceutical Co., Ltd.	3.500	93.520	0,01 %
Japan Post Bank Co., Ltd.	14.700	191.433	0,03 %	Ryohin Keikaku Co., Ltd.	300	93.475	0,01 %
Isuzu Motors Ltd.	11.000	184.261	0,03 %	Oji Holdings Corp.	14.000	93.209	0,01 %
Taisho Pharmaceutical Holdings Co., Ltd.	2.300	183.755	0,03 %	FamilyMart UNY Holdings Co., Ltd.	1.321	92.640	0,01 %
Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	4.800	179.388	0,03 %	Yamaha Corp.	2.500	92.321	0,01 %
Kyowa Hakko Kirin Co., Ltd.	9.000	174.088	0,03 %	Mitsubishi Gas Chemical Co., Inc.	3.200	91.895	0,01 %
Tokyo Gas Co., Ltd.	7.400	169.382	0,03 %	Unicharm Corp.	3.500	91.019	0,01 %
Shimano, Inc.	1.200	168.842	0,03 %	Kissei Pharmaceutical Co., Ltd.	3.200	90.759	0,01 %
Yaskawa Electric Corp.	3.800	167.483	0,03 %	ANA Holdings, Inc.	2.167	90.527	0,01 %
Maruichi Steel Tube Ltd.	5.700	166.977	0,03 %	Tobu Railway Co., Ltd.	2.800	90.475	0,01 %
T & D Holdings, Inc.	9.500	162.508	0,03 %	Rakuten, Inc.	9.800	89.822	0,01 %
Yamaha Motor Co., Ltd.	4.900	160.723	0,03 %	Showa Shell Sekiyu KK	6.600	89.641	0,01 %
Osaka Gas Co., Ltd.	8.200	157.958	0,02 %	Sharp Corp.	2.607	89.561	0,01 %
Hisamitsu Pharmaceutical Co., Inc.	2.600	157.639	0,02 %	Nippon Paint Holdings Co., Ltd.	2.800	88.611	0,01 %
Sysmex Corp.	2.000	157.479	0,02 %	Nabtesco Corp.	2.300	88.202	0,01 %
Sekisui House Ltd.	8.700	157.202	0,02 %	Daifuku Co., Ltd.	1.600	87.208	0,01 %
Nitori Holdings Co., Ltd.	1.100	156.871	0,02 %	Nippon Express Co., Ltd.	1.300	86.436	0,01 %
Dentsu, Inc.	3.684	156.157	0,02 %	Taiheiyo Cement Corp.	2.000	86.374	0,01 %
Kajima Corp.	16.000	153.964	0,02 %	Daido Steel Co., Ltd.	1.400	86.249	0,01 %
MEIJI Holdings Co., Ltd.	1.800	153.236	0,02 %	Kansai Paint Co., Ltd.	3.300	85.774	0,01 %
Mitsubishi Materials Corp.	4.300	153.067	0,02 %	Renesas Electronics Corp.	7.300	85.086	0,01 %
Concordia Financial Group Ltd.	25.000	150.910	0,02 %	Mochida Pharmaceutical Co., Ltd.	1.100	84.270	0,01 %
Hankyu Hanshin Holdings, Inc.	3.700	148.788	0,02 %	Kaken Pharmaceutical Co., Ltd.	1.600	82.663	0,01 %
MISUMI Group, Inc.	5.100	148.495	0,02 %	Mitsui Mining & Smelting Co., Ltd.	1.400	81.900	0,01 %
Obayashi Corp.	12.200	147.721	0,02 %	Ricoh Co., Ltd.	8.800	81.790	0,01 %
Koito Manufacturing Co., Ltd.	2.100	147.643	0,02 %	Toppan Printing Co., Ltd.	9.000	81.411	0,01 %
Ajinomoto Co., Inc.	7.800	146.860	0,02 %	Kikkoman Corp.	2.000	80.959	0,01 %
Santen Pharmaceutical Co., Ltd.	9.300	146.208	0,02 %	Nissan Chemical Industries Ltd.	2.000	79.805	0,01 %
TDK Corp.	1.800	143.648	0,02 %	Odakyu Electric Railway Co., Ltd.	3.700	79.157	0,01 %
Yakult Honsha Co., Ltd.	1.900	143.364	0,02 %	Brother Industries Ltd.	3.200	78.970	0,01 %
Nippon Shinyaku Co., Ltd.	1.900	141.846	0,02 %	Fukuoka Financial Group, Inc.	14.000	78.668	0,01 %
				JGC Corp.	4.000	77.372	0,01 %
				Mitsui Chemicals, Inc.	2.400	77.230	0,01 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Chubu Electric Power Co., Inc.	6.200	77.080	0,01 %	Nisshin Steel Co., Ltd.	2.700	44.389	0,01 %
Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd.	6.200	76.888	0,01 %	Hiroshima Bank Ltd.	5.000	43.542	0,01 %
Japan Airlines Co., Ltd.	1.900	74.347	0,01 %	Sohgo Security Services Co., Ltd.	800	43.533	0,01 %
Don Quijote Holdings Co., Ltd.	1.400	73.200	0,01 %	Miura Co., Ltd.	1.600	43.036	0,01 %
KYORIN Holdings, Inc.	3.900	73.119	0,01 %	Konica Minolta, Inc.	4.400	42.340	0,01 %
Tokyu Fudosan Holdings Corp.	10.098	73.057	0,01 %	M3, Inc.	1.201	42.272	0,01 %
Seibu Holdings, Inc.	3.856	72.944	0,01 %	Takashimaya Co., Ltd.	4.000	42.113	0,01 %
NGK Spark Plug Co., Ltd.	3.000	72.943	0,01 %	Daicel Corp.	3.700	42.107	0,01 %
Mebuki Financial Group, Inc.	17.200	72.831	0,01 %	NOK Corp.	1.800	42.040	0,01 %
Nexon Co., Ltd.	2.500	72.792	0,01 %	Gunma Bank Ltd.	6.800	41.168	0,01 %
Nomura Research Institute Ltd.	1.547	71.960	0,01 %	Kyushu Financial Group, Inc.	6.700	40.563	0,01 %
Nisshin Seifun Group, Inc.	3.548	71.684	0,01 %	Nomura Real Estate Holdings, Inc.	1.800	40.362	0,01 %
Shimadzu Corp.	3.100	70.503	0,01 %	Chugoku Bank Ltd.	3.000	40.133	0,01 %
Tsumura & Co.	2.100	69.814	0,01 %	Lion Corp.	2.100	39.800	0,01 %
Amada Holdings Co., Ltd.	5.000	68.087	0,01 %	Tokyo Tatemono Co., Ltd.	2.900	39.182	0,01 %
Hulic Co., Ltd.	6.000	67.430	0,01 %	Kinden Corp.	2.400	39.158	0,01 %
Keikyu Corp.	3.500	67.266	0,01 %	Aozora Bank Ltd.	998	38.848	0,01 %
IHI Corp.	2.000	66.578	0,01 %	Yamada Denki Co., Ltd.	7.000	38.589	0,01 %
Matsumotokiyoshi Holdings Co., Ltd.	1.600	65.903	0,01 %	Konami Holdings Corp.	700	38.526	0,01 %
Kintetsu Group Holdings Co., Ltd.	1.700	65.193	0,01 %	Nishi-Nippon Financial Holdings, Inc.	3.200	38.349	0,01 %
Yokogawa Electric Corp.	3.400	65.133	0,01 %	Hakuhodo DY Holdings, Inc.	2.900	37.663	0,01 %
Sundrug Co., Ltd.	1.400	65.122	0,01 %	TS Tech Co., Ltd.	900	37.031	0,01 %
Hino Motors Ltd.	4.900	63.506	0,01 %	Kaneka Corp.	4.000	36.538	0,01 %
Bank of Kyoto Ltd.	1.200	62.530	0,01 %	House Foods Group, Inc.	1.100	36.520	0,01 %
Sojitz Corp.	20.300	62.351	0,01 %	Sony Financial Holdings, Inc.	2.000	35.437	0,01 %
Suntory Beverage & Food Ltd.	1.400	62.264	0,01 %	Welcia Holdings Co., Ltd.	800	34.585	0,01 %
Hoshizaki Corp.	700	62.077	0,01 %	Hitachi Chemical Co., Ltd.	1.300	33.397	0,01 %
Kurita Water Industries Ltd.	1.900	61.731	0,01 %	Iyo Bank Ltd.	4.000	32.064	0,01 %
JSR Corp.	3.100	61.037	0,01 %	Japan Petroleum Exploration Co., Ltd.	1.200	31.830	0,01 %
Start Today Co., Ltd.	2.000	60.808	0,01 %	Kose Corp.	200	31.229	0,01 %
THK Co., Ltd.	1.600	60.080	0,01 %	Relo Group, Inc.	1.100	29.978	0,01 %
Suruga Bank Ltd.	2.800	60.076	0,01 %	Electric Power Development Co., Ltd.	1.100	29.636	0,01 %
Lawson, Inc.	900	59.840	0,01 %	Ube Industries Ltd.	1.000	29.427	0,01 %
Yamaguchi Financial Group, Inc.	5.000	59.432	0,01 %	Obic Co., Ltd.	400	29.401	0,01 %
SUMCO Corp.	2.300	58.965	0,01 %	Medipal Holdings Corp.	1.500	29.388	0,00 %
NGK Insulators Ltd.	3.100	58.560	0,01 %	Nichirei Corp.	1.000	27.652	0,00 %
Nissin Foods Holdings Co., Ltd.	800	58.447	0,01 %	Suzuken Co., Ltd.	670	27.567	0,00 %
Sumitomo Rubber Industries Ltd.	3.100	57.680	0,01 %	NHK Spring Co., Ltd.	2.500	27.519	0,00 %
Fuji Electric Co., Ltd.	7.612	57.369	0,01 %	Asics Corp.	1.700	27.103	0,00 %
Alps Electric Co., Ltd.	2.000	57.168	0,01 %	Sugi Holdings Co., Ltd.	500	25.522	0,00 %
JTEKT Corp.	3.300	56.714	0,01 %	Hitachi High-Technologies Corp.	600	25.300	0,00 %
Cosmo Energy Holdings Co., Ltd.	1.500	56.658	0,01 %	77 Bank Ltd.	1.000	25.264	0,00 %
Kobe Steel Ltd.	6.000	55.659	0,01 %	Ulvac, Inc.	400	25.211	0,00 %
Shinsei Bank Ltd.	3.200	55.364	0,01 %	Nagoya Railroad Co., Ltd.	1.000	25.184	0,00 %
J Front Retailing Co., Ltd.	2.900	54.653	0,01 %	Persol Holdings Co., Ltd.	1.000	25.069	0,00 %
Keisei Electric Railway Co., Ltd.	1.700	54.629	0,01 %	Pola Orbis Holdings, Inc.	700	24.576	0,00 %
NEC Corp.	2.000	53.973	0,01 %	Nippon Yusen KK	1.000	24.403	0,00 %
USS Co., Ltd.	2.500	52.952	0,01 %	Kyudenko Corp.	500	24.190	0,00 %
Benesse Holdings, Inc.	1.500	52.929	0,01 %	Denka Co., Ltd.	600	24.048	0,00 %
Keio Corp.	1.200	52.783	0,01 %	Seino Holdings Co., Ltd.	1.500	23.835	0,00 %
Kawasaki Heavy Industries Ltd.	1.500	52.663	0,01 %	CyberAgent, Inc.	600	23.435	0,00 %
Trend Micro, Inc.	900	51.052	0,01 %	Nippo Corp.	1.000	23.409	0,00 %
Hirose Electric Co., Ltd.	340	49.710	0,01 %	Maeda Road Construction Co., Ltd.	1.000	22.947	0,00 %
Ebara Corp.	1.300	49.565	0,01 %	Teijin Ltd.	1.000	22.281	0,00 %
Marui Group Co., Ltd.	2.700	49.446	0,01 %	Disco Corp.	100	22.255	0,00 %
Furukawa Electric Co., Ltd.	1.000	49.356	0,01 %	Kamigumi Co., Ltd.	1.000	22.131	0,00 %
COMSYS Holdings Corp.	1.700	49.272	0,01 %	Hokuhoku Financial Group, Inc.	1.400	21.898	0,00 %
Yokohama Rubber Co., Ltd.	2.000	49.055	0,01 %	Cosmos Pharmaceutical Corp.	100	20.888	0,00 %
Hachijuni Bank Ltd.	8.500	48.819	0,01 %	Toyoda Gosei Co., Ltd.	800	20.360	0,00 %
NH Foods Ltd.	2.000	48.788	0,01 %	Morinaga & Co., Ltd.	400	20.275	0,00 %
Tohoku Electric Power Co., Inc.	3.700	47.330	0,01 %	Haseko Corp.	1.300	20.207	0,00 %
Hitachi Construction Machinery Co., Ltd.	1.300	47.257	0,01 %	San-In Godo Bank Ltd.	2.000	19.316	0,00 %
Otsuka Corp.	600	46.019	0,01 %	Iida Group Holdings Co., Ltd.	1.000	18.864	0,00 %
Nippon Electric Glass Co., Ltd.	1.200	45.806	0,01 %				
DIC Corp.	1.200	45.380	0,01 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Izumi Co., Ltd.	300	18.695	0,00 %
Sawai Pharmaceutical Co., Ltd.	400	17.896	0,00 %
Kyushu Electric Power Co., Inc.	1.700	17.822	0,00 %
Keihan Holdings Co., Ltd.	600	17.683	0,00 %
Nippon Paper Industries Co., Ltd.	900	17.113	0,00 %
Tadano Ltd.	1.000	16.609	0,00 %
Oracle Corp. Japan	200	16.582	0,00 %
Mabuchi Motor Co., Ltd.	300	16.272	0,00 %
Calbee, Inc.	500	16.267	0,00 %
Canon Marketing Japan, Inc.	600	16.218	0,00 %
Casio Computer Co., Ltd.	1.100	15.829	0,00 %
Taiyo Nippon Sanso Corp.	1.100	15.399	0,00 %
Kagome Co., Ltd.	400	14.860	0,00 %
Nippon Kayaku Co., Ltd.	1.000	14.842	0,00 %
Zeon Corp.	1.000	14.478	0,00 %
Sumitomo Osaka Cement Co., Ltd.	3.000	14.461	0,00 %
Nippon Shokubai Co., Ltd.	200	13.511	0,00 %
Mitsui OSK Lines Ltd.	400	13.351	0,00 %
Sega Sammy Holdings, Inc.	1.000	12.410	0,00 %
Toho Gas Co., Ltd.	400	10.972	0,00 %
Toyo Tire & Rubber Co., Ltd.	500	10.333	0,00 %
Ezaki Glico Co., Ltd.	200	9.978	0,00 %
North Pacific Bank Ltd.	2.900	9.731	0,00 %
Japan Steel Works Ltd.	300	9.654	0,00 %
Rinnai Corp.	100	9.055	0,00 %
Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co., Ltd.	1.500	8.935	0,00 %
Toyo Seikan Group Holdings Ltd.	500	8.034	0,00 %
Kewpie Corp.	300	8.003	0,00 %
Glory Ltd.	200	7.554	0,00 %
Ibiden Co., Ltd.	500	7.488	0,00 %
Nifco, Inc.	100	6.826	0,00 %
Ain Holdings, Inc.	100	5.974	0,00 %
Juroku Bank Ltd.	200	5.894	0,00 %
Shiga Bank Ltd.	1.000	5.122	0,00 %
Park24 Co., Ltd.	200	4.788	0,00 %
Toyo Suisan Kaisha Ltd.	100	4.274	0,00 %
Toyota Boshoku Corp.	200	4.188	0,00 %
SBI Holdings, Inc.	170	3.555	0,00 %
Aeon Mall Co., Ltd.	150	2.935	0,00 %
Yamazaki Baking Co., Ltd.	100	1.950	0,00 %
		62.139.398	9,49 %
Niederlande 1,42 % (2016: 1,24 %)			
Unilever NV	25.753	1.452.046	0,22 %
ING Groep NV	72.659	1.337.090	0,21 %
ASML Holding NV	5.249	914.880	0,14 %
NXP Semiconductors NV	5.126	600.203	0,09 %
Koninklijke Philips NV	15.360	581.733	0,09 %
Koninklijke Ahold Delhaize NV	22.101	486.590	0,08 %
ArcelorMittal	13.898	452.515	0,07 %
Heineken NV	3.977	415.141	0,06 %
Unibail-Rodamco SE REIT	1.608	405.486	0,06 %
Akzo Nobel NV	4.200	368.266	0,06 %
RELX NV	15.335	352.910	0,06 %
ABN AMRO Group NV	8.756	282.832	0,04 %
Koninklijke DSM NV	2.776	265.574	0,04 %
NN Group NV	5.080	220.334	0,03 %
Wolters Kluwer NV	3.745	195.529	0,03 %
Aegon NV	28.903	184.466	0,03 %
Koninklijke KPN NV	48.982	171.042	0,03 %
Coca-Cola European Partners plc	3.823	152.347	0,02 %
AerCap Holdings NV	2.041	107.377	0,02 %
Koninklijke Vopak NV	1.772	77.814	0,01 %
Altice NV Klasse A	7.201	75.626	0,01 %
Randstad Holding NV	879	54.084	0,01 %
Boskalis Westminster	1.401	52.875	0,01 %
Altice NV Klasse B	2.237	23.733	0,00 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
OCI NV	860	21.718	0,00 %
Heineken Holding NV	212	21.000	0,00 %
Gemalto NV	219	13.017	0,00 %
		9.286.228	1,42 %
Neuseeland 0,05 % (2016: 0,05 %)			
Fletcher Building Ltd.	13.354	72.180	0,01 %
Spark New Zealand Ltd.	26.073	67.311	0,01 %
Auckland International Airport Ltd.	14.493	66.792	0,01 %
Fisher & Paykel Healthcare Corp., Ltd.	4.527	46.201	0,01 %
Meridian Energy Ltd.	13.607	28.306	0,01 %
Air New Zealand Ltd.	5.796	13.150	0,00 %
		293.940	0,05 %
Norwegen 0,30 % (2016: 0,25 %)			
Statoil A.S.A	30.030	643.236	0,10 %
DNB A.S.A	19.732	366.929	0,06 %
Norsk Hydro A.S.A	36.820	280.674	0,04 %
Telenor A.S.A	11.523	247.806	0,04 %
Yara International A.S.A	2.939	135.356	0,02 %
Orkla A.S.A	11.593	123.380	0,02 %
Marine Harvest A.S.A	4.648	78.988	0,01 %
Aker BP A.S.A	1.924	47.492	0,01 %
Schibsted A.S.A Klasse A	728	20.881	0,00 %
		1.944.742	0,30 %
Portugal 0,06 % (2016: 0,07 %)			
Galp Energia SGPS SA	13.890	255.607	0,04 %
Jeronimo Martins SGPS SA	3.418	66.470	0,01 %
EDP-Energias de Portugal SA	19.022	65.898	0,01 %
Banco Espirito Santo SA	66.429	77	0,00 %
		388.052	0,06 %
Singapur 0,56 % (2016: 0,49 %)			
Singapore Technologies Engineering Ltd.	401.500	979.415	0,15 %
DBS Group Holdings Ltd.	32.500	604.329	0,09 %
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	62.485	579.309	0,09 %
United Overseas Bank Ltd.	23.900	473.028	0,07 %
Singapore Telecommunications Ltd.	119.300	318.693	0,05 %
Keppel Corp., Ltd.	31.300	172.145	0,03 %
Global Logistic Properties Ltd.	44.800	112.972	0,02 %
CapitaLand Ltd.	38.800	102.487	0,01 %
Genting Singapore plc	85.200	83.517	0,01 %
City Developments Ltd.	6.600	61.684	0,01 %
Wilmar International Ltd.	21.900	50.637	0,01 %
Jardine Cycle & Carriage Ltd.	1.444	43.944	0,01 %
Singapore Airlines Ltd.	5.000	39.921	0,01 %
Venture Corp., Ltd.	1.600	24.508	0,00 %
Sembcorp Industries Ltd.	9.700	21.993	0,00 %
Hutchison Port Holdings Trust	47.200	19.588	0,00 %
		3.688.170	0,56 %
Südkorea 1,95 % (2016: 1,63 %)			
Samsung Electronics Co., Ltd.	1.734	4.127.067	0,63 %
SK Hynix, Inc.	8.579	613.043	0,09 %
KB Financial Group, Inc.	7.871	466.136	0,07 %
Hyundai Motor Co.	3.144	458.142	0,07 %
Shinhan Financial Group Co., Ltd.	8.460	390.383	0,06 %
NAVER Corp.	423	343.758	0,05 %
LG Chem Ltd.	874	330.643	0,05 %
Hyundai Mobis Co., Ltd.	1.130	277.605	0,04 %
SK Innovation Co., Ltd.	1.425	272.208	0,04 %
Hana Financial Group, Inc.	5.702	265.246	0,04 %
Celltrion, Inc.	1.238	255.683	0,04 %
Hanwha Techwin Co., Ltd.	6.691	222.190	0,03 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
LG Household & Health Care Ltd.	168	186.588	0,03 %	Shinsegae, Inc.	45	12.610	0,00 %
LG Electronics, Inc.	1.882	186.345	0,03 %	Doosan Heavy Industries & Construction Co., Ltd.	788	11.299	0,00 %
Korea Zinc Co., Ltd.	399	183.744	0,03 %	S-1 Corp.	68	6.797	0,00 %
Hyundai Steel Co.	3.220	176.257	0,03 %	Hyundai Construction Equipment Co., Ltd.	42	6.630	0,00 %
Amorepacific Corp.	592	168.384	0,03 %	Hyundai Marine & Fire Insurance Co., Ltd.	144	6.322	0,00 %
LG Corp.	1.975	167.881	0,03 %	Hanwha Life Insurance Co., Ltd.	465	3.001	0,00 %
Samsung SDI Co., Ltd.	847	161.797	0,03 %	Dongsuh Cos, Inc.	19	516	0,00 %
Woori Bank	10.880	160.067	0,03 %			12.737.894	1,95 %
KT&G Corp.	1.474	159.028	0,02 %	Spanien 1,22 % (2016: 1,18 %)			
Kia Motors Corp.	4.962	155.273	0,02 %	Banco Santander SA	269.863	1.775.478	0,27 %
Samsung C&T Corp.	1.302	153.241	0,02 %	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	108.580	927.283	0,14 %
Samsung Fire & Marine Insurance Co., Ltd.	535	133.431	0,02 %	Iberdrola SA	92.557	717.980	0,11 %
S-Oil Corp.	1.192	130.273	0,02 %	Telefonica SA	68.879	672.018	0,10 %
Samsung Life Insurance Co., Ltd.	1.106	128.623	0,02 %	Industria de Diseno Textil SA	17.890	623.954	0,10 %
Korea Aerospace Industries Ltd.	2.851	126.365	0,02 %	Repsol SA	27.400	485.139	0,08 %
E-MART, Inc.	447	113.154	0,02 %	Amadeus IT Group SA Klasse A	6.715	484.689	0,07 %
Industrial Bank of Korea	7.270	111.710	0,02 %	CaixaBank SA	53.419	249.462	0,04 %
SK Telecom Co., Ltd.	415	103.503	0,02 %	Grifols SA	7.502	220.030	0,03 %
NCSOFT Corp.	227	94.888	0,02 %	Ferrovial SA	9.167	208.322	0,03 %
Samsung Biologics Co., Ltd.	264	91.489	0,01 %	Abertis Infraestructuras SA	8.875	197.689	0,03 %
Lotte Chemical Corp.	263	90.406	0,01 %	International Consolidated Airlines Group SA	22.092	194.551	0,03 %
Samsung SDS Co., Ltd.	469	87.619	0,01 %	Aena SME SA	876	177.771	0,03 %
GS Holdings Corp.	1.498	87.035	0,01 %	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	4.122	161.459	0,03 %
Hanmi Pharm Co., Ltd.	158	86.191	0,01 %	Gas Natural SDG SA	6.701	154.896	0,02 %
Yuhan Corp.	392	80.191	0,01 %	Banco de Sabadell SA	71.786	142.748	0,02 %
LG Display Co., Ltd.	2.853	79.683	0,01 %	Acerinox SA	8.979	128.468	0,02 %
Hankook Tire Co., Ltd.	1.372	69.975	0,01 %	Enagas SA	4.306	123.423	0,02 %
Coway Co., Ltd.	762	69.541	0,01 %	Endesa SA	4.895	104.950	0,02 %
Samsung Electro-Mechanics Co., Ltd.	699	65.294	0,01 %	Bankia SA	17.284	82.749	0,01 %
Hyundai Heavy Industries Co., Ltd.	620	58.204	0,01 %	Red Electrica Corp. SA	2.443	54.887	0,01 %
Mirae Asset Daewoo Co., Ltd.	5.847	50.193	0,01 %	Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	7.305	37.745	0,01 %
Hyundai Engineering & Construction Co., Ltd.	1.384	46.928	0,01 %	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	1.754	24.074	0,00 %
AMOREPACIFIC Group	354	46.625	0,01 %	Bankinter SA	1.528	14.503	0,00 %
Hanmi Science Co., Ltd.	449	46.555	0,01 %	Repsol SA - Rights Issue 5.1.2018	29.266	13.319	0,00 %
BNK Financial Group, Inc.	5.151	45.325	0,01 %			7.977.587	1,22 %
Hyosung Corp.	347	45.216	0,01 %	Schweden 1,04 % (2016: 1,03 %)			
Hyundai Robotics Co., Ltd.	126	44.842	0,01 %	Atlas Copco AB Klasse A	16.318	705.934	0,11 %
Kangwon Land, Inc.	1.363	44.307	0,01 %	Nordea Bank AB	55.736	675.980	0,10 %
LG Uplus Corp.	3.168	41.429	0,01 %	Saab AB Klasse B	12.354	602.045	0,09 %
Daelim Industrial Co., Ltd.	534	41.102	0,01 %	Volvo AB Klasse B	27.121	505.817	0,08 %
DB Insurance Co., Ltd.	613	40.769	0,01 %	Swedbank AB Klasse A	18.188	439.622	0,07 %
Mando Corp.	134	38.615	0,01 %	Svenska Handelsbanken AB Klasse A	26.331	360.835	0,05 %
Kakao Corp.	272	34.808	0,01 %	Sandvik AB	20.353	357.218	0,05 %
Orion Corp.	351	34.262	0,01 %	Investor AB Klasse B	7.453	340.540	0,05 %
KCC Corp.	92	32.742	0,01 %	Telefonaktiebolaget LM Ericsson Klasse B	48.815	321.061	0,05 %
Celltrion Healthcare Co., Ltd.	318	32.259	0,01 %	Hennes & Mauritz AB Klasse B	14.409	297.947	0,05 %
Samsung Engineering Co., Ltd.	2.444	28.308	0,01 %	Boliden AB	8.185	280.514	0,04 %
Korea Investment Holdings Co., Ltd.	396	25.523	0,00 %	Skandinaviska Enskilda Banken AB Klasse A	23.494	276.333	0,04 %
CJ Corp.	146	24.753	0,00 %	Assa Abloy AB Klasse B	12.756	265.481	0,04 %
Lotte Shopping Co., Ltd.	133	24.723	0,00 %	Telia Co. AB	44.143	197.060	0,03 %
Hyundai Glovis Co., Ltd.	190	24.137	0,00 %	Essity AB Klasse B	6.789	193.202	0,03 %
GS Engineering & Construction Corp.	910	24.056	0,00 %	Hexagon AB Klasse B	3.645	182.929	0,03 %
Hyundai Development Co.- Engineering & Construction	647	23.298	0,00 %	SKF AB Klasse B	5.588	124.352	0,02 %
Hanon Systems	1.739	22.579	0,00 %	Alfa Laval AB	4.778	113.096	0,02 %
DGB Financial Group, Inc.	2.163	21.316	0,00 %	Skanska AB Klasse B	5.111	106.122	0,02 %
CJ CheilJedang Corp.	62	21.197	0,00 %	Electrolux AB	3.061	98.812	0,01 %
Doosan Corp.	189	19.950	0,00 %				
BGF retail Co., Ltd.	94	18.439	0,00 %				
Lotte Corp.	288	17.513	0,00 %				
Samsung Heavy Industries Co., Ltd.	2.106	14.420	0,00 %				
LS Corp.	201	13.612	0,00 %				
Hanwha Chemical Corp.	428	12.634	0,00 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens
Lundin Petroleum AB	3.769	86.451	0,01 %	Aviva plc	85.923	588.717	0,09 %
Svenska Cellulosa AB SCA Klasse B	6.789	70.108	0,01 %	Standard Chartered plc	53.945	569.271	0,09 %
Industrivarden AB Klasse C	2.237	55.327	0,01 %	Legal & General Group plc	143.210	529.457	0,08 %
ICA Gruppen AB	1.511	54.977	0,01 %	CRH plc	14.350	515.776	0,08 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB Klasse C	3.698	43.382	0,01 %	Anglo American plc	24.275	508.825	0,08 %
Kinnevik AB Klasse B	1.033	34.986	0,01 %	Tesco plc	161.388	456.830	0,07 %
Securitas AB Klasse B	758	13.258	0,00 %	Experian plc	18.430	407.874	0,06 %
		6.803.389	1,04 %	WPP plc	21.902	397.311	0,06 %
				Ferguson plc	5.346	385.455	0,06 %
Schweiz 2,99 % (2016: 3,20 %)				SSE plc	18.882	337.163	0,05 %
Nestle SA	51.519	4.430.264	0,68 %	Standard Life Aberdeen plc	56.729	335.047	0,05 %
Novartis AG	41.732	3.528.698	0,54 %	London Stock Exchange Group plc	6.461	331.513	0,05 %
Roche Holding AG	12.317	3.115.588	0,48 %	Royal Bank of Scotland Group plc	86.223	324.254	0,05 %
UBS Group AG	59.205	1.089.931	0,17 %	Cobham plc	186.148	318.038	0,05 %
ABB Ltd.	34.740	931.153	0,14 %	Smith & Nephew plc	17.692	308.255	0,05 %
Cie Financiere Richemont SA	8.904	806.796	0,12 %	Sky plc	22.075	302.203	0,05 %
Credit Suisse Group AG	44.640	797.061	0,12 %	Randgold Resources Ltd.	2.984	299.112	0,05 %
Zurich Insurance Group AG	2.585	786.774	0,12 %	Old Mutual plc	90.961	285.101	0,04 %
LafargeHolcim Ltd.	8.732	492.379	0,07 %	Associated British Foods plc	7.161	273.175	0,04 %
Swiss Re AG	4.937	462.290	0,07 %	Ashtead Group plc	10.030	270.276	0,04 %
Lonza Group AG	1.275	344.492	0,05 %	InterContinental Hotels Group plc	3.996	255.090	0,04 %
Givaudan SA	145	335.085	0,05 %	Antofagasta plc	18.477	251.197	0,04 %
Sika AG	33	262.104	0,04 %	Carnival plc	3.753	248.360	0,04 %
Geberit AG	517	227.650	0,03 %	DCC plc	2.412	243.570	0,04 %
Adecco Group AG	2.268	173.504	0,03 %	Land Securities Group plc REIT	17.784	242.498	0,04 %
Swatch Group AG	422	172.091	0,03 %	Micro Focus International plc	7.091	242.015	0,04 %
Julius Baer Group Ltd.	2.790	170.635	0,03 %	3i Group plc	18.976	234.493	0,04 %
Schindler Holding AG	739	170.095	0,03 %	Segro plc REIT	28.969	230.032	0,03 %
Swisscom AG	277	147.383	0,02 %	Persimmon plc	5.970	221.119	0,03 %
Chocoladefabriken Lindt & Sprüngli AG	2	144.659	0,02 %	British Land Co., plc REIT	23.474	219.582	0,03 %
Kuehne + Nagel International AG	786	139.133	0,02 %	RSA Insurance Group plc	25.537	218.498	0,03 %
Vifor Pharma AG	1.060	135.858	0,02 %	Intertek Group plc	3.106	218.065	0,03 %
SGS SA	51	132.982	0,02 %	Smiths Group plc	10.777	217.221	0,03 %
Partners Group Holding AG	190	130.241	0,02 %	TUI AG	10.178	212.032	0,03 %
Schindler Holding AG REG	366	82.815	0,01 %	Sage Group plc	19.011	205.223	0,03 %
Swatch Group AG REG	932	71.251	0,01 %	Whitbread plc	3.752	203.021	0,03 %
Sonova Holding AG	388	60.599	0,01 %	Taylor Wimpey plc	72.623	202.769	0,03 %
Swiss Life Holding AG	171	60.539	0,01 %	Croda International plc	3.383	202.458	0,03 %
EMS-Chemie Holding AG	80	53.402	0,01 %	Kingfisher plc	43.057	196.695	0,03 %
ams AG	446	40.481	0,01 %	Bunzl plc	6.867	192.475	0,03 %
Dufry AG	264	39.254	0,01 %	United Utilities Group plc	17.079	191.645	0,03 %
Flughafen Zurich AG	129	29.506	0,00 %	Mondi plc	7.248	189.329	0,03 %
Aryzta AG	544	21.576	0,00 %	WM Morrison Supermarkets plc	63.308	188.322	0,03 %
Swiss Prime Site AG	113	10.436	0,00 %	Berkeley Group Holdings plc	3.217	182.645	0,03 %
		19.596.705	2,99 %	Rentokil Initial plc	42.317	182.037	0,03 %
				St James's Place plc	10.911	180.956	0,03 %
Vereinigtes Königreich 6,59 % (2016: 6,67 %)				Worldpay Group plc	31.158	179.555	0,03 %
Royal Dutch Shell plc Klasse B	102.303	3.471.523	0,53 %	Schroders plc	3.754	178.550	0,03 %
British American Tobacco plc	37.138	2.520.964	0,38 %	Barratt Developments plc	20.271	177.555	0,03 %
Diageo plc	43.835	1.615.865	0,25 %	Pearson plc	17.622	175.449	0,03 %
Royal Dutch Shell plc Klasse A	46.469	1.558.951	0,24 %	Severn Trent plc	5.918	173.081	0,03 %
AstraZeneca plc	22.395	1.551.398	0,24 %	Burberry Group plc	7.127	172.768	0,03 %
Vodafone Group plc	485.290	1.542.719	0,24 %	Centrica plc	91.077	169.160	0,03 %
Prudential plc	48.340	1.246.043	0,19 %	Fresnillo plc	8.505	164.408	0,02 %
Lloyds Banking Group plc	1.286.258	1.184.234	0,18 %	J Sainsbury plc	49.471	161.549	0,02 %
Unilever plc	21.025	1.173.357	0,18 %	Booker Group plc	51.319	158.976	0,02 %
Meggitt plc	170.716	1.113.574	0,17 %	Hammerson plc REIT	20.897	154.628	0,02 %
Reckitt Benckiser Group plc	10.602	992.313	0,15 %	ITV plc	66.139	148.072	0,02 %
Rolls-Royce Holdings plc	74.787	856.894	0,13 %	Informa plc	15.018	146.679	0,02 %
Barclays plc	297.581	817.584	0,12 %	Johnson Matthey plc	3.394	141.180	0,02 %
Shire plc	14.848	783.340	0,12 %	Direct Line Insurance Group plc	27.034	139.589	0,02 %
National Grid plc	64.188	759.852	0,12 %	Next plc	2.251	137.788	0,02 %
Compass Group plc	31.185	674.968	0,10 %	Halma plc	7.908	134.789	0,02 %
Imperial Brands plc	15.461	662.165	0,10 %	Marks & Spencer Group plc	31.426	133.826	0,02 %
RELX plc	27.300	642.214	0,10 %	Travis Perkins plc	6.265	132.803	0,02 %
BT Group plc Klasse A	169.774	623.991	0,10 %	GKN plc	30.547	131.984	0,02 %
				Coca-Cola HBC AG	4.020	131.601	0,02 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
DS Smith plc	18.395	128.774	0,02 %	Merck & Co., Inc.	46.235	2.601.643	0,40 %
Bellway plc	2.643	127.389	0,02 %	AbbVie, Inc.	25.754	2.490.669	0,38 %
Inchcape plc	11.935	126.335	0,02 %	General Electric Co.	140.315	2.448.497	0,37 %
Weir Group plc	4.243	121.854	0,02 %	Mastercard, Inc. Klasse A	15.902	2.406.927	0,37 %
Royal Mail plc	19.851	121.512	0,02 %	McDonald's Corp.	13.631	2.346.168	0,36 %
IMI plc	6.681	120.473	0,02 %	3M Co.	9.938	2.339.107	0,36 %
Polymetal International plc	9.481	118.058	0,02 %	Oracle Corp.	47.313	2.236.959	0,34 %
Hargreaves Lansdown plc	4.842	118.031	0,02 %	Altria Group, Inc.	30.885	2.205.498	0,34 %
Pennon Group plc	10.389	110.041	0,02 %	Amgen, Inc.	12.181	2.118.276	0,32 %
Capital & Counties Properties plc	25.347	109.619	0,02 %	International Business Machines Corp.	13.761	2.111.213	0,32 %
Admiral Group plc	3.818	103.399	0,02 %	Texas Instruments, Inc.	17.956	1.875.325	0,29 %
Investec plc	14.025	101.502	0,02 %	Union Pacific Corp.	13.808	1.851.653	0,28 %
Derwent London plc REIT	2.357	99.415	0,01 %	Medtronic plc	22.434	1.811.546	0,28 %
Just Eat plc	9.227	97.483	0,01 %	Bristol-Myers Squibb Co.	29.422	1.802.980	0,28 %
Tate & Lyle plc	9.823	93.415	0,01 %	NVIDIA Corp.	9.153	1.771.106	0,27 %
easyJet plc	4.693	92.941	0,01 %	Accenture plc Klasse A	11.538	1.766.352	0,27 %
CYBG plc	19.230	88.367	0,01 %	Schlumberger Ltd.	25.788	1.737.853	0,27 %
Intu Properties plc REIT	22.789	77.994	0,01 %	Abbott Laboratories	30.321	1.730.419	0,26 %
Howden Joinery Group plc	11.847	74.809	0,01 %	Broadcom Ltd.	6.543	1.680.897	0,26 %
Melrose Industries plc	25.372	72.831	0,01 %	Caterpillar, Inc.	10.368	1.633.789	0,25 %
John Wood Group plc	8.246	72.506	0,01 %	Eli Lilly & Co.	18.917	1.597.730	0,24 %
Hikma Pharmaceuticals plc	4.092	62.772	0,01 %	US Bancorp	29.648	1.588.540	0,24 %
ConvaTec Group plc	20.286	56.393	0,01 %	Goldman Sachs Group, Inc.	6.175	1.573.143	0,24 %
Capita plc	10.055	54.530	0,01 %	QUALCOMM, Inc.	23.543	1.507.223	0,23 %
Mediclinic International plc	6.189	54.377	0,01 %	Gilead Sciences, Inc.	20.990	1.503.724	0,23 %
Aggreko plc	4.880	52.745	0,01 %	United Parcel Service, Inc. Klasse B	12.163	1.449.221	0,22 %
William Hill plc	12.074	52.593	0,01 %	PNC Financial Services Group, Inc.	9.918	1.431.068	0,22 %
Merlin Entertainments plc	9.709	47.663	0,01 %	Costco Wholesale Corp.	7.625	1.419.165	0,22 %
Ashmore Group plc	7.787	42.673	0,01 %	Adobe Systems, Inc.	8.016	1.404.724	0,21 %
Dixons Carphone plc	14.295	38.482	0,01 %	Priceline Group, Inc.	802	1.393.667	0,21 %
Inmarsat plc	4.993	33.150	0,00 %	NextEra Energy, Inc.	8.873	1.385.874	0,21 %
Rightmove plc	465	28.306	0,00 %	PayPal Holdings, Inc.	18.778	1.382.436	0,21 %
Auto Trader Group plc	5.874	28.034	0,00 %	NIKE, Inc. Klasse B	21.556	1.348.328	0,21 %
RPC Group plc	2.275	27.128	0,00 %	Thermo Fisher Scientific, Inc.	7.027	1.334.287	0,20 %
Provident Financial plc	2.038	24.757	0,00 %	Lowe's Cos, Inc.	14.200	1.319.748	0,20 %
Daily Mail & General Trust plc	2.822	22.771	0,00 %	Starbucks Corp.	22.952	1.318.133	0,20 %
NMC Health plc	495	19.318	0,00 %	ConocoPhillips	23.588	1.294.745	0,20 %
Rolls-Royce Holdings plc - Entitlement offer	3.440.202	47	0,00 %	Celgene Corp.	12.355	1.289.368	0,20 %
		43.173.426	6,59 %	Netflix, Inc.	6.613	1.269.431	0,19 %
USA 56,54 % (2016: 56,91 %)				American Express Co.	12.458	1.237.204	0,19 %
Apple, Inc.	81.789	13.841.152	2,11 %	BlackRock, Inc. Klasse A	2.400	1.232.904	0,19 %
Microsoft Corp.	121.436	10.387.635	1,59 %	Salesforce.com, Inc.	12.013	1.228.089	0,19 %
Amazon.com, Inc.	6.313	7.382.864	1,13 %	CVS Health Corp.	16.886	1.224.235	0,19 %
Facebook, Inc. Klasse A	37.693	6.651.307	1,02 %	EOG Resources, Inc.	11.286	1.217.872	0,19 %
JPMorgan Chase & Co.	58.746	6.282.297	0,96 %	Morgan Stanley	23.107	1.212.424	0,19 %
Exxon Mobil Corp.	74.699	6.247.824	0,95 %	Occidental Petroleum Corp.	16.431	1.210.307	0,18 %
Berkshire Hathaway, Inc. Klasse B	28.164	5.582.668	0,85 %	Chubb Ltd.	8.015	1.171.232	0,18 %
Alphabet, Inc. Klasse A	5.279	5.560.899	0,85 %	Time Warner, Inc.	12.787	1.169.627	0,18 %
Bank of America Corp.	161.387	4.764.144	0,73 %	FedEx Corp.	4.617	1.152.126	0,18 %
Alphabet, Inc. Klasse C	4.450	4.656.480	0,71 %	Duke Energy Corp.	13.417	1.128.504	0,17 %
Pfizer, Inc.	109.360	3.961.019	0,60 %	Walgreens Boots Alliance, Inc.	15.371	1.116.242	0,17 %
AT&T, Inc.	99.989	3.887.572	0,59 %	Biogen, Inc.	3.495	1.113.402	0,17 %
Procter & Gamble Co.	42.231	3.880.184	0,59 %	Mondelez International, Inc. Klasse A	25.790	1.103.812	0,17 %
Home Depot, Inc.	19.827	3.757.811	0,57 %	Colgate-Palmolive Co.	14.443	1.089.724	0,17 %
Verizon Communications, Inc.	66.789	3.535.142	0,54 %	Charles Schwab Corp.	20.494	1.052.777	0,16 %
Visa, Inc. Klasse A	30.951	3.529.033	0,54 %	Illinois Tool Works, Inc.	6.294	1.050.154	0,16 %
Intel Corp.	76.016	3.508.899	0,54 %	American Tower Corp. REIT Klasse A	7.265	1.036.498	0,16 %
UnitedHealth Group, Inc.	15.892	3.503.550	0,54 %	Danaher Corp.	11.061	1.026.682	0,16 %
Citigroup, Inc.	45.663	3.397.784	0,52 %	Charter Communications, Inc. Klasse A	3.026	1.016.615	0,16 %
Cisco Systems, Inc.	84.800	3.247.840	0,50 %	Dominion Energy, Inc.	12.488	1.012.277	0,15 %
Comcast Corp. Klasse A	75.447	3.021.652	0,46 %	Phillips 66	9.921	1.003.509	0,15 %
Coca-Cola Co.	65.038	2.983.943	0,46 %	Bank of New York Mellon Corp.	18.328	987.146	0,15 %
PepsiCo, Inc.	24.323	2.916.814	0,45 %	Anthem, Inc.	4.370	983.294	0,15 %
DowDuPont, Inc.	39.247	2.795.171	0,43 %	American International Group, Inc.	16.417	978.125	0,15 %
Walt Disney Co.	25.300	2.720.003	0,42 %				
Philip Morris International, Inc.	25.153	2.657.414	0,41 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Allergan plc	5.800	948.764	0,14 %	Equinix, Inc. REIT	1.361	616.832	0,09 %
Rockwell Collins, Inc.	6.983	947.034	0,14 %	Sysco Corp.	10.099	613.312	0,09 %
Aetna, Inc.	5.244	945.965	0,14 %	HP, Inc.	29.110	611.601	0,09 %
Becton Dickinson and Co.	4.369	935.228	0,14 %	Roper Technologies, Inc.	2.358	610.722	0,09 %
Stryker Corp.	5.966	923.775	0,14 %	General Mills, Inc.	10.268	608.790	0,09 %
Prudential Financial, Inc.	8.029	923.174	0,14 %	Humana, Inc.	2.423	601.074	0,09 %
Ford Motor Co.	73.415	916.953	0,14 %	Consolidated Edison, Inc.	6.957	590.997	0,09 %
Simon Property Group, Inc. REIT	5.277	906.272	0,14 %	Progressive Corp.	10.376	584.376	0,09 %
TransDigm Group, Inc.	3.298	905.697	0,14 %	Johnson Controls International plc	15.299	583.045	0,09 %
Monsanto Co.	7.708	900.140	0,14 %	Amphenol Corp. Klasse A	6.399	561.832	0,09 %
CME Group, Inc. Klasse A	6.134	895.871	0,14 %	Aon plc	4.181	560.254	0,09 %
Berkshire Hathaway, Inc. Klasse A	3	892.800	0,14 %	McKesson Corp.	3.520	548.944	0,08 %
Deere & Co.	5.699	891.951	0,14 %	Arconic, Inc.	20.116	548.161	0,08 %
Valero Energy Corp.	9.640	886.012	0,14 %	PPG Industries, Inc.	4.667	545.199	0,08 %
Applied Materials, Inc.	17.086	873.436	0,13 %	Parker-Hannifin Corp.	2.716	542.059	0,08 %
Automatic Data Processing, Inc.	7.382	865.097	0,13 %	Anadarko Petroleum Corp.	10.066	539.940	0,08 %
TJX Cos, Inc.	11.197	856.123	0,13 %	Public Storage REIT	2.582	539.638	0,08 %
Cigna Corp.	4.198	852.572	0,13 %	Williams Cos, Inc.	17.661	538.484	0,08 %
Kraft Heinz Co.	10.929	849.839	0,13 %	Fidelity National Information Services, Inc.	5.711	537.348	0,08 %
Praxair, Inc.	5.347	827.074	0,13 %	Illumina, Inc.	2.455	536.393	0,08 %
Southern Co.	17.174	825.898	0,13 %	Analog Devices, Inc.	6.011	535.159	0,08 %
Norfolk Southern Corp.	5.614	813.469	0,12 %	Boston Scientific Corp.	21.167	524.730	0,08 %
Capital One Financial Corp.	8.065	803.113	0,12 %	Fiserv, Inc.	3.986	522.684	0,08 %
Zoetis, Inc. Klasse A	11.093	799.140	0,12 %	Stanley Black & Decker, Inc.	3.067	520.439	0,08 %
Emerson Electric Co.	11.402	794.605	0,12 %	M&T Bank Corp.	3.019	516.219	0,08 %
Crown Castle International Corp. REIT	7.113	789.614	0,12 %	Ross Stores, Inc.	6.432	516.168	0,08 %
MetLife, Inc.	15.550	786.208	0,12 %	Pioneer Natural Resources Co.	2.984	515.784	0,08 %
Marriott International, Inc. Klasse A	5.776	783.976	0,12 %	Corning, Inc.	16.005	512.000	0,08 %
CSX Corp.	14.231	782.847	0,12 %	Rockwell Automation, Inc.	2.607	511.884	0,08 %
Activision Blizzard, Inc.	12.351	782.065	0,12 %	Las Vegas Sands Corp.	7.240	503.108	0,08 %
Waste Management, Inc.	9.021	778.512	0,12 %	Cummins, Inc.	2.829	499.715	0,08 %
S&P Global, Inc.	4.555	771.617	0,12 %	Public Service Enterprise Group, Inc.	9.690	499.035	0,08 %
BB&T Corp.	15.363	763.848	0,12 %	Agilent Technologies, Inc.	7.416	496.650	0,08 %
Twenty-First Century Fox, Inc. Klasse A	21.817	753.341	0,11 %	Synchrony Financial	12.810	494.594	0,08 %
Micron Technology, Inc.	17.920	736.870	0,11 %	DXC Technology Co.	5.211	494.524	0,08 %
Cognizant Technology Solutions Corp. Klasse A	10.366	736.193	0,11 %	Electronic Arts, Inc.	4.703	494.097	0,08 %
TE Connectivity Ltd.	7.692	731.048	0,11 %	Nucor Corp.	7.723	491.028	0,07 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	8.796	715.906	0,11 %	Fortive Corp.	6.765	489.448	0,07 %
Express Scripts Holding Co.	9.570	714.305	0,11 %	Sempra Energy	4.567	488.304	0,07 %
Allstate Corp.	6.821	714.227	0,11 %	Lam Research Corp.	2.609	480.239	0,07 %
Kinder Morgan, Inc.	39.280	709.790	0,11 %	Xcel Energy, Inc.	9.946	478.502	0,07 %
Intercontinental Exchange, Inc.	9.989	704.824	0,11 %	Estee Lauder Cos, Inc. Klasse A	3.753	477.532	0,07 %
American Electric Power Co., Inc.	9.568	703.918	0,11 %	Carnival Corp.	7.190	477.200	0,07 %
State Street Corp.	7.195	702.304	0,11 %	AvalonBay Communities, Inc. REIT	2.648	472.430	0,07 %
Kimberly-Clark Corp.	5.793	698.983	0,11 %	PACCAR, Inc.	6.627	471.047	0,07 %
Intuitive Surgical, Inc.	1.889	689.372	0,11 %	Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	1.246	468.446	0,07 %
Travelers Cos, Inc.	5.056	685.796	0,10 %	Newmont Mining Corp.	12.424	466.148	0,07 %
Ecolab, Inc.	5.069	680.158	0,10 %	Weyerhaeuser Co. REIT	13.040	459.790	0,07 %
Air Products & Chemicals, Inc.	4.125	676.830	0,10 %	HCA Healthcare, Inc.	5.159	453.167	0,07 %
Tesla, Inc.	2.173	676.564	0,10 %	International Paper Co.	7.791	451.411	0,07 %
Eaton Corp. plc	8.508	672.217	0,10 %	T Rowe Price Group, Inc.	4.292	450.360	0,07 %
Prologis, Inc. REIT	10.382	669.743	0,10 %	Ameriprise Financial, Inc.	2.652	449.434	0,07 %
LyondellBasell Industries NV Klasse A	6.037	666.002	0,10 %	Concho Resources, Inc.	2.989	449.008	0,07 %
Aflac, Inc.	7.575	664.934	0,10 %	Moody's Corp.	3.025	446.520	0,07 %
Exelon Corp.	16.696	657.989	0,10 %	Dollar General Corp.	4.752	441.984	0,07 %
Marathon Petroleum Corp.	9.937	655.643	0,10 %	Kroger Co.	15.886	436.071	0,07 %
Intuit, Inc.	4.086	644.689	0,10 %	Devon Energy Corp.	10.408	430.891	0,07 %
eBay, Inc.	17.082	644.675	0,10 %	Fifth Third Bancorp	14.179	430.191	0,07 %
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	4.196	628.813	0,10 %	Discover Financial Services	5.576	428.906	0,07 %
Baxter International, Inc.	9.721	628.365	0,10 %	VF Corp.	5.793	428.682	0,07 %
SunTrust Banks, Inc.	9.667	624.392	0,10 %	Equity Residential REIT	6.699	427.195	0,07 %
Target Corp.	9.502	620.006	0,09 %	Monster Beverage Corp.	6.735	426.258	0,07 %
Constellation Brands, Inc. Klasse A	2.704	618.053	0,09 %	WEC Energy Group, Inc.	6.408	425.683	0,06 %
Sherwin-Williams Co.	1.505	617.110	0,09 %	DollarTree, Inc.	3.955	424.411	0,06 %
				Alexion Pharmaceuticals, Inc.	3.508	419.522	0,06 %
				DTE Energy Co.	3.774	413.102	0,06 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
KeyCorp	20.463	412.739	0,06 %	FleetCor Technologies, Inc.	1.467	282.295	0,04 %
Ingersoll-Rand plc	4.607	410.898	0,06 %	Omnicom Group, Inc.	3.876	282.289	0,04 %
Citizens Financial Group, Inc.	9.694	406.954	0,06 %	Entergy Corp.	3.464	281.935	0,04 %
Tyson Foods, Inc. Klasse A	4.995	404.945	0,06 %	WestRock Co.	4.422	279.515	0,04 %
Regions Financial Corp.	23.400	404.352	0,06 %	Eastman Chemical Co.	2.999	277.827	0,04 %
Republic Services, Inc. Klasse A	5.936	401.333	0,06 %	Essex Property Trust, Inc. REIT	1.151	277.817	0,04 %
Archer-Daniels-Midland Co.	10.012	401.281	0,06 %	Loews Corp.	5.538	277.066	0,04 %
American Water Works Co., Inc.	4.354	398.347	0,06 %	DR Horton, Inc.	5.403	275.931	0,04 %
ServiceNow, Inc.	3.049	397.559	0,06 %	Fastenal Co.	5.032	275.200	0,04 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	3.292	397.246	0,06 %	MGM Resorts International	8.229	274.766	0,04 %
Welltower, Inc. REIT	6.205	395.693	0,06 %	Motorola Solutions, Inc.	3.001	271.110	0,04 %
Edwards Lifesciences Corp.	3.491	393.471	0,06 %	Xylem, Inc.	3.956	269.799	0,04 %
Eversource Energy	6.222	393.106	0,06 %	Laboratory Corp. of America Holdings	1.690	269.572	0,04 %
Aptiv plc	4.622	392.084	0,06 %	Centene Corp.	2.662	268.543	0,04 %
Mylan NV	9.247	391.241	0,06 %	KLA-Tencor Corp.	2.553	268.244	0,04 %
Andeavor	3.341	382.010	0,06 %	CenturyLink, Inc.	16.017	267.164	0,04 %
Paychex, Inc.	5.605	381.588	0,06 %	IHS Markit Ltd.	5.909	266.791	0,04 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	26.300	377.668	0,06 %	Dr Pepper Snapple Group, Inc.	2.746	266.527	0,04 %
Ventas, Inc. REIT	6.238	374.342	0,06 %	Conagra Brands, Inc.	7.041	265.234	0,04 %
Western Digital Corp.	4.684	372.519	0,06 %	BioMarin Pharmaceutical, Inc.	2.972	265.013	0,04 %
Hartford Financial Services Group, Inc.	6.515	366.664	0,06 %	Baker Hughes a GE Co.	8.341	263.909	0,04 %
Principal Financial Group, Inc.	5.159	364.019	0,06 %	Annaly Capital Management, Inc. REIT	22.182	263.744	0,04 %
PG&E Corp.	8.035	360.209	0,05 %	Cabot Oil & Gas Corp.	9.221	263.721	0,04 %
ONEOK, Inc.	6.705	358.382	0,05 %	Alcoa Corp.	4.868	262.239	0,04 %
Northern Trust Corp.	3.586	358.206	0,05 %	Realty Income Corp. REIT	4.585	261.437	0,04 %
Royal Caribbean Cruises Ltd.	2.976	354.977	0,05 %	Global Payments, Inc.	2.606	261.225	0,04 %
National Oilwell Varco, Inc.	9.801	353.032	0,05 %	Mettler-Toledo International, Inc.	418	258.959	0,04 %
Boston Properties, Inc. REIT	2.690	349.781	0,05 %	Host Hotels & Resorts, Inc. REIT	13.038	258.804	0,04 %
Digital Realty Trust, Inc. REIT	3.028	344.889	0,05 %	Skyworks Solutions, Inc.	2.699	256.270	0,04 %
Red Hat, Inc.	2.871	344.807	0,05 %	Twitter, Inc.	10.580	254.026	0,04 %
Autodesk, Inc.	3.214	336.924	0,05 %	LKQ Corp.	6.239	253.740	0,04 %
O'Reilly Automotive, Inc.	1.377	331.224	0,05 %	Ameren Corp.	4.254	250.943	0,04 %
AutoZone, Inc.	460	327.230	0,05 %	Pentair plc	3.548	250.560	0,04 %
Mohawk Industries, Inc.	1.186	327.217	0,05 %	Maxim Integrated Products, Inc.	4.752	248.435	0,04 %
T-Mobile US, Inc.	5.144	326.695	0,05 %	DENTSPLY SIRONA, Inc.	3.768	248.047	0,04 %
CBS Corp. Klasse B	5.520	325.680	0,05 %	Yum China Holdings, Inc.	6.182	247.404	0,04 %
Dover Corp.	3.219	325.087	0,05 %	Masco Corp.	5.622	247.031	0,04 %
PPL Corp.	10.428	322.747	0,05 %	United Rentals, Inc.	1.434	246.519	0,04 %
Edison International	5.074	320.880	0,05 %	Xilinx, Inc.	3.653	246.285	0,04 %
Cardinal Health, Inc.	5.226	320.197	0,05 %	Invesco Ltd.	6.698	244.745	0,04 %
SBA Communications Corp. REIT Klasse A	1.942	317.245	0,05 %	Cimarex Energy Co.	2.004	244.508	0,04 %
Hershey Co.	2.794	317.147	0,05 %	Albemarle Corp.	1.911	244.398	0,04 %
Liberty Global plc Klasse C	9.325	315.558	0,05 %	Incyte Corp.	2.579	244.257	0,04 %
Dell Technologies, Inc. Klasse V Klasse V	3.867	314.310	0,05 %	AmerisourceBergen Corp. Klasse A	2.658	244.058	0,04 %
Waste Connections, Inc.	4.393	312.606	0,05 %	Martin Marietta Materials, Inc.	1.098	242.702	0,04 %
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	3.911	312.332	0,05 %	Expedia, Inc.	2.022	242.175	0,04 %
Cerner Corp.	4.615	311.005	0,05 %	Verisk Analytics, Inc. Klasse A	2.520	241.920	0,04 %
Huntington Bancshares, Inc.	21.122	307.536	0,05 %	Cheniere Energy, Inc.	4.421	238.027	0,04 %
Kellogg Co.	4.510	306.590	0,05 %	E*TRADE Financial Corp.	4.798	237.837	0,04 %
Microchip Technology, Inc.	3.481	305.910	0,05 %	JM Smucker Co.	1.910	237.298	0,04 %
Best Buy Co., Inc.	4.416	302.364	0,05 %	Genuine Parts Co.	2.493	236.860	0,04 %
Apache Corp.	7.093	299.466	0,05 %	Quest Diagnostics, Inc.	2.402	236.573	0,04 %
Lincoln National Corp.	3.886	298.717	0,05 %	International Flavors & Fragrances, Inc.	1.547	236.088	0,04 %
Franklin Resources, Inc.	6.819	295.467	0,05 %	FirstEnergy Corp.	7.680	235.162	0,04 %
Waters Corp.	1.524	294.422	0,04 %	NetApp, Inc.	4.243	234.723	0,04 %
Vulcan Materials Co.	2.289	293.839	0,04 %	GGP, Inc. REIT	10.028	234.555	0,04 %
Marathon Oil Corp.	17.317	293.177	0,04 %	Delta Air Lines, Inc.	4.151	232.456	0,04 %
Align Technology, Inc.	1.318	292.846	0,04 %	Newell Brands Inc.	7.499	231.719	0,04 %
Comerica, Inc.	3.360	291.682	0,04 %	IQVIA Holdings, Inc.	2.357	230.750	0,04 %
Celanese Corp. Klasse A	2.718	291.043	0,04 %	Total System Services, Inc.	2.916	230.626	0,04 %
Markel Corp.	254	289.339	0,04 %	Unum Group	4.179	229.385	0,03 %
AMETEK, Inc.	3.973	287.923	0,04 %	Wynn Resorts Ltd.	1.350	227.597	0,03 %
Willis Towers Watson plc	1.902	286.612	0,04 %	Perrigo Co. plc	2.607	227.226	0,03 %
Symantec Corp.	10.131	284.276	0,04 %	L Brands, Inc.	3.713	223.597	0,03 %
Hess Corp.	5.976	283.681	0,04 %	EQT Corp.	3.891	221.476	0,03 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens
Molson Coors Brewing Co. Klasse B	2.687	220.522	0,03 %	Viacom, Inc. Klasse B	5.572	171.673	0,03 %
Lear Corp.	1.244	219.765	0,03 %	DISH Network Corp. Klasse A	3.582	171.041	0,03 %
Kansas City Southern	2.085	219.384	0,03 %	Alliant Energy Corp.	4.008	170.781	0,03 %
ANSYS, Inc.	1.477	217.990	0,03 %	Extra Space Storage, Inc. REIT	1.931	168.866	0,03 %
CenterPoint Energy, Inc.	7.682	217.862	0,03 %	SEI Investments Co.	2.343	168.368	0,03 %
Workday, Inc. Klasse A	2.128	216.503	0,03 %	PVH Corp.	1.217	166.985	0,03 %
IDEXX Laboratories, Inc.	1.375	215.023	0,03 %	Lennar Corp. Klasse A	2.598	164.298	0,03 %
Tapestry Inc.	4.836	213.896	0,03 %	UDR, Inc. REIT	4.250	163.710	0,02 %
McCormick & Co., Inc.	2.097	213.705	0,03 %	Liberty Interactive Corp. QVC Group Klasse A	6.700	163.614	0,02 %
Ulta Beauty, Inc.	953	213.148	0,03 %	Clorox Co.	1.094	162.722	0,02 %
FMC Corp.	2.232	211.281	0,03 %	CF Industries Holdings, Inc.	3.819	162.460	0,02 %
Nielsen Holdings plc	5.786	210.610	0,03 %	Sirius XM Holdings, Inc.	30.295	162.381	0,02 %
CMS Energy Corp.	4.441	210.059	0,03 %	Coty, Inc. Klasse A	8.144	161.984	0,02 %
Vornado Realty Trust REIT	2.661	208.037	0,03 %	CarMax, Inc.	2.505	160.646	0,02 %
First Republic Bank	2.391	207.156	0,03 %	Alleghany Corp.	269	160.348	0,02 %
Ally Financial, Inc.	7.102	207.094	0,03 %	Avery Dennison Corp.	1.389	159.541	0,02 %
FNF Group	5.241	205.657	0,03 %	Universal Health Services, Inc. Klasse B	1.392	157.783	0,02 %
Palo Alto Networks, Inc.	1.418	205.525	0,03 %	NRG Energy, Inc.	5.474	155.900	0,02 %
Darden Restaurants, Inc.	2.136	205.099	0,03 %	Leucadia National Corp.	5.783	153.192	0,02 %
Tiffany & Co.	1.971	204.885	0,03 %	Lamb Weston Holdings, Inc.	2.706	152.754	0,02 %
BorgWarner, Inc.	3.987	203.696	0,03 %	Bunge Ltd.	2.270	152.272	0,02 %
Expeditors International of Washington, Inc.	3.132	202.609	0,03 %	Mosaic Co.	5.906	151.548	0,02 %
Zions Bancorporation	3.951	200.829	0,03 %	Flex Ltd.	8.407	151.242	0,02 %
TD Ameritrade Holding Corp.	3.927	200.788	0,03 %	Pinnacle West Capital Corp.	1.761	150.002	0,02 %
Check Point Software Technologies Ltd.	1.932	200.194	0,03 %	Kohl's Corp.	2.756	149.458	0,02 %
NVR, Inc.	57	199.969	0,03 %	Helmerich & Payne, Inc.	2.312	149.448	0,02 %
Southwest Airlines Co.	3.042	199.099	0,03 %	Arch Capital Group Ltd.	1.630	147.955	0,02 %
Cincinnati Financial Corp.	2.651	198.745	0,03 %	Splunk, Inc.	1.785	147.869	0,02 %
Autoliv, Inc.	1.562	198.499	0,03 %	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	2.766	147.290	0,02 %
Seagate Technology plc	4.744	198.489	0,03 %	Amdocs Ltd.	2.235	146.348	0,02 %
VWV Grainger, Inc.	838	197.978	0,03 %	Hasbro, Inc.	1.607	146.060	0,02 %
Citrix Systems, Inc.	2.238	196.944	0,03 %	Goodyear Tire & Rubber Co.	4.502	145.460	0,02 %
CH Robinson Worldwide, Inc.	2.204	196.354	0,03 %	CIT Group, Inc.	2.943	144.884	0,02 %
HCP, Inc. REIT	7.516	196.017	0,03 %	Commerce Bancshares, Inc.	2.560	142.950	0,02 %
Liberty Media Corp. Series C- Liberty SiriusXM	4.934	195.682	0,03 %	People's United Financial, Inc.	7.592	141.970	0,02 %
VMware, Inc. Klasse A	1.539	192.867	0,03 %	PulteGroup, Inc.	4.247	141.213	0,02 %
HollyFrontier Corp.	3.759	192.536	0,03 %	Liberty Global plc Klasse A	3.918	140.421	0,02 %
Ball Corp.	5.075	192.089	0,03 %	Liberty Broadband Corp. Klasse C	1.647	140.259	0,02 %
Arista Networks, Inc.	802	188.935	0,03 %	Everest Re Group Ltd.	632	139.836	0,02 %
Snap-on, Inc.	1.082	188.593	0,03 %	IAC/InterActiveCorp	1.136	138.910	0,02 %
Mid-America Apartment Communities, Inc. REIT	1.875	188.550	0,03 %	Campbell Soup Co.	2.881	138.605	0,02 %
Alliance Data Systems Corp.	743	188.336	0,03 %	Domino's Pizza, Inc.	733	138.508	0,02 %
Targa Resources Corp.	3.884	188.063	0,03 %	Janus Henderson Group plc	3.610	138.119	0,02 %
Hormel Foods Corp.	5.154	187.554	0,03 %	Michael Kors Holdings Ltd.	2.131	134.146	0,02 %
CBRE Group, Inc. Klasse A	4.319	187.056	0,03 %	Juniper Networks, Inc.	4.683	133.466	0,02 %
JB Hunt Transport Services, Inc.	1.610	185.118	0,03 %	Macerich Co. REIT	2.029	133.265	0,02 %
Synopsys, Inc.	2.170	184.971	0,03 %	Duke Realty Corp. REIT	4.890	133.057	0,02 %
Brown-Forman Corp. Klasse B	2.673	183.555	0,03 %	SL Green Realty Corp. REIT	1.309	132.117	0,02 %
MercadoLibre, Inc.	577	181.559	0,03 %	Alkermes plc	2.401	131.407	0,02 %
Voya Financial, Inc.	3.589	177.548	0,03 %	Varian Medical Systems, Inc.	1.181	131.268	0,02 %
Church & Dwight Co., Inc.	3.526	176.899	0,03 %	XL Group Ltd.	3.728	131.076	0,02 %
Hologic, Inc.	4.137	176.857	0,03 %	Murphy Oil Corp.	4.197	130.317	0,02 %
Wyndham Worldwide Corp.	1.521	176.238	0,03 %	VeriSign, Inc.	1.138	130.233	0,02 %
Trimble, Inc.	4.333	176.093	0,03 %	Garmin Ltd.	2.178	129.743	0,02 %
Whirlpool Corp.	1.043	175.892	0,03 %	Advanced Micro Devices, Inc.	12.600	129.528	0,02 %
Jazz Pharmaceuticals plc	1.303	175.449	0,03 %	Interpublic Group of Cos, Inc.	6.423	129.488	0,02 %
Akamai Technologies, Inc.	2.695	175.283	0,03 %	Gap, Inc.	3.784	128.883	0,02 %
CA, Inc.	5.245	174.554	0,03 %	Nasdaq, Inc.	1.659	127.461	0,02 %
Fortune Brands Home & Security, Inc.	2.532	173.290	0,03 %	Federal Realty Investment Trust REIT	959	127.365	0,02 %
Henry Schein, Inc.	2.475	172.953	0,03 %	Marvell Technology Group Ltd.	5.878	126.201	0,02 %
DaVita, Inc.	2.389	172.605	0,03 %	Continental Resources, Inc.	2.381	126.122	0,02 %
ResMed, Inc.	2.038	172.598	0,03 %	Macy's, Inc.	4.978	125.396	0,02 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
New York Community Bancorp, Inc.	9.629	125.370	0,02 %	Ralph Lauren Corp. Klasse A	777	80.567	0,01 %
WR Berkley Corp.	1.743	124.886	0,02 %	Discovery Communications, Inc. Klasse C	3.796	80.361	0,01 %
Adient plc	1.582	124.503	0,02 %	Leggett & Platt, Inc.	1.637	78.134	0,01 %
Vantiv, Inc. Klasse A	1.688	124.152	0,02 %	Herbalife Ltd.	1.152	78.013	0,01 %
Arthur J Gallagher & Co.	1.959	123.966	0,02 %	Toll Brothers, Inc.	1.624	77.984	0,01 %
Broadridge Financial Solutions, Inc.	1.366	123.732	0,02 %	Foot Locker, Inc.	1.637	76.743	0,01 %
Tractor Supply Co.	1.623	121.319	0,02 %	Range Resources Corp.	4.264	72.744	0,01 %
Kimco Realty Corp. REIT	6.557	119.010	0,02 %	Bioerativ, Inc.	1.269	68.424	0,01 %
Cooper Cos, Inc.	543	118.309	0,02 %	NiSource, Inc.	2.654	68.128	0,01 %
AGNC Investment Corp. REIT	5.851	118.132	0,02 %	Ashland Global Holdings, Inc.	905	64.436	0,01 %
Torchmark Corp.	1.274	115.565	0,02 %	Liberty Property Trust REIT	1.495	64.300	0,01 %
American Airlines Group, Inc.	2.218	115.403	0,02 %	CNA Financial Corp.	1.200	63.660	0,01 %
Lululemon Athletica, Inc.	1.468	115.370	0,02 %	Sprint Corp.	10.163	59.860	0,01 %
Scripps Networks Interactive, Inc. Klasse A	1.351	115.348	0,02 %	Park Hotels & Resorts, Inc. REIT	2.043	58.736	0,01 %
Newfield Exploration Co.	3.641	114.801	0,02 %	Calpine Corp.	3.757	56.843	0,01 %
Yandex NV Klasse A	3.499	114.592	0,02 %	Robert Half International, Inc.	1.011	56.151	0,01 %
Ingredion, Inc.	818	114.356	0,02 %	Weatherford International plc	13.251	55.257	0,01 %
Regency Centers Corp. REIT	1.635	113.109	0,02 %	Liberty Broadband Corp. Klasse A	633	53.837	0,01 %
Harley-Davidson, Inc.	2.206	112.241	0,02 %	Assurant, Inc.	529	53.344	0,01 %
Antero Resources Corp.	5.854	111.226	0,02 %	Mallinckrodt plc	2.145	48.391	0,01 %
VEREIT, Inc. REIT	14.277	111.218	0,02 %	SCANA Corp.	1.194	47.497	0,01 %
Polaris Industries, Inc.	895	110.971	0,02 %	Jabil, Inc.	1.764	46.305	0,01 %
Acuity Brands, Inc.	625	110.000	0,02 %	Hospitality Properties Trust REIT	1.534	45.790	0,01 %
Xerox Corp.	3.761	109.633	0,02 %	Raymond James Financial, Inc.	508	45.364	0,01 %
Qorvo, Inc.	1.645	109.557	0,02 %	Signet Jewelers Ltd.	797	45.070	0,01 %
Affiliated Managers Group, Inc.	528	108.372	0,02 %	Under Armour, Inc. Klasse A	2.997	43.247	0,01 %
Iron Mountain, Inc. REIT	2.852	107.606	0,02 %	Avnet, Inc.	1.081	42.829	0,01 %
Core Laboratories NV	961	105.278	0,02 %	CSRA, Inc.	1.358	40.631	0,01 %
Wabtec Corp.	1.272	103.579	0,02 %	RenaissanceRe Holdings Ltd.	320	40.189	0,01 %
Arrow Electronics, Inc.	1.284	103.246	0,02 %	NCR Corp.	1.162	39.496	0,01 %
Chipotle Mexican Grill, Inc. Klasse A	350	101.161	0,02 %	TripAdvisor, Inc.	1.121	38.630	0,01 %
Manpowergroup, Inc.	801	101.014	0,02 %	Edgewell Personal Care Co.	588	34.921	0,01 %
Twenty-First Century Fox, Inc. Klasse B	2.931	100.006	0,02 %	Bed Bath & Beyond, Inc.	1.568	34.480	0,01 %
Keysight Technologies, Inc.	2.399	99.798	0,02 %	Axis Capital Holdings Ltd.	664	33.373	0,01 %
Westlake Chemical Corp.	935	99.606	0,02 %	Old Republic International Corp.	1.508	32.241	0,00 %
F5 Networks, Inc.	757	99.334	0,02 %	Alaska Air Group, Inc.	418	30.727	0,00 %
Allegion plc	1.213	96.506	0,01 %	Under Armour, Inc. Klasse C	2.256	30.050	0,00 %
Advance Auto Parts, Inc.	948	94.506	0,01 %	AutoNation, Inc.	575	29.515	0,00 %
Flowserve Corp.	2.238	94.287	0,01 %	Nuance Communications, Inc.	1.577	25.784	0,00 %
CDK Global, Inc.	1.315	93.733	0,01 %	Dun & Bradstreet Corp.	209	24.748	0,00 %
Hanesbrands, Inc.	4.478	93.635	0,01 %	Navient Corp.	1.849	24.629	0,00 %
Gentex Corp.	4.456	93.353	0,01 %	Bemis Co., Inc.	500	23.895	0,00 %
H&R Block, Inc.	3.551	93.107	0,01 %	MDU Resources Group, Inc.	834	22.418	0,00 %
United Continental Holdings, Inc.	1.381	93.079	0,01 %	Discovery Communications, Inc. Klasse A	979	21.910	0,00 %
Sealed Air Corp.	1.841	90.761	0,01 %	Santander Consumer USA Holdings, Inc.	689	12.829	0,00 %
Sensata Technologies Holding NV	1.715	87.654	0,01 %	Patterson Cos, Inc.	195	7.045	0,00 %
Western Union Co.	4.564	86.762	0,01 %	Safeway CASA Ley CVR	9.691	1.270	0,00 %
Stericycle, Inc.	1.254	85.259	0,01 %	Safeway PDC LLC CVR	9.691	3	0,00 %
Mattel, Inc.	5.494	84.498	0,01 %				
Brighthouse Financial Inc.	1.418	83.152	0,01 %			370.169.568	56,54 %
Nordstrom, Inc.	1.721	81.541	0,01 %	Summe Aktien		652.421.390	99,66 %
Avangrid, Inc.	1.607	81.282	0,01 %	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		652.421.390	99,66 %
Delphi Technologies plc	1.540	80.804	0,01 %				

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures 0,00 % (2016: (0,01 %))				
S&P 500 E-mini März 2018	10	1.330.875	7.125	0,00 %
FTSE 100 Index März 2018	1	100.146	3.177	0,00 %
Topix Index März 2018	1	160.320	977	0,00 %
SPI 200 März 2018	1	117.869	(156)	(0,00 %)
Euro Stoxx 50 März 2018	7	297.384	(3.776)	(0,00 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente			7.347	0,00 %

	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Sonstige Aktiva und Passiva	2.243.266	0,34 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)	654.672.003	100,00 %

REIT – Real Estate Investment Trust.

Analyse des Gesamtvermögens	US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	650.817.478	99,42 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	1.603.912	0,24 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente	7.347	0,00 %
(e) Sonstige Aktiva und Passiva	2.243.266	0,34 %
Gesamtnettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)	654.672.003	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Anteile	Kosten US-Dollar (\$)		Anteile	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
Dassault Aviation SA	1.012	1.460.071	Apple, Inc.	31.550	4.812.447
Zodiac Aerospace	24.782	725.409	Microsoft Corp.	42.219	3.141.306
Saab AB Klasse B	12.354	584.097	Alphabet, Inc. Klasse C	2.995	2.824.859
TransDigm Group, Inc.	1.712	449.290	Amazon.com, Inc.	2.220	2.165.403
Meggitt plc	46.760	312.183	JPMorgan Chase & Co.	21.541	2.030.914
IHS Markit Ltd.	6.473	297.001	Exxon Mobil Corp.	23.493	1.915.873
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	5.500	269.165	Facebook, Inc. Klasse A	10.848	1.777.240
Align Technology, Inc.	1.431	264.020	Rockwell Collins, Inc.	13.900	1.760.015
Japan Post Holdings Co., Ltd.	21.017	248.542	Roche Holding AG	6.578	1.669.844
IDEXX Laboratories, Inc.	1.480	247.752	General Electric Co.	61.641	1.583.103
Pfizer, Inc.	7.288	237.430	Samsung Electronics Co., Ltd.	711	1.543.431
Targa Resources Corp.	3.884	219.327	Bank of America Corp.	60.558	1.523.095
Regency Centers Corp. REIT	3.266	216.834	Procter & Gamble Co.	16.797	1.514.330
Teck Resources Ltd. Klasse B	10.832	200.644	Novartis AG	17.132	1.424.879
MercadoLibre, Inc.	708	200.159	AT&T, Inc.	36.716	1.407.416
Amazon.com, Inc.	200	197.542	Pfizer, Inc.	39.977	1.394.832
Mid-America Apartment Communities, Inc. REIT	1.875	193.039	Nestle SA	16.633	1.392.907
Advanced Micro Devices, Inc.	16.119	190.053	Coca-Cola Co.	30.851	1.379.476
Commerce Bancshares, Inc.	3.214	187.183	Citigroup, Inc.	19.602	1.353.647
Yum China Holdings, Inc.	4.354	165.523	Comcast Corp. Klasse A	32.717	1.272.566

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	652.421.390	722.797.161
Derivative Finanzinstrumente	11.279	30.066
Barmittel	730.188	7.329.929
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenkassageschäften	—	3.980
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	1.037.736	1.157.400
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	556.998	3.356.240
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	919.548	967
Bareinschüsse für Futures	79.202	384.155
Sonstige Forderungen	6	—
Summe Umlaufvermögen	655.756.347	735.059.898
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	3.932	69.643
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	3.624	—
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	—	19
Zahlbare Dividenden	397.560	372.629
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	489.134	832.255
Zahlbare Verwaltungsgebühren	190.094	200.771
Summe kurzfristige Passiva	1.084.344	1.475.317
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	654.672.003	733.584.581

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	209.270.447	268.699.869	259.114.417
Nettovermögen	174.275.856	254.752.192	238.529.337
Anzahl der umlaufenden Anteile	883.433	1.386.236	1.426.019
Nettoinventarwert je Anteil	197,27	183,77	167,27
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	13.946.848	6.018.853	7.030
Anzahl der umlaufenden Anteile	110.411	58.231	73
Nettoinventarwert je Anteil	126,32	103,36	96,89
EUR-Anlegeranteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	22.683.025	12.503.429	9.562.706
Nettovermögen	18.889.928	11.854.401	8.803.007
Anzahl der umlaufenden Anteile	95.927	64.588	52.668
Nettoinventarwert je Anteil	196,92	183,54	167,14
Thesaurierende GBP-Anteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	166.619.919	123.091.465	100.767.925
Nettovermögen	123.171.262	99.616.777	68.368.225
Anzahl der umlaufenden Anteile	537.729	485.477	423.963
Nettoinventarwert je Anteil	229,06	205,19	161,26
Ausschüttende GBP-Anteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	145.696.891	109.104.055	90.641.601
Nettovermögen	107.704.229	88.296.896	61.497.797
Anzahl der umlaufenden Anteile	524.635	472.201	410.845
Nettoinventarwert je Anteil	205,29	186,99	149,69
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	94.253.221	214.149.845	415.809.831
Nettovermögen	78.492.023	203.033.751	382.776.242
Anzahl der umlaufenden Anteile	494.577	1.374.655	2.850.151
Nettoinventarwert je Anteil	158,71	147,70	134,30
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	2.191.231	8.550	8.007
Nettovermögen	1.619.834	6.919	5.433
Anzahl der umlaufenden Anteile	10.475	50	50
Nettoinventarwert je Anteil	154,64	138,38	108,66
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	10.421	8.515	8.007
Nettovermögen	7.704	6.891	5.433
Anzahl der umlaufenden Anteile	53	52	51
Nettoinventarwert je Anteil	145,36	132,52	106,31

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	18.535	25.671
Dividenden	18.157.561	21.117.400
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	98.489	256.505
Verschiedene Erträge	26.354	696
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	132.592.231	32.431.609
Summe Anlageerträge/(-verluste)	150.893.170	53.831.881
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	2.386.161	2.465.461
Transaktionsgebühren und Provisionen	54.124	61.693
Sonstige Aufwendungen	5.312	12.069
Summe Aufwendungen	2.445.597	2.539.223
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	1.585	3.445
Ausgezahlte Ausschüttungen	2.190.988	1.813.037
Ertragsausgleich	687	(47.003)
Summe Finanzierungskosten	2.193.260	1.769.479
Nettoanlageerträge/(-verluste)	146.254.313	49.523.179
Ausländische Quellensteuer	(3.375.354)	(3.924.066)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	142.878.959	45.599.113

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	142.878.959	45.599.113
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	136.113.310	164.438.994
Rücknahmen	(358.026.139)	(352.421.178)
Reinvestitionen	121.292	48.128
Summe Kapitalgeschäfte ¹	(221.791.537)	(187.934.056)
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	(78.912.578)	(142.334.943)
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	733.584.581	875.919.524
Zum Jahresende	654.672.003	733.584.581

1 Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

U.S. 500 Stock Index Fund

Verwaltet durch The Vanguard Group, Inc.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Anlageziel

Das Ziel des Fonds besteht darin, die Performance des S&P 500 Index, ein allgemein anerkannter Referenzindex für die Performance des US-Aktienmarktes, der die Aktien grosser US-amerikanischer Unternehmen beinhaltet, abzubilden.

Portfoliomerkmale

	Fonds	S&P 500 Index
Anzahl der Aktien	505	505
Mittlere Marktkapitalisierung		
US-Dollar	\$ 94,4 Mrd.	\$ 94,4 Mrd.
Euro	€ 78,6 Mrd.	€ 78,6 Mrd.
Kurs/Gewinn-Verhältnis	23,2x	23,2x
Kurs/Buch-Verhältnis	3,2x	3,2x
Rendite	1,8 %	1,8 %
Eigenkapitalrendite	16,0 %	16,0 %
Ertragszuwachsrate	9,6 %	9,6 %
Nicht-US-Positionen	0,0 %	—
Portfolioumschlag ¹	-39 %	—
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,10 %	
Anlegeranteile	0,25 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,06 %	
Kurzfristige Reserven	0,1 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	S&P 500 Index
R ²	1,00	1,00
Beta	1,00	1,00

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds	S&P 500 Index
Luxusgüter	12,2 %	12,2 %
Grundbedarfsgüter	8,2	8,2
Energie	6,1	6,1
Finanzwerte	14,8	14,8
Gesundheitswesen	13,8	13,8
Industriegüter	10,2	10,2
Informationstechnologie	23,8	23,8
Grundstoffe	3,0	3,0
Immobilien	2,9	2,9
Telekommunikationsdienste	2,1	2,1
Versorger	2,9	2,9

Die 10 grössten Positionen² (% des Gesamt Nettovermögens)

Unternehmen	Sektor	Anteil
Apple Inc.	Technologie-Hardware, Speicher und Peripheriegeräte	3,8 %
Microsoft Corp.	Systemsoftware	2,9
Alphabet Inc.	Internetsoftware und -dienste	2,8
Amazon.com Inc.	Online- und Direkt-Marketing Einzelhandel	2,0
Facebook Inc.	Internetsoftware und -dienste	1,8
Berkshire Hathaway Inc.	Sektorübergreifende Positionen	1,7
Johnson & Johnson	Pharma	1,6
JPMorgan Chase & Co.	Diversifizierte Banken	1,6
Exxon Mobil Corp.	Integrierter Öl- und Gaskonzern	1,5
Bank of America Corp.	Diversifizierte Banken	1,3
Zehn grösste Positionen		21,0 %

Anlagefokus

Stil	Wert	Mischung	Wachstum
Marktkapitalisierung	Gross		
	Mittel		
	Klein		

¹ Ein negativer Portfolioumschlag deutet darauf hin, dass der Gesamtwert der Zeichnungen und Rückkäufe über dem Wert der Wertpapiertransaktionen gelegen hat.

² Die aufgeführten Positionen schliessen etwaige vorübergehende Baranlagen und Aktienindexprodukte aus.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

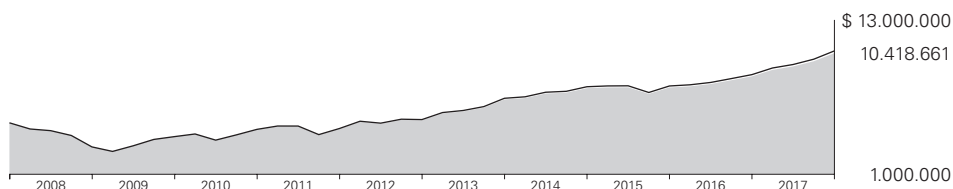
Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

U.S. 500 Stock Index Fund
 Benchmark: S&P 500 Index¹

In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000



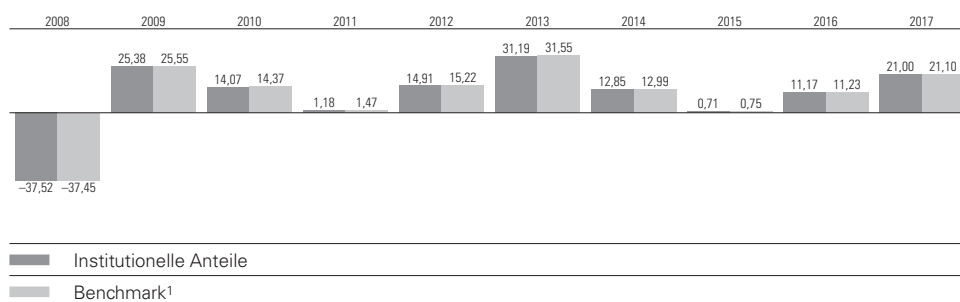
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
— Institutionelle Anteile	21,00 %	14,93 %	7,62 %	\$ 10.418.661
— Benchmark ¹	21,10	15,07	7,80	10.591.748

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen			Endwert einer Anlage von \$ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Anlegeranteile	20,82 %	14,79 %	7,51 %	\$ 206.243
Benchmark ¹	21,10	15,07	7,80	211.835

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen		Endwert einer Anlage von \$ 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ²	
Institutionelle Plus-Anteile	21,05 %	11,75 %	\$ 313.024.999
Benchmark ¹	21,10	11,78	313.373.460

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,10 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,28 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,05 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.³

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017

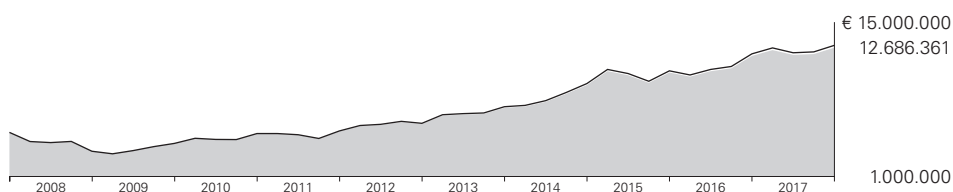


1 Indexrenditen wurden um die Quellensteuer von 30 % auf Dividenden bereinigt, die auf US-Wertpapiere bezahlt werden.
 2 19. Dezember 2013.
 3 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

U.S. 500 Stock Index Fund
 Benchmark: S&P 500 Index¹

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



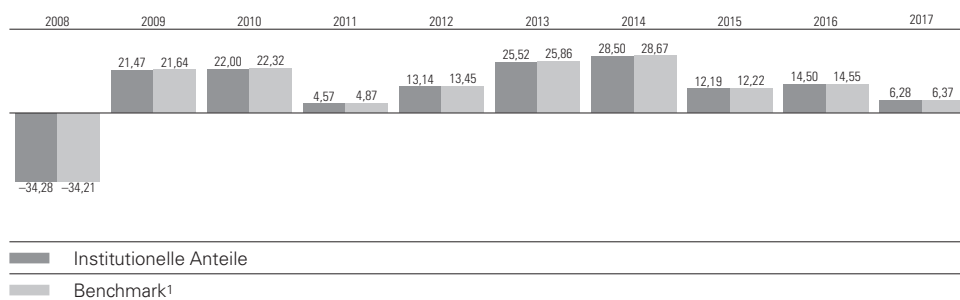
	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
— Institutionelle Anteile	6,28 %	17,10 %	9,76 %	€ 12.686.361
— Benchmark ¹	6,37	17,24	9,94	12.896.124

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Anlegeranteile	6,12 %	16,96 %	9,65 %	€ 251.179
Benchmark ¹	6,37	17,24	9,94	257.922

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ²	
Institutionelle Plus-Anteile	6,32 %	15,37 %	€ 357.766.399
Benchmark ¹	6,37	15,40	358.164.702

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,09 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,25 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,05 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.³

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017

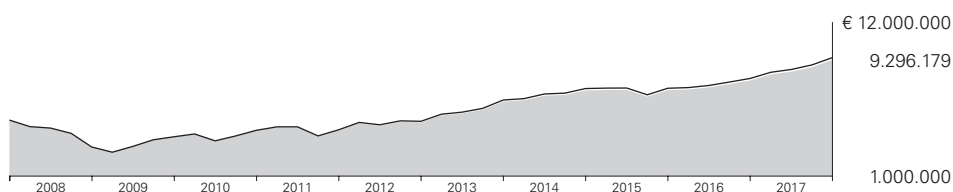


1 Indexrenditen wurden um die Quellensteuer von 30 % auf Dividenden bereinigt, die auf US-Wertpapiere bezahlt werden.
 2 6. Dezember 2013.
 3 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

U.S. 500 Stock Index Fund
 Benchmark: S&P 500 Index Euro-Hedged¹

Abgesichert in Euro

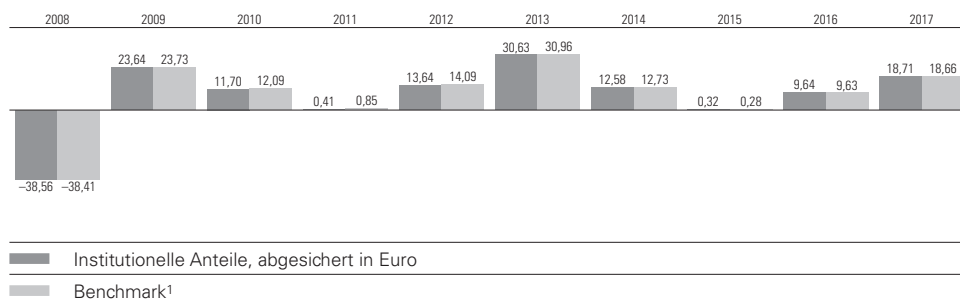
Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Institutionelle Anteile, abgesichert in Euro	18,71 %	13,94 %	6,40 %	€ 9.296.179
— Benchmark ¹	18,66	14,00	6,59	9.464.106

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,05 Prozentpunkte für institutionelle in Euro abgesicherte Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



¹ Indexrenditen wurden um die Quellensteuer von 30 % auf Dividenden bereinigt, die auf US-Wertpapiere bezahlt werden.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Aktien 99,62 % (2016: 99,49 %)							
Zyklische Konsumgüter 12,17 % (2016: 11,96 %)							
Amazon.com, Inc.	111.758	130.697.628	2,04 %	BorgWarner, Inc.	55.409	2.830.846	0,04 %
Home Depot, Inc.	326.306	61.844.776	0,97 %	Michael Kors Holdings Ltd.	42.325	2.664.359	0,04 %
Comcast Corp.Klasse A	1.303.356	52.199.408	0,82 %	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	49.617	2.642.105	0,04 %
Walt Disney Co.	422.068	45.376.531	0,71 %	Tractor Supply Co.	34.976	2.614.456	0,04 %
McDonald's Corp.	222.816	38.351.090	0,60 %	PulteGroup, Inc.	76.958	2.558.854	0,04 %
Priceline Group, Inc.	13.639	23.701.036	0,37 %	Kohl's Corp.	46.532	2.523.430	0,04 %
Netflix, Inc.	120.986	23.224.473	0,36 %	Harley-Davidson, Inc.	47.292	2.406.217	0,04 %
NIKE, Inc. Klasse B	367.241	22.970.925	0,36 %	News Corp. Klasse A	140.743	2.281.444	0,04 %
Starbucks Corp.	397.672	22.838.303	0,36 %	Scripps Networks Interactive, Inc. Klasse A	26.505	2.262.997	0,04 %
Lowe's Cos, Inc.	232.786	21.635.131	0,34 %	Goodyear Tire & Rubber Co.	69.566	2.247.677	0,04 %
Time Warner, Inc.	217.614	19.905.153	0,31 %	Interpublic Group of Cos, Inc.	109.122	2.199.900	0,03 %
Charter Communications, Inc. Klasse A	54.206	18.211.048	0,28 %	Macy's, Inc.	85.191	2.145.961	0,03 %
General Motors Co.	357.415	14.650.441	0,23 %	Hanesbrands, Inc.	100.727	2.106.202	0,03 %
Ford Motor Co.	1.090.613	13.621.756	0,21 %	Gap, Inc.	60.561	2.062.708	0,03 %
TJX Cos, Inc.	177.947	13.605.828	0,21 %	Advance Auto Parts, Inc.	20.689	2.062.486	0,03 %
Mariott International, Inc. Klasse A	85.259	11.572.204	0,18 %	Chipotle Mexican Grill, Inc. Klasse A	6.999	2.022.921	0,03 %
Twenty-First Century Fox, Inc. Klasse A	294.695	10.175.818	0,16 %	Garmin Ltd.	30.641	1.825.284	0,03 %
Target Corp.	152.029	9.919.892	0,15 %	Leggett & Platt, Inc.	37.141	1.772.740	0,03 %
Ross Stores, Inc.	107.580	8.633.295	0,13 %	Foot Locker, Inc.	34.919	1.637.003	0,03 %
Yum! Brands, Inc.	93.760	7.651.754	0,12 %	Ralph Lauren Corp. Klasse A	15.493	1.606.469	0,03 %
Carnival Corp.	114.053	7.569.698	0,12 %	Nordstrom, Inc.	32.037	1.517.913	0,02 %
Dollar Tree, Inc.	66.307	7.115.404	0,11 %	H&R Block, Inc.	57.624	1.510.901	0,02 %
VF Corp.	91.748	6.789.352	0,11 %	Mattel, Inc.	95.777	1.473.050	0,02 %
Dollar General Corp.	72.377	6.731.785	0,11 %	Discovery Communications, Inc. Klasse C	57.320	1.213.464	0,02 %
Aptiv plc	74.366	6.308.468	0,10 %	TripAdvisor, Inc.	30.564	1.053.235	0,02 %
CBS Corp.Klasse B	101.077	5.963.543	0,09 %	Discovery Communications, Inc. Klasse A	43.914	982.795	0,02 %
Royal Caribbean Cruises Ltd.	47.968	5.721.623	0,09 %	Signet Jewelers Ltd.	16.967	959.484	0,01 %
O'Reilly Automotive, Inc.	23.667	5.692.860	0,09 %	Under Armour, Inc. Klasse A	52.694	760.374	0,01 %
AutoZone, Inc.	7.693	5.472.569	0,09 %	Under Armour, Inc. Klasse C	52.070	693.572	0,01 %
DR Horton, Inc.	95.561	4.880.300	0,08 %	Lennar Corp.Klasse B	1.122	57.985	0,00 %
Best Buy Co., Inc.	70.795	4.847.334	0,08 %			778.104.302	12,17 %
Mohawk Industries, Inc.	17.559	4.844.528	0,08 %	Nicht-zyklische Konsumgüter 8,17 % (2016: 9,32 %)			
MGM Resorts International	143.000	4.774.770	0,07 %	Procter & Gamble Co.	712.027	65.421.041	1,02 %
Omnicom Group, Inc.	64.524	4.699.283	0,07 %	Coca-Cola Co.	1.071.587	49.164.412	0,77 %
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	56.380	4.502.507	0,07 %	PepsiCo, Inc.	397.477	47.665.442	0,75 %
Newell Brands Inc.	136.265	4.210.588	0,07 %	Philip Morris International, Inc.	434.071	45.859.601	0,72 %
Twenty-First Century Fox, Inc. Klasse B	122.985	4.196.248	0,07 %	Wal-Mart Stores, Inc.	409.049	40.393.589	0,63 %
L Brands, Inc.	68.821	4.144.401	0,06 %	Altria Group, Inc.	533.277	38.081.311	0,60 %
Expedia, Inc.	34.498	4.131.825	0,06 %	Costco Wholesale Corp.	122.212	22.746.097	0,36 %
Genuine Parts Co.	41.078	3.902.821	0,06 %	CVS Health Corp.	283.112	20.525.620	0,32 %
Wynn Resorts Ltd.	22.509	3.794.792	0,06 %	Colgate-Palmolive Co.	245.456	18.519.655	0,29 %
Ulta Beauty, Inc.	16.210	3.625.529	0,06 %	Mondelez International, Inc. Klasse A	417.679	17.876.661	0,28 %
Lennar Corp. Klasse A	56.020	3.542.705	0,06 %	Walgreens Boots Alliance, Inc.	242.696	17.624.583	0,28 %
Tapestry Inc.	79.623	3.521.725	0,05 %	Kraft Heinz Co.	166.975	12.983.976	0,20 %
LKQ Corp.	86.144	3.503.476	0,05 %	Kimberly-Clark Corp.	98.095	11.836.143	0,18 %
Whirlpool Corp.	20.202	3.406.865	0,05 %	Constellation Brands, Inc. Klasse A	48.169	11.009.988	0,17 %
Darden Restaurants, Inc.	35.004	3.361.084	0,05 %	General Mills, Inc.	158.915	9.422.070	0,15 %
Wyndham Worldwide Corp.	28.299	3.279.005	0,05 %	Sysco Corp.	134.090	8.143.286	0,13 %
CarMax, Inc.	50.531	3.240.553	0,05 %	Estee Lauder Cos, Inc. Klasse A	62.640	7.970.314	0,12 %
Viacom, Inc. Klasse B	98.359	3.030.441	0,05 %	Monster Beverage Corp.	114.635	7.255.249	0,11 %
DISH Network Corp. Klasse A	63.209	3.018.230	0,05 %	Kroger Co.	247.968	6.806.722	0,11 %
PVH Corp.	21.589	2.962.227	0,05 %	Tyson Foods, Inc. Klasse A	82.857	6.717.217	0,10 %
Tiffany & Co.	28.348	2.946.775	0,05 %	Archer-Daniels-Midland Co.	155.419	6.229.193	0,10 %
Hasbro, Inc.	31.771	2.887.666	0,05 %	Clorox Co.	36.085	5.367.283	0,08 %
				Dr Pepper Snapple Group, Inc.	50.188	4.871.247	0,08 %
				Kellogg Co.	69.640	4.734.127	0,07 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Hershey Co.	39.529	4.486.937	0,07 %	S&P Global, Inc.	71.336	12.084.318	0,19 %
Conagra Brands, Inc.	114.800	4.324.516	0,07 %	Marsh & McLennan Cos, Inc.	142.214	11.574.797	0,18 %
Molson Coors Brewing Co. Klasse B	51.706	4.243.511	0,07 %	Intercontinental Exchange, Inc.	163.286	11.521.460	0,18 %
JM Smucker Co.	31.824	3.953.814	0,06 %	BB&T Corp.	219.620	10.919.506	0,17 %
Brown-Forman Corp. Klasse B	54.649	3.752.747	0,06 %	Allstate Corp.	100.351	10.507.753	0,17 %
Church & Dwight Co., Inc.	69.318	3.477.684	0,05 %	Travelers Cos, Inc.	76.527	10.380.122	0,16 %
McCormick & Co., Inc.	33.611	3.425.297	0,05 %	State Street Corp.	103.698	10.121.962	0,16 %
Hormel Foods Corp.	74.317	2.704.396	0,04 %	Aflac, Inc.	109.690	9.628.588	0,15 %
Campbell Soup Co.	54.046	2.600.153	0,04 %	Aon plc	69.550	9.319.700	0,15 %
Coty, Inc. Klasse A	130.313	2.591.926	0,04 %	Progressive Corp.	162.686	9.162.476	0,14 %
		522.785.808	8,17 %	SunTrust Banks, Inc.	132.637	8.567.024	0,13 %
				Synchrony Financial	205.732	7.943.313	0,12 %
Energie 6,06 % (2016: 7,52 %)				Discover Financial Services	101.132	7.779.073	0,12 %
Exxon Mobil Corp.	1.183.964	99.026.749	1,55 %	M&T Bank Corp.	42.129	7.203.638	0,11 %
Chevron Corp.	530.754	66.445.093	1,04 %	T Rowe Price Group, Inc.	67.532	7.086.133	0,11 %
Schlumberger Ltd.	387.146	26.089.769	0,41 %	Ameriprise Financial, Inc.	41.395	7.015.211	0,11 %
ConocoPhillips	334.181	18.343.195	0,29 %	Moody's Corp.	46.536	6.869.179	0,11 %
EOG Resources, Inc.	161.649	17.443.544	0,27 %	KeyCorp	300.795	6.067.035	0,10 %
Occidental Petroleum Corp.	213.952	15.759.704	0,25 %	Northern Trust Corp.	60.135	6.006.885	0,09 %
Phillips 66	120.109	12.149.025	0,19 %	Fifth Third Bancorp	196.421	5.959.413	0,09 %
Halliburton Co.	242.931	11.872.038	0,18 %	Citizens Financial Group, Inc.	137.674	5.779.555	0,09 %
Valero Energy Corp.	122.352	11.245.372	0,17 %	Hartford Financial Services Group, Inc.	99.233	5.584.833	0,09 %
Kinder Morgan, Inc.	537.035	9.704.223	0,15 %	Willis Towers Watson plc	37.048	5.582.763	0,09 %
Marathon Petroleum Corp.	135.962	8.970.773	0,14 %	Regions Financial Corp.	322.927	5.580.179	0,09 %
Pioneer Natural Resources Co.	47.654	8.236.994	0,13 %	Berkshire Hathaway, Inc. Klasse A	18	5.356.800	0,08 %
Anadarko Petroleum Corp.	152.301	8.169.426	0,13 %	Principal Financial Group, Inc.	75.179	5.304.630	0,08 %
Williams Cos, Inc.	231.197	7.049.197	0,11 %	Lincoln National Corp.	61.171	4.702.215	0,07 %
Sonoco Resources, Inc.	41.664	6.258.766	0,10 %	Huntington Bancshares, Inc.	301.064	4.383.492	0,07 %
Devon Energy Corp.	147.048	6.087.787	0,09 %	Comerica, Inc.	48.844	4.240.148	0,07 %
ONEOK, Inc.	107.327	5.736.628	0,09 %	Invesco Ltd.	113.948	4.163.660	0,07 %
Andeavor	39.804	4.551.189	0,07 %	Cboe Global Markets Inc.	31.773	3.958.598	0,06 %
Apache Corp.	106.588	4.500.145	0,07 %	Franklin Resources, Inc.	90.804	3.934.537	0,06 %
Marathon Oil Corp.	237.034	4.012.986	0,06 %	Loews Corp.	77.332	3.868.920	0,06 %
Noble Energy, Inc.	136.267	3.970.820	0,06 %	E*TRADE Financial Corp.	75.869	3.760.826	0,06 %
EQT Corp.	68.587	3.903.972	0,06 %	Unum Group	62.265	3.417.726	0,05 %
TechnipFMC plc	122.526	3.836.289	0,06 %	Raymond James Financial, Inc.	35.765	3.193.815	0,05 %
National Oilwell Varco, Inc.	105.604	3.803.856	0,06 %	Arthur J Gallagher & Co.	50.048	3.167.037	0,05 %
Baker Hughes a GE Co.	119.391	3.777.531	0,06 %	Affiliated Managers Group, Inc.	15.380	3.156.745	0,05 %
Cabot Oil & Gas Corp.	129.502	3.703.757	0,06 %	Cincinnati Financial Corp.	41.638	3.121.601	0,05 %
Hess Corp.	75.374	3.578.004	0,06 %	Zions Bancorporation	56.339	2.863.711	0,05 %
Cimarex Energy Co.	26.717	3.259.741	0,05 %	Torchmark Corp.	29.769	2.700.346	0,04 %
Helmerich & Payne, Inc.	30.313	1.959.432	0,03 %	Everest Re Group Ltd.	11.481	2.540.286	0,04 %
Newfield Exploration Co.	55.671	1.755.307	0,03 %	XL Group Ltd.	71.944	2.529.551	0,04 %
Range Resources Corp.	63.760	1.087.746	0,02 %	Nasdaq, Inc.	32.586	2.503.582	0,04 %
Chesapeake Energy Corp.	256.334	1.015.083	0,02 %	Leucadia National Corp.	88.249	2.337.716	0,04 %
		387.304.141	6,06 %	People's United Financial, Inc.	96.291	1.800.642	0,03 %
Finanztitel 14,74 % (2016: 14,74 %)				Brighthouse Financial Inc.	26.368	1.546.220	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	969.554	103.684.105	1,62 %	Assurant, Inc.	15.134	1.526.113	0,02 %
Berkshire Hathaway, Inc. Klasse B	510.786	101.248.001	1,58 %	Navient Corp.	77.313	1.029.809	0,02 %
Bank of America Corp.	2.710.466	80.012.956	1,25 %			942.692.863	14,74 %
Wells Fargo & Co.	1.238.343	75.130.270	1,18 %	Gesundheitswesen 13,72 % (2016: 13,56 %)			
Citigroup, Inc.	738.858	54.978.424	0,86 %	Johnson & Johnson	750.702	104.888.083	1,64 %
Goldman Sachs Group, Inc.	98.042	24.977.180	0,39 %	Pfizer, Inc.	1.665.644	60.329.626	0,94 %
US Bancorp	440.614	23.608.098	0,37 %	UnitedHealth Group, Inc.	270.780	59.696.159	0,93 %
Morgan Stanley	389.067	20.414.345	0,32 %	AbbVie, Inc.	445.497	43.084.015	0,67 %
American Express Co.	201.445	20.005.503	0,31 %	Merck & Co., Inc.	764.364	43.010.762	0,67 %
PNC Financial Services Group, Inc.	133.074	19.201.247	0,30 %	Amgen, Inc.	202.938	35.290.918	0,55 %
Chubb Ltd.	129.764	18.962.413	0,30 %	Medtronic plc	378.335	30.550.551	0,48 %
BlackRock, Inc. Klasse A	34.513	17.729.673	0,28 %	Bristol-Myers Squibb Co.	457.432	28.031.433	0,44 %
Charles Schwab Corp.	333.529	17.133.385	0,27 %	Abbott Laboratories	486.475	27.763.128	0,43 %
Bank of New York Mellon Corp.	286.225	15.416.078	0,24 %	Gilead Sciences, Inc.	365.135	26.158.271	0,41 %
American International Group, Inc.	250.608	14.931.225	0,23 %	Celgene Corp.	220.101	22.969.740	0,36 %
MetLife, Inc.	294.155	14.872.477	0,23 %	Eli Lilly & Co.	270.788	22.870.755	0,36 %
CME Group, Inc. Klasse A	95.191	13.902.646	0,22 %	Thermo Fisher Scientific, Inc.	112.157	21.296.371	0,33 %
Prudential Financial, Inc.	118.586	13.635.018	0,21 %	Biogen, Inc.	59.099	18.827.168	0,29 %
Capital One Financial Corp.	135.531	13.496.177	0,21 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens
Aetna, Inc.	91.224	16.455.897	0,26 %	CSX Corp.	249.889	13.746.394	0,22 %
Anthem, Inc.	71.774	16.149.868	0,25 %	Emerson Electric Co.	179.509	12.509.982	0,20 %
Danaher Corp.	171.114	15.882.802	0,25 %	Norfolk Southern Corp.	80.024	11.595.478	0,18 %
Becton Dickinson and Co.	74.084	15.858.421	0,25 %	Delta Air Lines, Inc.	183.430	10.272.080	0,16 %
Allergan plc	92.985	15.210.486	0,24 %	Southwest Airlines Co.	152.655	9.991.270	0,16 %
Cigna Corp.	68.917	13.996.354	0,22 %	Johnson Controls International plc	257.692	9.820.642	0,15 %
Stryker Corp.	89.989	13.933.897	0,22 %	Eaton Corp. plc	123.198	9.733.874	0,15 %
Express Scripts Holding Co.	158.423	11.824.693	0,19 %	Waste Management, Inc.	111.152	9.592.418	0,15 %
Intuitive Surgical, Inc.	31.324	11.431.381	0,18 %	Cummins, Inc.	43.506	7.684.900	0,12 %
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	70.476	10.561.533	0,17 %	Parker-Hannifin Corp.	37.304	7.445.132	0,12 %
Humana, Inc.	39.947	9.909.652	0,16 %	Roper Technologies, Inc.	28.631	7.415.429	0,12 %
Zoetis, Inc. Klasse A	135.665	9.773.307	0,15 %	Stanley Black & Decker, Inc.	42.977	7.292.767	0,11 %
Boston Scientific Corp.	383.929	9.517.600	0,15 %	Rockwell Automation, Inc.	35.691	7.007.928	0,11 %
McKesson Corp.	58.341	9.098.279	0,14 %	PACCAR, Inc.	98.368	6.991.997	0,11 %
Baxter International, Inc.	140.153	9.059.490	0,14 %	Ingersoll-Rand plc	69.978	6.241.338	0,10 %
Illumina, Inc.	40.825	8.919.854	0,14 %	Fortive Corp.	85.589	6.192.364	0,10 %
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	21.549	8.101.562	0,13 %	Rockwell Collins, Inc.	45.615	6.186.306	0,10 %
Alexion Pharmaceuticals, Inc.	62.499	7.474.255	0,12 %	American Airlines Group, Inc.	118.493	6.165.191	0,10 %
HCA Healthcare, Inc.	78.808	6.922.495	0,11 %	United Continental Holdings, Inc.	69.780	4.703.172	0,07 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	56.721	6.844.523	0,11 %	AMETEK, Inc.	64.118	4.646.631	0,07 %
Edwards Lifesciences Corp.	59.216	6.674.235	0,10 %	IHS Markit Ltd.	100.984	4.559.428	0,07 %
Mylan NV	149.089	6.307.956	0,10 %	Dover Corp.	43.591	4.402.255	0,07 %
Agilent Technologies, Inc.	89.286	5.979.483	0,09 %	Fastenal Co.	80.481	4.401.506	0,07 %
Cerner Corp.	88.348	5.953.772	0,09 %	L3 Technologies, Inc.	21.737	4.300.665	0,07 %
Cardinal Health, Inc.	87.395	5.354.692	0,08 %	Republic Services, Inc. Klasse A	63.175	4.271.262	0,07 %
Centene Corp.	48.304	4.872.908	0,08 %	Verisk Analytics, Inc. Klasse A	43.511	4.177.056	0,07 %
Incyte Corp.	48.776	4.619.575	0,07 %	Textron, Inc.	73.074	4.135.258	0,06 %
Laboratory Corp. of America Holdings	28.496	4.545.397	0,07 %	United Rentals, Inc.	23.459	4.032.837	0,06 %
Align Technology, Inc.	20.190	4.486.016	0,07 %	Equifax, Inc.	33.396	3.938.056	0,06 %
Mettler-Toledo International, Inc.	7.084	4.388.680	0,07 %	Masco Corp.	88.464	3.887.108	0,06 %
Waters Corp.	22.171	4.283.216	0,07 %	Cintas Corp.	24.164	3.765.476	0,06 %
DENTSPLY SIRONA, Inc.	64.295	4.232.540	0,07 %	TransDigm Group, Inc.	13.532	3.716.158	0,06 %
AmerisourceBergen Corp. Klasse A	44.742	4.108.210	0,06 %	CH Robinson Worldwide, Inc.	39.168	3.489.477	0,05 %
IQVIA Holdings, Inc.	40.532	3.968.083	0,06 %	VW Grainger, Inc.	14.630	3.456.337	0,05 %
IDEXX Laboratories, Inc.	24.480	3.828.182	0,06 %	Xylem, Inc.	50.091	3.416.206	0,05 %
Quest Diagnostics, Inc.	38.175	3.759.856	0,06 %	Nielsen Holdings plc	93.339	3.397.540	0,05 %
ResMed, Inc.	39.247	3.323.828	0,05 %	Pentair plc	46.076	3.253.887	0,05 %
Hologic, Inc.	76.371	3.264.860	0,05 %	Arconic, Inc.	118.003	3.215.582	0,05 %
Perrigo Co. plc	36.975	3.222.741	0,05 %	Expeditors International of Washington, Inc.	49.133	3.178.414	0,05 %
Henry Schein, Inc.	44.268	3.093.448	0,05 %	Kansas City Southern	29.058	3.057.483	0,05 %
DaVita, Inc.	42.474	3.068.747	0,05 %	Fortune Brands Home & Security, Inc.	42.910	2.936.760	0,05 %
Cooper Cos, Inc.	13.573	2.957.285	0,05 %	Snap-on, Inc.	16.095	2.805.358	0,04 %
Varian Medical Systems, Inc.	25.457	2.829.546	0,04 %	JB Hunt Transport Services, Inc.	23.790	2.735.374	0,04 %
Universal Health Services, Inc. Klasse B	24.467	2.773.334	0,04 %	Alaska Air Group, Inc.	34.451	2.532.493	0,04 %
PerkinElmer, Inc.	30.441	2.225.846	0,03 %	AO Smith Corp.	40.402	2.475.835	0,04 %
Envision Healthcare Corp.	33.259	1.149.431	0,02 %	Jacobs Engineering Group, Inc.	33.731	2.224.897	0,03 %
Patterson Cos, Inc.	23.265	840.564	0,01 %	Allegion plc	26.237	2.087.416	0,03 %
		877.805.760	13,72 %	Acuity Brands, Inc.	11.835	2.082.960	0,03 %
Industrie 10,15 % (2016: 10,22 %)				Fluor Corp.	38.968	2.012.697	0,03 %
Boeing Co.	156.445	46.137.195	0,72 %	Robert Half International, Inc.	34.789	1.932.181	0,03 %
General Electric Co.	2.423.293	42.286.463	0,66 %	Quanta Services, Inc.	42.236	1.651.850	0,03 %
3M Co.	166.764	39.251.243	0,61 %	Stericycle, Inc.	23.954	1.628.632	0,03 %
Honeywell International, Inc.	212.933	32.655.405	0,51 %	Flowserve Corp.	36.634	1.543.390	0,02 %
Union Pacific Corp.	220.017	29.504.280	0,46 %			649.249.488	10,15 %
United Technologies Corp.	207.586	26.481.746	0,41 %	Informationstechnologie 23,76 % (2016: 20,67 %)			
Caterpillar, Inc.	166.314	26.207.760	0,41 %	Apple, Inc.	1.434.597	242.776.850	3,80 %
United Parcel Service, Inc. Klasse B	192.098	22.888.477	0,36 %	Microsoft Corp.	2.155.494	184.380.957	2,88 %
Lockheed Martin Corp.	69.722	22.384.248	0,35 %	Facebook, Inc. Klasse A	666.375	117.588.533	1,84 %
FedEx Corp.	68.959	17.208.029	0,27 %	Alphabet, Inc. Klasse C	84.346	88.259.654	1,38 %
General Dynamics Corp.	77.623	15.792.399	0,25 %	Alphabet, Inc. Klasse A	83.287	87.734.526	1,37 %
Raytheon Co.	80.826	15.183.164	0,24 %	Intel Corp.	1.307.761	60.366.248	0,94 %
Northrop Grumman Corp.	48.662	14.934.854	0,23 %	Visa, Inc. Klasse A	506.748	57.779.407	0,90 %
Illinois Tool Works, Inc.	86.285	14.396.652	0,23 %	Cisco Systems, Inc.	1.381.400	52.907.620	0,83 %
Deere & Co.	89.454	14.000.446	0,22 %	Oracle Corp.	851.390	40.253.719	0,63 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Mastercard, Inc. Klasse A	259.587	39.291.088	0,61 %	Grundstoffe 2,98 % (2016: 2,83 %)			
International Business Machines Corp.	240.641	36.919.142	0,58 %	DowDuPont, Inc.	653.951	46.574.390	0,73 %
NVIDIA Corp.	169.357	32.770.579	0,51 %	Monsanto Co.	122.856	14.347.124	0,22 %
Broadcom Ltd.	113.629	29.191.290	0,46 %	Praxair, Inc.	80.040	12.380.587	0,19 %
Texas Instruments, Inc.	275.495	28.772.698	0,45 %	Air Products & Chemicals, Inc.	60.997	10.008.388	0,16 %
Accenture plc Klasse A	172.796	26.453.340	0,41 %	LyondellBasell Industries NV Klasse A	90.481	9.981.864	0,16 %
QUALCOMM, Inc.	411.973	26.374.511	0,41 %	Ecolab, Inc.	72.351	9.708.057	0,15 %
Adobe Systems, Inc.	137.822	24.151.927	0,38 %	Sherwin-Williams Co.	23.013	9.436.251	0,15 %
PayPal Holdings, Inc.	315.788	23.248.313	0,36 %	PPG Industries, Inc.	70.875	8.279.617	0,13 %
Salesforce.com, Inc.	191.823	19.610.065	0,31 %	Freeport-McMoRan, Inc.	374.109	7.093.107	0,11 %
Applied Materials, Inc.	298.158	15.241.837	0,24 %	International Paper Co.	115.473	6.690.506	0,10 %
Automatic Data Processing, Inc.	124.012	14.532.966	0,23 %	Nucor Corp.	88.168	5.605.721	0,09 %
Activision Blizzard, Inc.	211.381	13.384.645	0,21 %	Newmont Mining Corp.	148.183	5.559.826	0,09 %
Micron Technology, Inc.	322.445	13.258.938	0,21 %	Vulcan Materials Co.	37.044	4.755.338	0,07 %
Cognizant Technology Solutions Corp. Klasse A	164.895	11.710.843	0,18 %	WestRock Co.	71.257	4.504.155	0,07 %
Intuit, Inc.	67.936	10.718.942	0,17 %	Albemarle Corp.	30.776	3.935.943	0,06 %
eBay, Inc.	270.411	10.205.311	0,16 %	Martin Marietta Materials, Inc.	17.597	3.889.641	0,06 %
HP, Inc.	467.000	9.811.670	0,15 %	Eastman Chemical Co.	39.919	3.698.096	0,06 %
TE Connectivity Ltd.	98.340	9.346.234	0,15 %	Ball Corp.	97.080	3.674.478	0,06 %
Analog Devices, Inc.	103.144	9.182.910	0,14 %	FMC Corp.	37.250	3.526.085	0,06 %
Electronic Arts, Inc.	85.685	9.002.066	0,14 %	International Flavors & Fragrances, Inc.	21.878	3.338.802	0,05 %
Fidelity National Information Services, Inc.	93.412	8.789.135	0,14 %	Packaging Corp. of America	26.336	3.174.805	0,05 %
Lam Research Corp.	45.311	8.340.396	0,13 %	Avery Dennison Corp.	24.665	2.833.022	0,04 %
Corning, Inc.	241.869	7.737.389	0,12 %	CF Industries Holdings, Inc.	64.412	2.740.086	0,04 %
Fiserv, Inc.	58.281	7.642.388	0,12 %	Mosaic Co.	96.970	2.488.250	0,04 %
DXC Technology Co.	79.824	7.575.298	0,12 %	Sealed Air Corp.	50.138	2.471.803	0,04 %
Amphenol Corp. Klasse A	85.416	7.499.525	0,12 %			190.695.942	2,98 %
Western Digital Corp.	82.730	6.579.517	0,10 %	Immobilien 2,88 % (2016: 2,87 %)			
Autodesk, Inc.	61.329	6.429.119	0,10 %	American Tower Corp. REIT Klasse A	119.906	17.106.989	0,27 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	443.991	6.375.711	0,10 %	Simon Property Group, Inc. REIT	86.914	14.926.610	0,23 %
Paychex, Inc.	88.876	6.050.678	0,09 %	Crown Castle International Corp. REIT	113.651	12.616.398	0,20 %
Red Hat, Inc.	49.329	5.924.413	0,09 %	Equinix, Inc. REIT	21.785	9.873.398	0,15 %
Microchip Technology, Inc.	65.450	5.751.746	0,09 %	Prologis, Inc. REIT	148.851	9.602.378	0,15 %
Symantec Corp.	173.477	4.867.765	0,08 %	Public Storage REIT	41.849	8.746.441	0,14 %
Skyworks Solutions, Inc.	51.014	4.843.779	0,08 %	Weyerhaeuser Co. REIT	211.108	7.443.668	0,12 %
Xilinx, Inc.	70.264	4.737.199	0,07 %	AvalonBay Communities, Inc. REIT	38.634	6.892.692	0,11 %
Harris Corp.	33.214	4.704.763	0,07 %	Welltower, Inc. REIT	103.577	6.605.105	0,10 %
KLA-Tencor Corp.	43.515	4.572.121	0,07 %	Equity Residential REIT	102.792	6.555.046	0,10 %
Global Payments, Inc.	44.342	4.444.842	0,07 %	Digital Realty Trust, Inc. REIT	57.536	6.553.350	0,10 %
NetApp, Inc.	74.896	4.143.247	0,06 %	Ventas, Inc. REIT	98.958	5.938.470	0,09 %
Motorola Solutions, Inc.	45.203	4.083.639	0,06 %	Boston Properties, Inc. REIT	42.881	5.575.816	0,09 %
Total System Services, Inc.	46.769	3.698.960	0,06 %	SBA Communications Corp. REIT Klasse A	32.917	5.377.321	0,08 %
Synopsys, Inc.	41.670	3.551.951	0,06 %	Realty Income Corp. REIT	78.522	4.477.324	0,07 %
Citrix Systems, Inc.	40.141	3.532.408	0,05 %	Essex Property Trust, Inc. REIT	18.485	4.461.724	0,07 %
ANSYS, Inc.	23.526	3.472.202	0,05 %	Host Hotels & Resorts, Inc. REIT	205.670	4.082.550	0,06 %
Alliance Data Systems Corp.	13.323	3.377.114	0,05 %	GGP, Inc. REIT	173.186	4.050.821	0,06 %
Seagate Technology plc	80.339	3.361.384	0,05 %	Vornado Realty Trust REIT	47.837	3.739.897	0,06 %
Cadence Design Systems, Inc.	78.176	3.269.320	0,05 %	CBRE Group, Inc. Klasse A	84.564	3.662.467	0,06 %
Gartner, Inc.	25.419	3.130.350	0,05 %	Alexandria Real Estate Equities, Inc. REIT	26.682	3.484.402	0,06 %
Akamai Technologies, Inc.	47.954	3.118.928	0,05 %	HCP, Inc. REIT	130.233	3.396.477	0,05 %
Juniper Networks, Inc.	105.616	3.010.056	0,05 %	Mid-America Apartment Communities, Inc. REIT	31.511	3.168.746	0,05 %
CA, Inc.	87.767	2.920.886	0,05 %	Extra Space Storage, Inc. REIT	35.116	3.070.894	0,05 %
VeriSign, Inc.	23.807	2.724.473	0,04 %	Iron Mountain, Inc. REIT	78.179	2.949.694	0,05 %
Western Union Co.	129.466	2.461.149	0,04 %	UDR, Inc. REIT	74.728	2.878.523	0,05 %
Qorvo, Inc.	35.592	2.370.427	0,04 %	Regency Centers Corp. REIT	41.279	2.855.681	0,05 %
Advanced Micro Devices, Inc.	229.771	2.362.046	0,04 %	SL Green Realty Corp. REIT	27.608	2.786.475	0,04 %
F5 Networks, Inc.	17.807	2.336.635	0,04 %	Duke Realty Corp. REIT	99.422	2.705.273	0,04 %
FLIR Systems, Inc.	38.174	1.779.672	0,03 %				
Xerox Corp.	59.935	1.747.105	0,03 %				
CSRA, Inc.	45.073	1.348.584	0,02 %				
		1.519.893.149	23,76 %				

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Federal Realty Investment Trust REIT	20.057	2.663.770	0,04 %	Xcel Energy, Inc.	142.007	6.831.957	0,11 %
Kimco Realty Corp. REIT	117.616	2.134.730	0,03 %	PG&E Corp.	143.481	6.432.253	0,10 %
Macerich Co. REIT	30.495	2.002.912	0,03 %	PPL Corp.	191.134	5.915.597	0,09 %
Apartment Investment & Management Co. REIT Klasse A	44.062	1.925.950	0,03 %	WEC Energy Group, Inc.	87.679	5.824.516	0,09 %
		184.311.992	2,88 %	Edison International	91.135	5.763.377	0,09 %
Telekommunikationsdienstleistungen 2,06 % (2016: 2,64 %)				Eversource Energy	88.047	5.562.809	0,09 %
AT&T, Inc.	1.715.713	66.706.922	1,04 %	DTE Energy Co.	49.796	5.450.670	0,09 %
Verizon Communications, Inc.	1.139.886	60.334.166	0,95 %	American Water Works Co., Inc.	50.003	4.574.775	0,07 %
CenturyLink, Inc.	270.081	4.504.951	0,07 %	Entergy Corp.	50.466	4.107.428	0,06 %
		131.546.039	2,06 %	Ameren Corp.	67.915	4.006.306	0,06 %
Versorger 2,93 % (2016: 3,16 %)				FirstEnergy Corp.	124.592	3.815.007	0,06 %
NextEra Energy, Inc.	131.543	20.545.701	0,32 %	CMS Energy Corp.	77.883	3.683.866	0,06 %
Duke Energy Corp.	195.692	16.459.654	0,26 %	CenterPoint Energy, Inc.	119.748	3.396.053	0,05 %
Dominion Energy, Inc.	179.895	14.582.289	0,23 %	Alliant Energy Corp.	64.525	2.749.410	0,04 %
Southern Co.	280.579	13.493.044	0,21 %	Pinnacle West Capital Corp.	31.152	2.653.527	0,04 %
Exelon Corp.	268.463	10.580.127	0,17 %	NiSource, Inc.	94.442	2.424.326	0,04 %
American Electric Power Co., Inc.	137.540	10.118.818	0,16 %	NRG Energy, Inc.	83.391	2.374.976	0,04 %
Sempra Energy	70.286	7.514.979	0,12 %	AES Corp.	182.438	1.975.804	0,03 %
Consolidated Edison, Inc.	86.802	7.373.830	0,12 %	SCANA Corp.	40.117	1.595.854	0,02 %
Public Service Enterprise Group, Inc.	141.537	7.289.156	0,11 %			187.096.109	2,93 %
				Summe Aktien		6.371.485.593	99,62 %
				Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		6.371.485.593	99,62 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures (0,00 %) (2016: (0,00 %))				
S&P 500 E-mini März 2018	142	19.066.530	(66.930)	(0,00 %)
			(66.930)	(0,00 %)

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte zu Absicherungszwecken auf Ebene der Anteilsklasse 0,01 % (2016: (0,03 %))							
EUR	204.765.678	USD	(244.658.127)	JP Morgan Chase	03.01.2018	1.224.542	0,02 %
EUR	6.765.751	USD	(7.985.007)	JP Morgan Chase	03.01.2018	139.308	0,00 %
EUR	8.151.411	USD	(9.738.271)	BNP Paribas	03.01.2018	49.945	0,00 %
EUR	184.636.870	USD	(222.089.536)	UBS	02.02.2018	44.437	0,00 %
EUR	1.663.468	USD	(1.972.673)	UBS	03.01.2018	24.819	0,00 %
EUR	1.853.462	USD	(2.206.269)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	19.369	0,00 %
EUR	753.416	USD	(887.882)	BNP Paribas	03.01.2018	16.820	0,00 %
EUR	94.311	USD	(111.458)	JP Morgan Chase	03.01.2018	1.791	0,00 %
EUR	5.727.840	USD	(6.890.019)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	1.064	0,00 %
USD	685.119	EUR	(570.552)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	—	0,00 %
USD	222.089.536	EUR	(184.951.312)	UBS	03.01.2018	(39)	(0,00 %)
USD	2.409.197	EUR	(2.027.522)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(25.452)	(0,00 %)
USD	2.509.965	EUR	(2.121.153)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(37.116)	(0,00 %)
USD	40.550.989	EUR	(34.376.956)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(728.868)	(0,01 %)
						730.620	0,01 %
Summe Derivative Finanzinstrumente						663.690	0,01 %

	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva	23.912.724	0,37 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)	6.396.062.007	100,00 %

REIT – Real Estate Investment Trust.

Analyse des Gesamtvermögens	US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	6.371.485.593	99,62 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	—	0,00 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente	663.690	0,01 %
(e) Sonstige Aktiva und Passiva	23.912.724	0,37 %
Gesamtnettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	6.396.062.007	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Anteile	Kosten US-Dollar (\$)		Anteile	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
Apple, Inc.	223.800	32.425.113	Apple, Inc.	281.700	42.088.458
Microsoft Corp.	345.000	23.982.018	Microsoft Corp.	365.800	25.460.303
Amazon.com, Inc.	20.040	18.914.646	Amazon.com, Inc.	18.680	17.632.501
Facebook, Inc. Klasse A	123.700	18.620.245	Facebook, Inc. Klasse A	112.600	17.157.997
Exxon Mobil Corp.	215.100	17.691.348	JPMorgan Chase & Co.	185.700	16.821.822
Berkshire Hathaway, Inc. Klasse B	94.764	16.298.045	Johnson & Johnson	131.100	16.736.548
Johnson & Johnson	120.300	15.192.647	Exxon Mobil Corp.	191.800	15.590.922
JPMorgan Chase & Co.	153.700	13.691.701	Berkshire Hathaway, Inc. Klasse B	88.464	15.197.335
Alphabet, Inc. Klasse C	15.100	13.674.237	Procter & Gamble Co.	153.263	13.840.874
Alphabet, Inc. Klasse A	14.439	13.287.169	Yahoo!, Inc.	262.310	13.575.385
AT&T, Inc.	283.921	11.302.001	Bank of America Corp.	546.200	13.270.278
Wells Fargo & Co.	194.900	10.751.286	Alphabet, Inc. Klasse A	14.029	12.851.349
General Electric Co.	390.400	10.723.292	Alphabet, Inc. Klasse C	13.830	12.407.072
Procter & Gamble Co.	116.263	10.349.786	General Electric Co.	443.200	12.139.404
Bank of America Corp.	428.200	10.322.097	Wells Fargo & Co.	221.800	12.010.909
Chevron Corp.	91.148	10.021.408	Citigroup, Inc.	178.800	11.501.945
Walt Disney Co.	89.800	9.542.674	AT&T, Inc.	287.121	11.251.448
Verizon Communications, Inc.	188.855	9.146.662	Home Depot, Inc.	68.500	10.629.833
Pfizer, Inc.	273.058	9.130.586	Pfizer, Inc.	306.058	10.445.623
UnitedHealth Group, Inc.	49.835	8.905.211	Chevron Corp.	88.848	9.693.364

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	6.371.485.593	5.399.350.043
Derivative Finanzinstrumente	1.522.095	110.234
Barmittel	7.491.197	6.928.461
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	4.827.253	5.131.021
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	11.056.023	13.587.861
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	4.544.874	62.727
Bareinschüsse für Futures	363.330	1.173.165
Barsicherheiten	390.000	—
Summe Umlaufvermögen	6.401.680.365	5.426.343.512
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	858.405	1.921.101
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	6.901	33.017
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	86	1.033.286
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	4.174.804	2.616.147
Zahlbare Verwaltungsgebühren	578.162	485.436
Summe kurzfristige Passiva	5.618.358	6.088.987
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	6.396.062.007	5.420.254.525

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	1.368.248.154	909.057.739	640.547.054
Nettovermögen	1.139.447.171	861.870.355	589.659.447
Anzahl der umlaufenden Anteile	45.864.109	36.870.396	28.882.261
Nettoinventarwert je Anteil	24,84	23,38	20,42
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	3.007.199.694	2.633.032.599	2.925.422.049
Anzahl der umlaufenden Anteile	100.825.289	106.817.310	131.937.295
Nettoinventarwert je Anteil	29,83	24,65	22,17
EUR-Anlegeranteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	95.241.440	50.203.483	43.509.090
Nettovermögen	79.314.991	47.597.520	40.052.555
Anzahl der umlaufenden Anteile	3.249.492	2.069.430	1.990.862
Nettoinventarwert je Anteil	24,41	23,00	20,12
USD-Anlegeranteile (\$)			
Nettovermögen	533.119.327	428.992.861	394.768.681
Anzahl der umlaufenden Anteile	18.191.713	17.685.876	18.066.066
Nettoinventarwert je Anteil	29,31	24,26	21,85
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	606.431.146	760.130.962	690.621.306
Nettovermögen	505.022.610	720.674.072	635.755.601
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.823.164	4.283.460	4.328.259
Nettoinventarwert je Anteil	178,89	168,25	146,88
Institutionelle Plus USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	556.733.914	400.843.545	450.516.015
Anzahl der umlaufenden Anteile	3.557.080	3.100.078	3.875.029
Nettoinventarwert je Anteil	156,51	129,30	116,26
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR (€)			
Gegenwert in US (\$)	229.088.332	237.993.336	289.229.812
Nettovermögen	190.779.758	225.639.574	266.252.244
Anzahl der umlaufenden Anteile	9.314.432	13.077.363	16.918.889
Nettoinventarwert je Anteil	20,48	17,25	15,74

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	128.185	54.955
Dividenden	121.851.075	120.261.684
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	41.327	98.069
Verschiedene Erträge	886.267	174.319
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	1.074.532.399	470.625.634
Summe Anlageerträge/(-verluste)	1.197.439.253	591.214.661
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	6.300.154	5.528.336
Transaktionsgebühren und Provisionen	108.999	85.086
Sonstige Aufwendungen	95	(32.840)
Summe Aufwendungen	6.409.248	5.580.582
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	11.859	8.077
Summe Finanzierungskosten	11.859	8.077
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1.191.018.146	585.626.002
Ausländische Quellensteuer	(35.980.983)	(33.504.392)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	1.155.037.163	552.121.610

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer
gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	1.155.037.163	552.121.610
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	2.158.797.826	1.661.235.449
Rücknahmen	(2.338.027.507)	(2.227.716.541)
Summe Kapitalgeschäfte	(179.229.681)	(566.481.092)
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	975.807.482	(14.359.482)
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	5.420.254.525	5.434.614.007
Zum Jahresende	6.396.062.007	5.420.254.525

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

U.S. Discoveries Fund

Der Vanguard U.S. Discoveries Fund wurde im Laufe des Jahres vollständig zurückgenommen.

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Anteile	Kosten US-Dollar (\$)		Anteile	Erlöse US-Dollar (\$)
Summe Käufe¹			Verkäufe		
Tennant Co.	23.200	1.569.156	Exact Sciences Corp.	258.100	5.686.170
Sangamo Therapeutics, Inc.	411.500	1.438.709	Brooks Automation, Inc.	259.570	5.506.381
NN, Inc.	67.697	1.297.854	Tennant Co.	72.679	5.128.088
Qualys, Inc.	32.400	1.098.082	Nektar Therapeutics Klasse A	237.894	5.000.944
Kinsale Capital Group, Inc.	28.900	896.735	NeoGenomics, Inc.	634.750	4.944.961
Nektar Therapeutics Klasse A	51.500	683.101	Rush Enterprises, Inc. Klasse A	142.118	4.647.545
Lawson Products, Inc.	23.600	636.896	Kaman Corp.	92.770	4.448.254
STAG Industrial, Inc. REIT	18.700	445.291	Cardiovascular Systems, Inc.	143.600	4.024.501
Aerohive Networks, Inc.	97.386	425.848	SodaStream International Ltd.	81.950	4.015.820
TASER International, Inc.	7.900	197.645	Albany International Corp. Klasse A	86.520	3.933.784
			Zeltiq Aesthetics, Inc.	71.416	3.924.592
			Lawson Products, Inc.	180.949	3.802.580
			Invacare Corp.	338.400	3.794.874
			TASER International, Inc.	161.400	3.759.200
			Douglas Dynamics, Inc.	122.388	3.743.203
			Modine Manufacturing Co.	312.690	3.509.295
			Inogen, Inc.	48.200	3.479.261
			Titan Machinery, Inc.	236.964	3.437.854
			STAG Industrial, Inc. REIT	132.877	3.329.894
			CONMED Corp.	70.100	3.016.139
			Rudolph Technologies, Inc.	135.799	2.957.571
			Supernus Pharmaceuticals, Inc.	100.300	2.949.370
			Calavo Growers, Inc.	48.736	2.916.336
			RBC Bearings, Inc.	30.331	2.880.419
			Hudson Technologies, Inc.	412.492	2.848.354
			Power Integrations, Inc.	43.557	2.825.739
			Sotherly Hotels, Inc. REIT	437.900	2.644.027
			Qualys, Inc.	72.744	2.643.104
			Enanta Pharmaceuticals, Inc.	88.400	2.640.173
			Nimble Storage, Inc.	207.700	2.472.031
			Quaker Chemical Corp.	16.900	2.324.971
			CEVA, Inc.	65.800	2.306.563
			Safeguard Scientifics, Inc.	183.049	2.283.703
			Gigamon, Inc.	62.900	2.198.090
			Paratek Pharmaceuticals, Inc.	109.955	2.184.171
			PROS Holdings, Inc.	94.100	2.169.683
			Harvard Bioscience, Inc.	843.953	2.104.083
			Sangamo Therapeutics, Inc.	475.400	2.064.776
			Ensign Group, Inc.	108.600	1.990.992
			Cutera, Inc.	101.818	1.985.855
			Accelaron Pharma, Inc.	71.995	1.910.282
			Pacira Pharmaceuticals, Inc.	39.200	1.796.889
			Care.com, Inc.	157.161	1.773.925
			Kinsale Capital Group, Inc.	55.990	1.762.590
			Viveve Medical, Inc.	297.400	1.699.246
			Perficient, Inc.	97.100	1.681.496
			NN, Inc.	67.697	1.681.375
			Aerohive Networks, Inc.	382.186	1.611.029

¹ Während des Berichtsjahres wurden nur zehn Käufe getätigt.

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017*	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	—	147.386.949
Barmittel	1.699	12.979.146
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenkassageschäften	—	706
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	—	76.369
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	—	44.327
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	—	496.997
Summe Umlaufvermögen	1.699	160.984.494
Kurzfristige Passiva		
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	—	384.289
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	—	826.619
Zahlbare Verwaltungsgebühren	21	114.512
Sonstige Verbindlichkeiten	1.678	—
Summe kurzfristige Passiva	1.699	1.325.420
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	—	159.659.074

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
GBP-Anlegeranteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	—	32.416.749	33.313.505
Nettovermögen	—	26.234.573	22.602.283
Anzahl der umlaufenden Anteile	—	93.749	111.267
Nettoinventarwert je Anteil	—	279,84	203,14
USD-Anlegeranteile (\$)			
Nettovermögen	—	127.242.325	104.781.963
Anzahl der umlaufenden Anteile	—	366.453	348.515
Nettoinventarwert je Anteil	—	347,23	300,65

* Portfolio aufgelöst am 23. Mai 2017.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017*	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	69.119	25.822
Dividenden	201.329	748.521
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	593	59.484
Verschiedene Erträge	—	206
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	6.812.475	15.105.935
Summe Anlageerträge/(-verluste)	7.083.516	15.939.968
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	368.614	989.708
Transaktionsgebühren und Provisionen	201.032	292.473
Sonstige Aufwendungen	1.678	—
Summe Aufwendungen	571.324	1.282.181
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	12.938	—
Ertragsausgleich	—	(1.389)
Summe Finanzierungskosten	12.938	(1.389)
Nettoanlageerträge/(-verluste)	6.499.254	14.659.176
Ausländische Quellensteuer	(470.42)	(203.370)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)	6.452.212	14.455.806

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017*	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	6.452.212	14.455.806
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	8.549.679	54.910.909
Rücknahmen	(174.660.965)	(47.803.109)
Summe Kapitalgeschäfte ¹	(166.111.286)	7.107.800
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	(159.659.074)	21.563.606
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)		
Zu Jahresbeginn	159.659.074	138.095.468
Zum Jahresende	—	159.659.074

* Portfolio aufgelöst am 23. Mai 2017.

¹ Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen. Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

U.S. Fundamental Value Fund

Unterverwaltet durch Pzena Investment Management, LLC.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Anlageziel

Der Fonds strebt ein langfristiges Kapitalwachstum vorwiegend durch Investitionen in grosse Unternehmen an, deren Aktien als unterbewertet gelten.

Portfoliomerkmale

	Fonds	Russell 1000 Value Index
Anzahl der Aktien	38	713
Mittlere Marktkapitalisierung		
US-Dollar	\$ 42,6 Mrd.	\$ 65,6 Mrd.
Britisches Pfund	£ 31,5 Mrd.	£ 48,5 Mrd.
Kurs/Gewinn-Verhältnis	16,2x	19,8x
Kurs/Buch-Verhältnis	1,5x	2,1x
Rendite	2,0 %	2,3 %
Eigenkapitalrendite	9,6 %	11,5 %
Ertragszuwachsrate	1,9 %	6,5 %
Portfolioumschlag ¹	-10 %	—
Ausgewiesene laufende Kosten – Anlegeranteile	0,95 %	—
Kurzfristige Reserven	5,4 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	Russell 1000 Value Index
R ²	0,87	1,00
Beta	1,35	1,00

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds	Russell 1000 Value Index
Luxusgüter	11,9 %	6,8 %
Grundbedarfsgüter	3,2	8,6
Energie	13,7	11,0
Finanzwerte	43,1	26,6
Gesundheitswesen	9,7	13,5
Industriegüter	4,3	8,4
Informationstechnologie	14,1	8,5
Grundstoffe	0,0	3,0
Immobilien	0,0	4,7
Telekommunikationsdienste	0,0	3,0
Versorger	0,0	5,9

Die 10 grössten Positionen² (% des Gesamt Nettovermögens)

Citigroup Inc.	Diversifizierte Banken	3,9 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	Software- und Computerdienstleistungen	3,9
Mylan NV	Pharmazeutik und Biotechnologie	3,9
Bank of America Corp.	Diversifizierte Banken	3,6
Oracle Corp.	Systemsoftware	3,5
Royal Dutch Shell plc	Integrierter Öl- und Gaskonzern	3,3
Voya Financial Inc.	Vermögensverwalter	3,2
Goldman Sachs Group Inc.	Investmentbanking und Makler	3,1
Cognizant Technology Solutions Corp.	Computerdienstleistungen	3,1
Dover Corp.	Industriemaschinen	3,1
Zehn grösste Positionen		34,6 %

Anlagefokus

Stil	Wert	Mischung	Wachstum
Marktkapitalisierung	Gross		
	Mittel		
	Klein		

¹ Ein negativer Portfolioumschlag deutet darauf hin, dass der Gesamtwert der Zeichnungen und Rückkäufe über dem Wert der Wertpapiertransaktionen gelegen hat.

² Die aufgeführten Positionen schliessen etwaige vorübergehende Baranlagen und Aktienindexprodukte aus.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

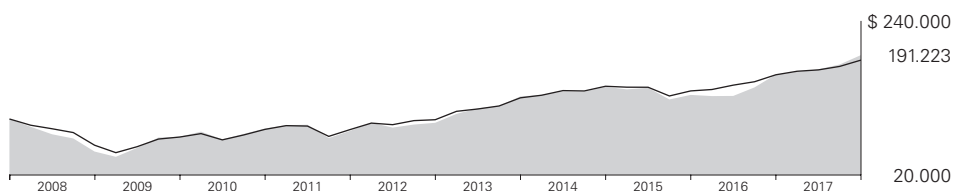
Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen. Der Fonds wird aktiv verwaltet und strebt eine Anlage gemäss der Beschreibung im Prospekt an. Die folgenden Performanceangaben zeigen den Vergleich der Rendite des Fonds mit der Rendite eines Marktindex, dessen Anlagemerkmale mit denen des Fonds vergleichbar sind.

U.S. Fundamental Value Fund
Benchmark: Russell 1000 Value Index

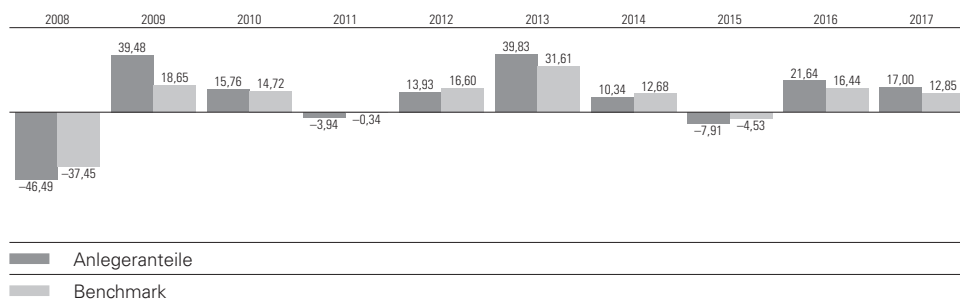
In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. \$ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
■ Anlegeranteile	17,00 %	15,12 %	6,70 %	\$ 191.223
— Benchmark	12,85	13,22	6,29	184.053

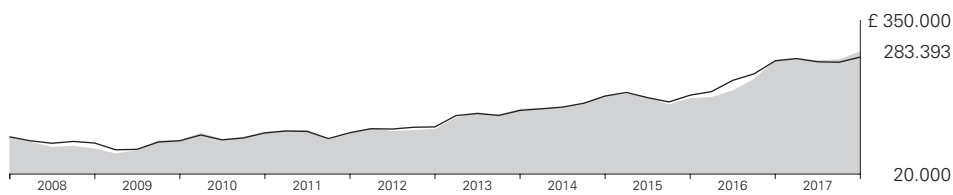
Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



U.S. Fundamental Value Fund
 Benchmark: Russell 1000 Value Index

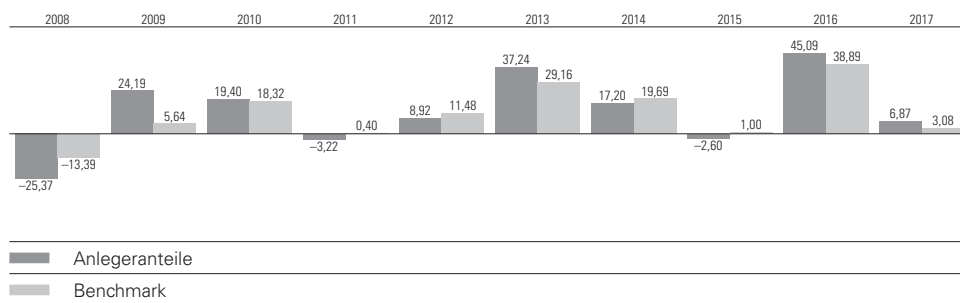
In GBP

Kumulative Wertentwicklung: 30. Juni 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
■ Anlegeranteile	6,87 %	19,43 %	10,98 %	£ 283.393
— Benchmark	3,08	17,45	10,48	270.838

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Aktien 94,59 % (2016: 99,52 %)			
Zyklische Konsumgüter 11,30 % (2016: 12,71 %)			
Interpublic Group of Cos, Inc.	52.307	1.054.509	3,00 %
Ford Motor Co.	83.783	1.046.449	2,97 %
Omnicom Group, Inc.	14.284	1.040.304	2,95 %
News Corp. Klasse A	30.699	497.631	1,41 %
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	4.251	339.485	0,97 %
		3.978.378	11,30 %
Nicht-zyklische Konsumgüter 3,05 % (2016: 2,71 %)			
Wal-Mart Stores, Inc.	10.877	1.074.104	3,05 %
		1.074.104	3,05 %
Energie 12,96 % (2016: 15,00 %)			
Royal Dutch Shell plc ADR Klasse A	17.184	1.146.345	3,25 %
Halliburton Co.	16.199	791.645	2,25 %
Cenovus Energy, Inc.	81.972	748.404	2,13 %
BP plc ADR	15.337	644.614	1,83 %
Exxon Mobil Corp.	7.660	640.682	1,82 %
Murphy Oil Corp.	19.072	592.186	1,68 %
		4.563.876	12,96 %
Finanztitel 40,80 % (2016: 42,01 %)			
Citigroup, Inc.	18.609	1.384.696	3,93 %
Bank of America Corp.	42.644	1.258.851	3,57 %
Voya Financial, Inc.	22.774	1.126.630	3,20 %
Goldman Sachs Group, Inc.	4.351	1.108.461	3,15 %
Wells Fargo & Co.	17.594	1.067.428	3,03 %
Capital One Financial Corp.	10.633	1.058.834	3,01 %
Morgan Stanley	20.011	1.049.977	2,98 %
Franklin Resources, Inc.	23.225	1.006.339	2,86 %
American International Group, Inc.	16.439	979.436	2,78 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
JPMorgan Chase & Co.	8.807	941.820	2,67 %
MetLife, Inc.	17.280	873.677	2,48 %
State Street Corp.	8.824	861.311	2,44 %
UBS Group AG	46.497	855.080	2,43 %
Axis Capital Holdings Ltd.	14.203	713.843	2,03 %
Brighthouse Financial Inc.	1.440	84.441	0,24 %
		14.370.824	40,80 %
Gesundheitswesen 9,13 % (2016: 4,66 %)			
Mylan NV	32.394	1.370.590	3,89 %
McKesson Corp.	6.639	1.035.352	2,94 %
Express Scripts Holding Co.	10.848	809.695	2,30 %
		3.215.637	9,13 %
Industrie 4,03 % (2016: 7,60 %)			
Dover Corp.	10.690	1.079.583	3,07 %
Parker-Hannifin Corp.	1.696	338.488	0,96 %
		1.418.071	4,03 %
Informationstechnologie 13,32 % (2016: 14,83 %)			
Hewlett Packard Enterprise Co.	95.849	1.376.392	3,91 %
Oracle Corp.	26.111	1.234.528	3,51 %
Cognizant Technology Solutions Corp. Klasse A	15.544	1.103.935	3,13 %
Micro Focus International plc ADR	10.643	357.498	1,01 %
HP, Inc.	16.599	348.745	0,99 %
Seagate Technology plc	6.480	271.123	0,77 %
		4.692.221	13,32 %
Summe Aktien		33.313.111	94,59 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		33.313.111	94,59 %

	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- vermögens
Sonstige Aktiva und Passiva	1.905.848	5,41 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	35.218.959	100,00 %

ADR – American Depositary Receipt.

Analyse des Gesamtvermögens	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	33.313.111	94,59 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	—	0,00 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente	—	0,00 %
(e) Sonstige Aktiva und Passiva	1.905.848	5,41 %
Gesamtvermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	35.218.959	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Anteile	Kosten US-Dollar (\$)		Anteile	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
Mylan NV	35.452	1.325.665	Cigna Corp.	6.025	1.056.793
Hewlett Packard Enterprise Co.	63.074	1.010.973	Intel Corp.	22.625	783.897
McKesson Corp.	6.875	1.001.077	Stanley Black & Decker, Inc.	5.300	759.473
Wells Fargo & Co.	17.594	945.878	Regions Financial Corp.	52.925	745.794
Interpublic Group of Cos, Inc.	32.832	679.705	Abbott Laboratories	15.975	671.331
Halliburton Co.	16.199	673.767	Staples, Inc.	66.125	668.002
Express Scripts Holding Co.	10.848	663.688	Halliburton Co.	11.250	625.148
Omnicom Group, Inc.	5.409	421.825	Parker-Hannifin Corp.	3.729	580.346
Exxon Mobil Corp.	4.959	408.357	Exxon Mobil Corp.	5.953	474.137
Oracle Corp.	6.380	309.101	Hilton Worldwide Holdings, Inc.	6.473	470.017
American International Group, Inc.	4.382	276.168	Corning, Inc.	13.531	404.570
Ford Motor Co.	24.208	271.363	Royal Dutch Shell plc ADR Klasse A	5.007	303.102
Cenovus Energy, Inc.	27.422	257.496	HP, Inc.	14.449	301.190
MetLife, Inc.	4.123	202.714	Seagate Technology plc	5.343	235.864
Capital One Financial Corp.	1.409	122.107	DXC Technology Co.	2.815	220.806
Axis Capital Holdings Ltd.	1.978	98.943	Oracle Corp.	4.757	218.624
Cognizant Technology Solutions Corp. Klasse A	1.289	76.730	Bank of America Corp.	8.672	214.485
BP plc ADR	2.042	71.572	Morgan Stanley	4.286	206.144
Morgan Stanley	997	52.473	News Corp. Klasse A	12.941	185.921
Goldman Sachs Group, Inc.	226	50.513	Park Hotels & Resorts, Inc.	6.600	175.840
			Voya Financial, Inc.	4.101	170.160
			Dover Corp.	1.885	166.962
			State Street Corp.	1.701	160.319
			Capital One Financial Corp.	1.503	143.845
			MetLife, Inc.	2.693	142.699
			BP plc ADR	3.105	123.890
			Mylan NV	3.058	115.333

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	33.313.111	30.234.643
Barmittel	2.046.782	167.173
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	34.553	42.173
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	30.127	449.580
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	—	2.533.327
Summe Umlaufvermögen	35.424.573	33.426.896
Kurzfristige Passiva		
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	—	4.693
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Zahlbare Dividenden	16.296	21.547
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	162.687	2.994.409
Zahlbare Verwaltungsgebühren	26.631	27.249
Summe kurzfristige Passiva	205.614	3.047.898
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken) („Nettovermögen“)	35.218.959	30.378.998

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
GBP-Anlegeranteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	1.987.844	1.846.728	1.053.093
Nettovermögen	1.469.484	1.494.540	714.494
Anzahl der umlaufenden Anteile	10.159	10.954	7.510
Nettoinventarwert je Anteil	144,65	136,44	95,13
USD-Anlegeranteile (\$)			
Nettovermögen	33.231.115	28.532.270	27.216.643
Anzahl der umlaufenden Anteile	151.359	152.067	176.443
Nettoinventarwert je Anteil	219,55	187,63	154,25

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	3.658	1.330
Dividenden	729.904	844.215
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	11.631	2.456
Verschiedene Erträge	32.540	1.499
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	4.621.573	5.890.101
Summe Anlageerträge/(-verluste)	5.399.306	6.739.601
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	298.987	283.881
Transaktionsgebühren und Provisionen	17.512	22.248
Sonstige Aufwendungen	246	351
Summe Aufwendungen	316.745	306.480
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	—	2
Ausgezahlte Ausschüttungen	16.296	21.547
Ertragsausgleich	(133)	(4.691)
Summe Finanzierungskosten	16.163	16.858
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5.066.398	6.416.263
Ausländische Quellensteuer	(164.010)	(176.871)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	4.902.388	6.239.392

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	4.902.388	6.239.392
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	11.426.225	11.862.585
Rücknahmen	(11.488.652)	(15.992.715)
Summe Kapitalgeschäfte ¹	(62.427)	(4.130.130)
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	4.839.961	2.109.262
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	30.378.998	28.269.736
Zum Jahresende	35.218.959	30.378.998

¹ Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

U.S. Opportunities Fund

Unterverwaltet durch PRIMECAP Management Company.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Anlageziel

Der Fonds strebt durch Investitionen in Aktien mit einem überdurchschnittlichen Ertragswachstumspotenzial, das sich nicht in ihren aktuellen Marktkursen widerspiegelt, ein langfristiges Kapitalwachstum an.

Portfoliomerkmale

	Fonds	Russell 3000 Index
Anzahl der Aktien	212	2.957
Mittlere Marktkapitalisierung		
US-Dollar	\$ 20,0 Mrd.	\$ 67,4 Mrd.
Euro	€ 16,6 Mrd.	€ 56,1 Mrd.
Britisches Pfund	£ 14,8 Mrd.	£ 49,8 Mrd.
Kurs/Gewinn-Verhältnis	21,3x	22,9x
Kurs/Buch-Verhältnis	3,7x	3,0x
Rendite	0,7 %	1,7 %
Eigenkapitalrendite	13,4 %	15,1 %
Ertragszuwachsrate	19,3 %	9,9 %
Nicht-US-Positionen	5,7 %	—
Portfolioumschlag ¹	-19 %	—
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,85 %	
Anlegeranteile	0,95 %	
Kurzfristige Reserven	2,1 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	Russell 3000 Index
R ²	0,77	1,00
Beta	1,13	1,00

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds	Russell 3000 Index
Luxusgüter	11,7 %	12,5 %
Grundbedarfsgüter	0,9	7,3
Energie	0,4	5,8
Finanzwerte	7,0	15,1
Gesundheitswesen	29,7	13,3
Industriegüter	18,3	10,9
Informationstechnologie	30,2	22,8
Grundstoffe	0,7	3,5
Sonstige	0,2	0,0
Immobilien	0,1	3,9
Telekommunikationsdienste	0,8	1,9
Versorger	0,0	3,0

Die 10 grössten Positionen² (% des Gesamt Nettovermögens)

Nektar Therapeutics	Biotechnologie	4,6 %
ABIOMED Inc.	Medizingeräte	3,5
Southwest Airlines Co.	Fluggesellschaften	3,4
Eli Lilly & Co.	Pharma	2,9
Seattle Genetics Inc.	Biotechnologie	2,5
Alphabet Inc.	Internetsoftware und -dienste	2,5
Alibaba Group Holding Ltd.	Internet	2,3
Delta Air Lines Inc.	Fluggesellschaften	2,2
Mircon Technology Inc.	Halbleiter	1,9
Flex Ltd.	Elektronikgeräte	1,8
Zehn grösste Positionen		27,6 %

Anlagefokus

Stil		Wert	Mischung	Wachstum
Marktkapitalisierung	Gross			
	Mittel			
	Klein			

1 Ein negativer Portfolioumschlag deutet darauf hin, dass der Gesamtwert der Zeichnungen und Rückkäufe über dem Wert der Wertpapiertransaktionen gelegen hat.

2 Die aufgeführten Positionen schliessen etwaige vorübergehende Baranlagen und Aktienindexprodukte aus.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

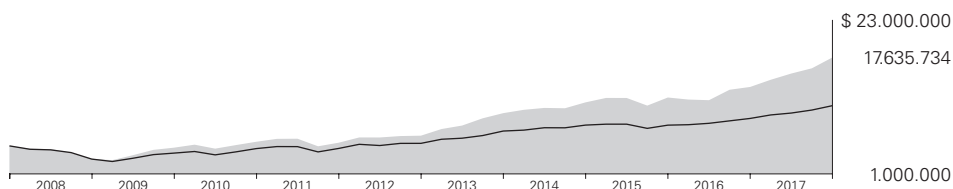
Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen. Der Fonds wird aktiv verwaltet und strebt eine Anlage gemäss der Beschreibung im Prospekt an. Die folgenden Performanceangaben zeigen den Vergleich der Rendite des Fonds mit der Rendite eines Marktindex, dessen Anlagemerkmale mit denen des Fonds vergleichbar sind.

U.S. Opportunities Fund
Benchmark: Russell 3000 Index

In US-Dollar

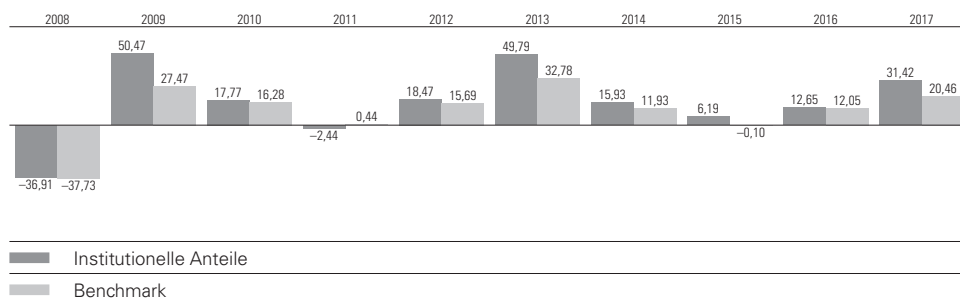
Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
■ Institutionelle Anteile	31,42 %	22,24 %	13,43 %	\$ 17.635.734
— Benchmark	20,46	14,92	7,95	10.747.790

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Anlegeranteile	31,29 %	22,12 %	13,32 %	\$ 349.251
Benchmark	20,46	14,92	7,95	214.956

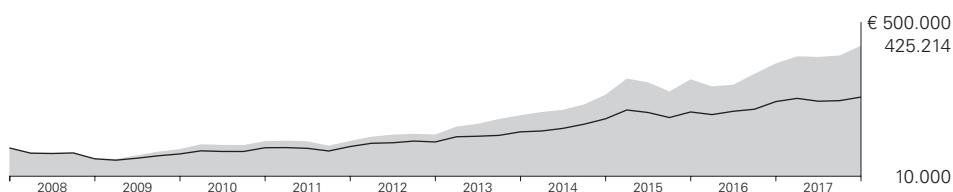
Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



U.S. Opportunities Fund
 Benchmark: Russell 3000 Index

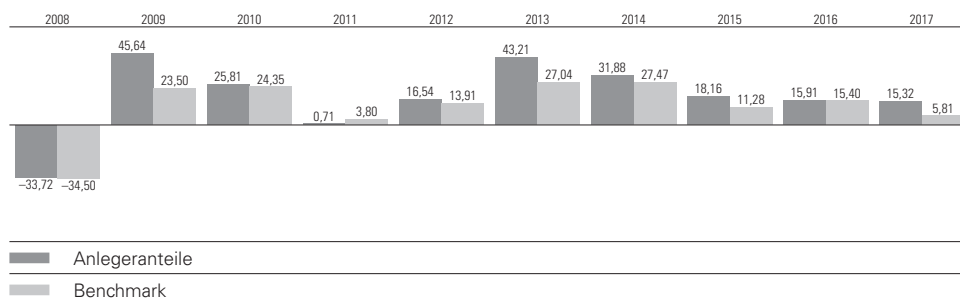
In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. € 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
■ Anlegeranteile	15,32 %	24,43 %	15,57 %	€ 425.214
— Benchmark	5,81	17,09	10,10	261.722

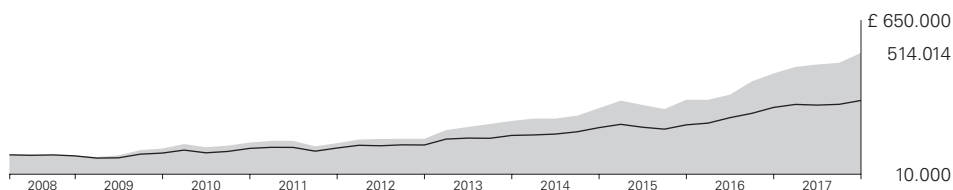
Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



U.S. Opportunities Fund
 Benchmark: Russell 3000 Index

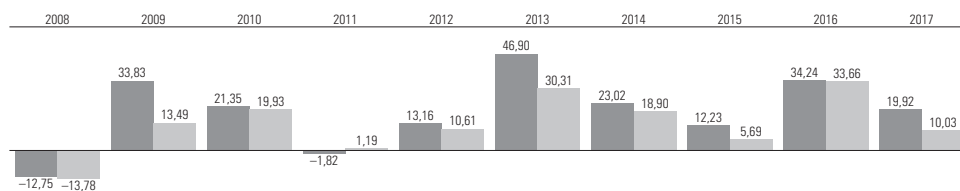
In GBP

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenden Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
■ Anlegeranteile	19,92 %	26,70 %	17,79 %	£ 514.014
— Benchmark	10,03	19,22	12,20	316.312

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



■	Anlegeranteile
■	Benchmark

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamtnetto- vermögens
Aktien 97,85 % (2016: 95,97 %)				Finanztitel 6,87 % (2016: 6,73 %)			
Zyklische Konsumgüter 11,48 % (2016: 12,38 %)				Gesundheitswesen 29,25 % (2016: 25,73 %)			
Chegg, Inc.	2.214.490	36.140.477	1,40 %	Charles Schwab Corp.	757.400	38.907.638	1,50 %
Carnival Corp.	470.500	31.227.085	1,21 %	E*TRADE Financial Corp.	561.000	27.808.770	1,07 %
Royal Caribbean Cruises Ltd.	245.700	29.307.096	1,13 %	Discover Financial Services	230.949	17.764.597	0,69 %
L Brands, Inc.	459.146	27.649.772	1,07 %	JPMorgan Chase & Co.	155.500	16.629.170	0,64 %
CarMax, Inc.	411.400	26.383.082	1,02 %	MarketAxess Holdings, Inc.	72.200	14.566.350	0,56 %
Tesla, Inc.	67.634	21.057.846	0,81 %	CME Group, Inc. Klasse A	73.800	10.778.490	0,42 %
Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	343.000	18.264.750	0,71 %	Marsh & McLennan Cos, Inc.	111.800	9.099.402	0,35 %
IMAX Corp.	759.000	17.570.850	0,68 %	Wells Fargo & Co.	147.925	8.974.610	0,35 %
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	218.666	17.462.667	0,67 %	Northern Trust Corp.	80.656	8.056.728	0,31 %
Shutterfly, Inc.	233.755	11.629.311	0,45 %	Bank of America Corp.	236.598	6.984.373	0,27 %
Tribune Media Co. Klasse A	166.700	7.079.749	0,27 %	US Bancorp	70.150	3.758.637	0,15 %
Ross Stores, Inc.	86.900	6.973.725	0,27 %	Travelers Cos, Inc.	27.000	3.662.280	0,14 %
CBS Corp. Klasse B	97.548	5.755.332	0,22 %	Progressive Corp.	64.000	3.604.480	0,14 %
Marriott International, Inc. Klasse A	37.000	5.022.010	0,19 %	CNA Financial Corp.	60.500	3.209.525	0,12 %
Newell Brands Inc.	148.960	4.602.864	0,18 %	American Express Co.	18.800	1.867.028	0,07 %
TJX Cos, Inc.	59.000	4.511.140	0,17 %	Comerica, Inc.	18.500	1.605.985	0,06 %
Comcast Corp. Klasse A	72.200	2.891.610	0,11 %	Chubb Ltd.	3.009	439.705	0,02 %
Roku, Inc. Klasse A	55.500	2.873.790	0,11 %	NMI Holdings, Inc. Klasse A	10.000	170.000	0,01 %
tronc, Inc.	152.500	2.682.475	0,10 %			177.887.768	6,87 %
MGM Resorts International	75.000	2.504.250	0,10 %	Gesundheitswesen 29,25 % (2016: 25,73 %)			
Habit Restaurants, Inc. Klasse A	230.000	2.196.500	0,09 %	Nektar Therapeutics Klasse A	2.008.736	119.961.714	4,63 %
Whirlpool Corp.	11.500	1.939.360	0,08 %	ABIOMED, Inc.	487.717	91.403.043	3,53 %
DHX Media Ltd. Klasse A	530.000	1.903.508	0,07 %	Eli Lilly & Co.	876.400	74.020.744	2,86 %
Tuesday Morning Corp.	610.000	1.677.500	0,06 %	Seattle Genetics, Inc.	1.223.900	65.478.650	2,53 %
iRobot Corp.	21.000	1.610.700	0,06 %	Alkermes plc	702.300	38.436.879	1,48 %
Hilton Grand Vacations, Inc.	34.760	1.458.182	0,06 %	Biogen, Inc.	111.400	35.488.698	1,37 %
Entercom Communications Corp. Klasse A	96.869	1.046.185	0,04 %	Xencor, Inc.	1.455.025	31.894.148	1,23 %
Restaurant Brands International, Inc.	15.000	922.200	0,04 %	Amgen, Inc.	180.500	31.388.950	1,21 %
Signet Jewelers Ltd.	10.000	565.500	0,02 %	BioMarin Pharmaceutical, Inc.	302.200	26.947.174	1,04 %
Lions Gate Entertainment Corp. Klasse B	17.500	555.450	0,02 %	Exact Sciences Corp.	511.200	26.858.448	1,04 %
Tempur Sealy International, Inc.	8.500	532.865	0,02 %	Insulet Corp.	374.195	25.819.455	1,00 %
Lions Gate Entertainment Corp. Klasse A	15.000	507.150	0,02 %	QIAGEN NV	699.971	21.650.103	0,84 %
Netflix, Inc.	2.400	460.704	0,02 %	Thermo Fisher Scientific, Inc.	69.300	13.158.684	0,51 %
Adient plc	3.820	300.634	0,01 %	Abbott Laboratories	215.900	12.321.413	0,48 %
		297.266.319	11,48 %	PerkinElmer, Inc.	157.600	11.523.712	0,45 %
Nicht-zyklische Konsumgüter 0,92 % (2016: 0,76 %)				Fluidigm Corp.	1.925.111	11.338.904	0,44 %
Constellation Brands, Inc. Klasse A	25.500	5.828.535	0,22 %	AstraZeneca plc ADR	325.600	11.298.320	0,44 %
Tyson Foods, Inc. Klasse A	70.000	5.674.900	0,22 %	Roche Holding AG	372.17	9.414.049	0,36 %
CVS Health Corp.	62.988	4.566.630	0,18 %	NuVasive, Inc.	145.200	8.492.748	0,33 %
Blue Buffalo Pet Products, Inc.	99.400	3.259.326	0,13 %	Illumina, Inc.	34.300	7.494.207	0,29 %
Calavo Growers, Inc.	31.000	2.616.400	0,10 %	Abaxis, Inc.	151.000	7.477.520	0,29 %
Altria Group, Inc.	10.480	748.377	0,03 %	OncoMed Pharmaceuticals, Inc.	1.800.000	7.380.000	0,28 %
Philip Morris International, Inc.	6.600	697.290	0,03 %	Epizyme, Inc.	524.500	6.582.475	0,25 %
Performance Food Group Co.	8.500	281.350	0,01 %	Medtronic plc	76.900	6.209.675	0,24 %
		23.672.808	0,92 %	Dyax Corp.	2.813.140	5.626.280	0,22 %
Energie 0,34 % (2016: 0,64 %)				Bristol-Myers Squibb Co.	89.600	5.490.688	0,21 %
Cabot Oil & Gas Corp.	168.000	4.804.800	0,19 %	Momenta Pharmaceuticals, Inc.	368.317	5.138.022	0,20 %
Transocean Ltd.	293.600	3.135.648	0,12 %	Spectrum Pharmaceuticals, Inc.	262.800	4.980.060	0,19 %
Pioneer Natural Resources Co.	2.600	449.410	0,02 %	BeiGene Ltd. ADR	45.658	4.461.700	0,17 %
EOG Resources, Inc.	2.600	280.566	0,01 %	Accuray, Inc.	890.000	3.827.000	0,15 %
Rex Energy Corp.	26.400	36.696	0,00 %	Penumbra, Inc.	38.950	3.665.195	0,14 %
		8.707.120	0,34 %	Boston Scientific Corp.	144.700	3.587.113	0,14 %
				Bioerativ, Inc.	55.650	3.000.648	0,12 %
				Charles River Laboratories International, Inc.	24.300	2.659.635	0,10 %
				OraSure Technologies, Inc.	122.600	2.312.236	0,09 %
				Axovant Sciences Ltd.	295.300	1.556.231	0,06 %
				Agilent Technologies, Inc.	22.000	1.473.340	0,06 %
				ImmunoGen, Inc.	200.000	1.282.000	0,05 %
				Zimmer Biomet Holdings, Inc.	10.000	1.206.700	0,05 %

	Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens		Anzahl der Anteile	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt Netto- vermögens
Flex Pharma, Inc.	333.483	1.163.856	0,04 %	Visa, Inc. Klasse A	158.000	18.015.160	0,70 %
Prestige Brands Holdings, Inc.	26.000	1.154.660	0,04 %	Texas Instruments, Inc.	169.400	17.692.136	0,68 %
Novartis AG ADR	13.000	1.091.480	0,04 %	Corning, Inc.	519.000	16.602.810	0,64 %
Waters Corp.	3.750	724.462	0,03 %	Ellie Mae, Inc.	180.050	16.096.470	0,62 %
Glaukos Corp.	23.000	589.950	0,02 %	Hewlett Packard Enterprise Co.	1.038.453	14.912.185	0,58 %
Pfenex, Inc.	59.300	157.738	0,01 %	Trimble, Inc.	354.600	14.410.944	0,56 %
Adverum Biotechnologies, Inc.	31.300	109.550	0,00 %	HP, Inc.	670.450	14.086.155	0,54 %
Dextera Surgical, Inc.	69.800	3.350	0,00 %	ServiceSource International, Inc.	4.465.533	13.798.497	0,53 %
		757.301.607	29,25 %	FARO Technologies, Inc.	277.178	13.027.366	0,50 %
Industrie 17,93 % (2016: 18,19 %)				Telefonaktiebolaget LM Ericsson ADR	1.863.500	12.448.180	0,48 %
Southwest Airlines Co.	1.363.850	89.263.983	3,45 %	Cree, Inc.	328.600	12.204.204	0,47 %
Delta Air Lines, Inc.	1.031.400	57.758.400	2,23 %	Apple, Inc.	70.000	11.846.100	0,46 %
FedEx Corp.	167.000	41.673.180	1,61 %	Axcelis Technologies, Inc.	398.700	11.442.690	0,44 %
United Continental Holdings, Inc.	602.220	40.589.628	1,57 %	Altaba, Inc.	145.550	10.166.667	0,39 %
American Airlines Group, Inc.	718.100	37.362.743	1,44 %	Nuance Communications, Inc.	593.400	9.702.090	0,37 %
JetBlue Airways Corp.	1.583.750	35.380.975	1,37 %	QUALCOMM, Inc.	150.100	9.609.402	0,37 %
Curtiss-Wright Corp.	163.500	19.922.475	0,77 %	Nutanix, Inc. Klasse A	240.150	8.472.492	0,33 %
Jacobs Engineering Group, Inc.	290.900	19.187.764	0,74 %	Activision Blizzard, Inc.	133.000	8.421.560	0,32 %
Honeywell International, Inc.	71.000	10.888.560	0,42 %	Splunk, Inc.	99.300	8.226.012	0,32 %
NN, Inc.	380.000	10.488.000	0,40 %	Altair Engineering, Inc. Klasse A	314.000	7.510.880	0,29 %
Caterpillar, Inc.	64.500	10.163.910	0,39 %	VMware, Inc. Klasse A	57.000	7.143.240	0,28 %
Spirit Airlines, Inc.	188.265	8.443.685	0,33 %	eBay, Inc.	186.400	7.034.736	0,27 %
AECOM	225.000	8.358.750	0,32 %	Stratasys Ltd.	350.000	6.986.000	0,27 %
Ritchie Bros Auctioneers, Inc.	215.800	6.458.894	0,25 %	FormFactor, Inc.	430.700	6.740.455	0,26 %
Boeing Co.	19.000	5.603.290	0,22 %	Universal Display Corp.	37.000	6.388.050	0,25 %
Deere & Co.	33.500	5.243.085	0,20 %	PayPal Holdings, Inc.	85.600	6.301.872	0,24 %
Siemens AG	37.500	5.230.234	0,20 %	Salesforce.com, Inc.	45.960	4.698.491	0,18 %
General Dynamics Corp.	23.000	4.679.350	0,18 %	Mastercard, Inc. Klasse A	31.000	4.692.160	0,18 %
Axon Enterprise, Inc.	175.000	4.637.500	0,18 %	Analog Devices, Inc.	47.000	4.184.410	0,16 %
CSX Corp.	82.000	4.510.820	0,17 %	Keysight Technologies, Inc.	91.500	3.806.400	0,15 %
Avis Budget Group, Inc.	80.000	3.510.400	0,14 %	DXC Technology Co.	39.890	3.785.561	0,15 %
TransDigm Group, Inc.	11.700	3.213.054	0,12 %	HubSpot, Inc.	42.800	3.783.520	0,15 %
United Technologies Corp.	25.000	3.189.250	0,12 %	Micro Focus International plc ADR	109.283	3.670.816	0,14 %
Textron, Inc.	55.000	3.112.450	0,12 %	Jabil, Inc.	138.000	3.622.500	0,14 %
Air Canada Klasse B	150.100	3.100.354	0,12 %	MINDBODY, Inc. Klasse A	102.500	3.121.125	0,12 %
Allegiant Travel Co. Klasse A	18.800	2.909.300	0,11 %	Dell Technologies, Inc. Klasse V			
Covanta Holding Corp.	170.000	2.873.000	0,11 %	Klasse V	34.375	2.794.000	0,11 %
Armstrong World Industries, Inc.	47.000	2.845.850	0,11 %	Autodesk, Inc.	15.100	1.582.933	0,06 %
Esterline Technologies Corp.	35.000	2.614.500	0,10 %	GTT Communications, Inc.	33.000	1.549.350	0,06 %
Hawaiian Holdings, Inc.	65.000	2.590.250	0,10 %	OSI Systems, Inc.	15.000	965.700	0,04 %
Old Dominion Freight Line, Inc.	15.500	2.039.025	0,08 %	Western Digital Corp.	8.000	636.240	0,02 %
Gibraltar Industries, Inc.	38.500	1.270.500	0,05 %	Teradyne, Inc.	10.000	418.700	0,02 %
Rockwell Automation, Inc.	6.200	1.217.370	0,05 %	Rubicon Project, Inc.	89.200	166.804	0,01 %
CIRCOR International, Inc.	24.000	1.168.320	0,05 %	Arista Networks, Inc.	500	117.790	0,00 %
Acuity Brands, Inc.	5.500	968.000	0,04 %			765.543.756	29,57 %
Controladora Vuela Cia de Aviacion SAB de CV ADR	101.000	810.020	0,03 %	Grundstoffe 0,63 % (2016: 0,85 %)			
Herc Holdings, Inc.	10.507	657.843	0,03 %	Monsanto Co.	120.800	14.107.024	0,55 %
IDEX Corp.	2.500	329.925	0,01 %	Ingevity Corp.	17.400	1.226.178	0,05 %
		464.264.637	17,93 %	Constellium NV Klasse A	46.000	512.900	0,02 %
Informationstechnologie 29,57 % (2016: 29,31 %)				Marrone Bio Innovations, Inc.	300.600	330.660	0,01 %
Alibaba Group Holding Ltd. ADR	338.700	58.402.041	2,26 %			16.176.762	0,63 %
Micron Technology, Inc.	1.224.300	50.343.216	1,94 %	Immobilien 0,07 % (2016: 0,00 %)			
Flex Ltd.	2.642.185	47.532.908	1,84 %	Park Hotels & Resorts, Inc. REIT	66.800	1.920.500	0,07 %
BlackBerry Ltd.	4.063.300	45.387.061	1,75 %			1.920.500	0,07 %
NVIDIA Corp.	190.400	36.842.400	1,42 %	Telekommunikationsdienstleistungen 0,79 % (2016: 1,38 %)			
Alphabet, Inc. Klasse A	32.767	34.516.758	1,33 %	Sprint Corp.	3.456.400	20.358.196	0,78 %
Adobe Systems, Inc.	191.900	33.628.556	1,30 %	T-Mobile US, Inc.	3.000	190.530	0,01 %
NetApp, Inc.	565.000	31.255.800	1,21 %			20.548.726	0,79 %
Alphabet, Inc. Klasse C	29.351	30.712.886	1,19 %	Summe Aktien		2.533.290.003	97,85 %
comScore, Inc.	924.772	26.356.002	1,02 %	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		2.533.290.003	97,85 %
Intel Corp.	413.700	19.096.392	0,74 %				
KLA-Tencor Corp.	176.900	18.586.883	0,72 %				

	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva	55.539.099	2,15 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	2.588.829.102	100,00 %

ADR – American Depositary Receipt.

REIT – Real Estate Investment Trust.

Analyse des Gesamtvermögens	US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	2.506.930.651	96,83 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	26.359.352	1,02 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente	—	0,00 %
(e) Sonstige Aktiva	55.539.099	2,15 %
Gesamtnettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	2.588.829.102	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Anteile	Kosten US-Dollar (\$)		Anteile	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
Alkermes plc	645.300	35.252.887	NVIDIA Corp.	250.800	36.310.190
IMAX Corp.	610.000	14.246.190	ABIOMED, Inc.	205.840	30.273.957
Discover Financial Services	116.349	8.362.918	Nektar Therapeutics Klasse A	554.764	22.477.364
Hewlett Packard Enterprise Co.	469.400	7.500.048	Charles Schwab Corp.	389.500	16.698.767
CBS Corp. Klasse B	95.000	6.399.431	Eli Lilly & Co.	142.100	11.915.439
OncoMed Pharmaceuticals, Inc.	1.777.000	6.373.150	Adobe Systems, Inc.	75.100	10.671.027
L Brands, Inc.	113.000	6.351.895	CarMax, Inc.	143.600	10.179.278
Caterpillar, Inc.	64.500	6.202.348	KLA-Tencor Corp.	89.600	9.009.329
BioMarin Pharmaceutical, Inc.	68.796	5.747.978	Royal Caribbean Cruises Ltd.	74.100	8.924.020
Bank of America Corp.	236.598	5.645.812	Exact Sciences Corp.	205.100	8.798.916
Altair Engineering, Inc. Klasse A	429.000	5.636.989	Roche Holding AG	33.300	8.530.415
Constellation Brands, Inc. Klasse A	30.600	5.495.084	Tribune Media Co. Klasse A	231.700	8.196.153
E*TRADE Financial Corp.	151.000	5.467.022	Micron Technology, Inc.	264.700	7.796.972
Bristol-Myers Squibb Co.	94.000	5.229.904	Medtronic plc	83.100	7.328.945
Newell Brands Inc.	132.100	5.160.462	Universal Display Corp.	56.000	6.972.240
Visa, Inc. Klasse A	48.000	4.581.258	FedEx Corp.	31.100	6.932.399
Boeing Co.	19.000	4.467.879	Lowe's Cos, Inc.	89.000	6.927.627
Nutanix, Inc. Klasse A	258.150	4.459.168	CSX Corp.	140.550	6.916.580
Alphabet, Inc. Klasse C	5.100	4.178.788	Alphabet, Inc. Klasse C	7.200	6.764.299
Mastercard, Inc. Klasse A	31.000	4.171.297	QIAGEN NV	194.185	6.477.087
Honeywell International, Inc.	29.000	3.899.571	Seattle Genetics, Inc.	100.500	6.305.968
AstraZeneca plc ADR	121.075	3.887.166	Chegg, Inc.	395.138	6.235.916
Xencor, Inc.	153.986	3.292.741	Ellie Mae, Inc.	59.000	6.212.579
Siemens AG	23.500	3.159.832	Corning, Inc.	191.000	6.004.010
Habit Restaurants, Inc. Klasse A	240.000	3.043.504	Axcelis Technologies, Inc.	273.100	5.945.455
BeiGene Ltd. ADR	45.658	2.989.632	Charles River Laboratories International, Inc.	63.700	5.730.275
Splunk, Inc.	49.000	2.920.878	Trimble, Inc.	176.700	5.673.105
Rockwell Collins, Inc.	29.700	2.884.638	US Bancorp	100.000	5.562.795
Jacobs Engineering Group, Inc.	49.400	2.749.339	JC Penney Co., Inc.	778.900	5.300.492
Spectrum Pharmaceuticals, Inc.	262.800	2.667.719	Intel Corp.	146.300	5.176.333

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.533.290.003	2.105.199.587
Barmittel	57.868.556	86.672.862
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenkassageschäften	87	—
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	890.784	776.271
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	1.169.190	6.191.441
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	662.131	821.455
Summe Umlaufvermögen	2.593.880.751	2.199.661.616
Kurzfristige Passiva		
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	—	18.767
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	43.783	3.941.541
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	3.074.091	565.096
Zahlbare Verwaltungsgebühren	1.933.775	1.638.277
Summe kurzfristige Passiva	5.051.649	6.163.681
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	2.588.829.102	2.193.497.935

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	1.901.919.743	1.642.179.550	1.496.231.084
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.246.218	2.548.903	2.616.155
Nettoinventarwert je Anteil	846,72	644,27	571,92
EUR-Anlegeranteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	67.146.896	48.598.678	70.864.843
Nettovermögen	55.918.468	46.076.017	65.235.058
Anzahl der umlaufenden Anteile	66.871	63.545	104.276
Nettoinventarwert je Anteil	836,21	725,09	625,60
GBP-Anlegeranteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	81.030.248	65.731.174	69.402.162
Nettovermögen	59.900.389	53.195.627	47.087.430
Anzahl der umlaufenden Anteile	80.745	85.996	102.183
Nettoinventarwert je Anteil	741,85	618,58	460,82
USD-Anlegeranteile (\$)			
Nettovermögen	538.732.215	436.988.533	559.102.043
Anzahl der umlaufenden Anteile	536.468	571.321	822.620
Nettoinventarwert je Anteil	1.004,22	764,87	679,66

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	555.452	248.975
Dividenden	23.383.930	19.172.604
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	168.687	671.064
Verschiedene Erträge	6.387	726
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	656.381.688	237.862.022
Summe Anlageerträge/(-verluste)	680.496.144	257.955.391
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	20.906.636	17.927.829
Transaktionsgebühren und Provisionen	548.860	444.803
Sonstige Aufwendungen	19.890	7.364
Summe Aufwendungen	21.475.386	18.379.996
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	4.959	300
Ertragsausgleich	(1.371)	(3.798)
Summe Finanzierungskosten	3.588	(3.498)
Nettoanlageerträge/(-verluste)	659.017.170	239.578.893
Ausländische Quellensteuer	(5.942.503)	(4.853.591)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)	653.074.667	234.725.302

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	653.074.667	234.725.302
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	484.737.805	595.686.612
Rücknahmen	(742.481.305)	(832.514.111)
Summe Kapitalgeschäfte ¹	(257.743.500)	(236.827.499)
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	395.331.167	(2.102.197)
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)		
Zu Jahresbeginn	2.193.497.935	2.195.600.132
Zum Jahresende	2.588.829.102	2.193.497.935

¹ Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

20+ Year Euro Treasury Index Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Asset Management, Limited.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds strebt eine Rendite an, die der Wertentwicklung des Bloomberg Barclays Euro Treasury 20+ Year Bond Index entspricht, eines marktgewichteten Index, der das gesamte Spektrum der auf Euro lautenden Schatztitel und regierungsnahen Wertpapiere aus der Eurozone mit Laufzeiten von mindestens 20 Jahren und einem Kreditrating von mindestens AA- widerspiegeln soll.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	32	29
Rendite auf Endfälligkeit	1,4 % ³	1,4 %
Durchschnittlicher Kupon	3,4 %	3,3 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	28,1 Jahre	28,0 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	Aa1	Aa1
Durchschnittliche Duration	19,3 Jahre	19,3 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,25 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,15 %	
Kurzfristige Reserven	1,5 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
R ²	1,00	1,00
Beta	1,00	1,00

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds
Frankreich	42,1 %
Deutschland	28,3
Belgien	13,4
Niederlande	8,8
Österreich	5,5
Finnland	1,7
Sonstige	0,2

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

Treasury-Titel	100,0 %
----------------	---------

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	37,1 %
Aa	62,7
nicht eingestuft	0,2

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 20 Jahren	0,2 %
Mehr als 20 Jahre	99,8 %

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit Kurz Mittel Lang

Kreditqualität	Staats-/ Agency-Titel			
	Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
	Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays Euro Treasury 20+ Year Bond Index.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

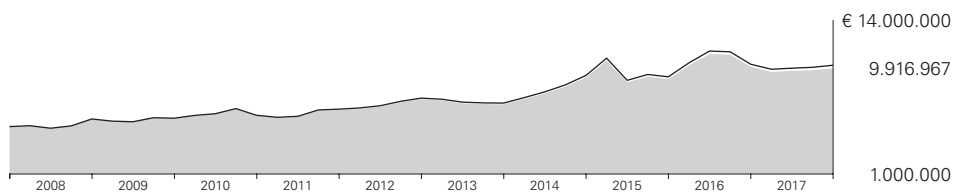
Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

20+ Year Euro Treasury Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays Euro Treasury 20+ Year Bond Index

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. € 5.000.000

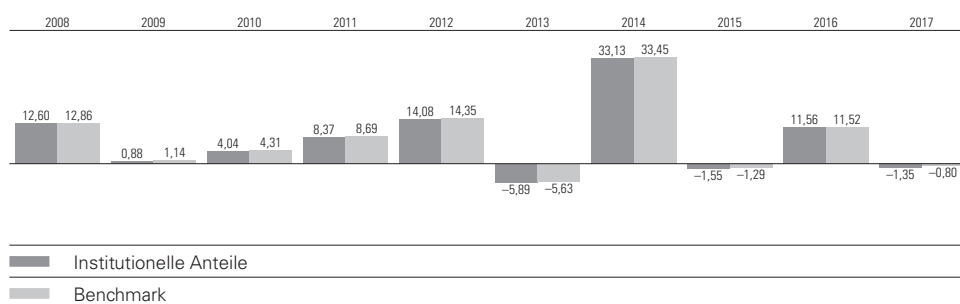


	Durchschnittliche jährliche Gesamrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
— Institutionelle Anteile	-1,35 %	6,30 %	7,09 %	€ 9.916.967
— Benchmark	-0,80	6,58	7,36	10.176.430

	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von € 200.000.000
Institutionelle Plus-Anteile	-1,25 %	-1,47 %	€ 191.859.000
Benchmark	-0,80	-1,30	192.770.137

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,55 Prozentpunkte für institutionelle Anteile und 0,45 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



1 10. März 2015.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 98,48 % (2016: 98,40 %)					
Österreich 5,41 % (2016: 7,78 %)					
Republic of Austria Government Bond	7.375.000	3,15 %	20.06.2044	10.324.410	1,96 %
Republic of Austria Government Bond	4.073.000	3,80 %	26.01.2062	6.898.848	1,31 %
Republic of Austria Government Bond	6.140.000	2,10 %	20.09.2117	6.547.573	1,25 %
Republic of Austria Government Bond	4.600.000	1,50 %	20.02.2047	4.648.907	0,89 %
				28.419.738	5,41 %
Belgien 13,15 % (2016: 10,89 %)					
Kingdom of Belgium Government Bond	18.694.295	4,25 %	28.03.2041	29.150.762	5,54 %
Kingdom of Belgium Government Bond	10.536.862	3,75 %	22.06.2045	15.632.657	2,97 %
Kingdom of Belgium Government Bond	9.080.000	1,60 %	22.06.2047	8.889.320	1,69 %
Kingdom of Belgium Government Bond	7.161.983	1,90 %	22.06.2038	7.820.699	1,49 %
Kingdom of Belgium Government Bond	3.770.000	2,15 %	22.06.2066	3.984.106	0,76 %
Kingdom of Belgium Government Bond	3.229.560	2,25 %	22.06.2057	3.555.358	0,68 %
Kingdom of Belgium Government Bond	74.000	3,75 %	22.06.2045	109.788	0,02 %
				69.142.690	13,15 %
Finnland 1,65 % (2016: 1,24 %)					
Finland Government Bond	5.285.000	2,63 %	04.07.2042	6.933.391	1,32 %
Finland Government Bond	1.751.000	1,38 %	15.04.2047	1.764.290	0,33 %
				8.697.681	1,65 %
Frankreich 41,68 % (2016: 33,14 %)					
French Republic Government Bond OAT	34.411.943	4,50 %	25.04.2041	54.921.530	10,45 %
French Republic Government Bond OAT	28.763.874	4,00 %	25.10.2038	42.416.762	8,07 %
French Republic Government Bond OAT	26.874.691	3,25 %	25.05.2045	36.247.186	6,89 %
French Republic Government Bond OAT	16.187.762	4,00 %	25.04.2055	25.577.473	4,86 %
French Republic Government Bond OAT	14.205.884	4,00 %	25.04.2060	23.010.094	4,38 %
French Republic Government Bond OAT	16.954.000	2,00 %	25.05.2048	17.895.185	3,40 %
French Republic Government Bond OAT	11.220.000	1,75 %	25.06.2039	11.821.145	2,25 %
French Republic Government Bond OAT	7.640.000	1,75 %	25.05.2066	7.232.635	1,38 %
				219.122.010	41,68 %
Deutschland 27,96 % (2016: 32,57 %)					
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	24.980.390	2,50 %	15.08.2046	32.773.772	6,23 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	23.985.075	2,50 %	04.07.2044	31.184.483	5,93 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	17.689.133	4,75 %	04.07.2040	30.856.924	5,87 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	15.014.541	4,25 %	04.07.2039	24.372.504	4,64 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	16.111.322	3,25 %	04.07.2042	23.478.820	4,47 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	4.350.000	1,25 %	15.08.2048	4.334.779	0,82 %
				147.001.282	27,96 %
Niederlande 8,63 % (2016: 12,78 %)					
Netherlands Government Bond	16.239.646	3,75 %	15.01.2042	25.197.841	4,79 %
Netherlands Government Bond	14.814.287	2,75 %	15.01.2047	20.155.548	3,84 %
				45.353.389	8,63 %
Summe Anleihen				517.736.790	98,48 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				517.736.790	98,48 %
				Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva				7.980.257	1,52 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)				525.717.047	100,00 %
Analyse des Gesamtvermögens				Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind				328.630.353	62,51 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere				189.106.437	35,97 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente				—	0,00 %
(e) Sonstige Aktiva und Passiva				7.980.257	1,52 %
Gesamtvermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)				525.717.047	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Kapital Euro (€)	Kosten Euro (€)		Kapital Euro (€)	Erlöse Euro (€)
Käufe			Verkäufe		
French Republic Government Bond OAT 2,00 % 25.5.2048	19.720.000	20.756.900	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,00 % 4.1.2037	34.767.843	54.319.018
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,75 % 4.7.2040	9.947.000	17.747.151	Netherlands Government Bond 4,00 % 15.1.2037	22.691.483	34.955.890
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,50 % 4.7.2044	12.780.000	16.843.227	French Republic Government Bond OAT 4,50 % 25.4.2041	19.800.000	31.968.484
French Republic Government Bond OAT 3,25 % 25.5.2045	12.500.000	16.100.983	Republic of Austria Government Bond 4,15 % 15.3.2037	19.136.000	29.364.085
French Republic Government Bond OAT 1,75 % 25.6.2039	15.220.000	15.216.387	French Republic Government Bond OAT 3,25 % 25.5.2045	18.865.000	25.510.221
French Republic Government Bond OAT 4,00 % 25.10.2038	10.070.000	14.318.563	French Republic Government Bond OAT 4,00 % 25.10.2038	15.330.000	22.867.274
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,50 % 15.8.2046	10.038.207	13.403.380	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,50 % 4.7.2044	16.080.000	21.244.126
French Republic Government Bond OAT 4,50 % 25.4.2041	8.000.000	12.187.907	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3,25 % 4.7.2042	12.290.000	18.160.430
French Republic Government Bond OAT 4,00 % 25.4.2055	7.000.000	10.512.101	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,75 % 4.7.2040	9.746.000	17.260.617
Netherlands Government Bond 2,75 % 15.1.2047	7.646.000	10.393.925	French Republic Government Bond OAT 4,00 % 25.4.2055	10.654.000	17.197.181
Kingdom of Belgium Government Bond 3,75 % 22.6.2045	5.900.000	8.430.113	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,50 % 15.8.2046	10.800.000	14.444.507
Republic of Austria Government Bond 2,10 % 20.9.2117	6.800.000	6.940.829	Netherlands Government Bond 3,75 % 15.1.2042	8.594.000	13.487.419
Netherlands Government Bond 3,75 % 15.1.2042	4.374.000	6.910.998	Kingdom of Belgium Government Bond 3,75 % 22.6.2045	9.026.000	13.349.834
Kingdom of Belgium Government Bond 1,60 % 22.6.2047	6.930.000	6.612.033	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,25 % 4.7.2039	7.795.000	12.832.759
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3,25 % 4.7.2042	3.910.000	5.708.205	Netherlands Government Bond 2,75 % 15.1.2047	8.865.000	12.244.200
Kingdom of Belgium Government Bond 2,25 % 22.6.2057	5.000.000	5.454.447	Kingdom of Belgium Government Bond 4,25 % 28.3.2041	7.350.000	11.598.640
French Republic Government Bond OAT 1,75 % 25.5.2066	6.130.000	5.323.204	French Republic Government Bond OAT 4,00 % 25.4.2060	5.500.000	9.108.232
Kingdom of Belgium Government Bond 1,90 % 22.6.2038	4.360.000	4.649.210	Kingdom of Belgium Government Bond 1,60 % 22.6.2047	5.300.000	5.276.993
Kingdom of Belgium Government Bond 1,45 % 22.6.2037	4.500.000	4.564.935	Republic of Austria Government Bond 3,15 % 20.6.2044	3.496.000	4.898.443
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,25 % 15.8.2048	4.350.000	4.378.854	French Republic Government Bond OAT 1,75 % 25.5.2066	4.790.000	4.700.013
Republic of Austria Government Bond 1,50 % 20.2.2047	3.600.000	3.560.106	Republic of Austria Government Bond 1,50 % 2.11.2086	5.300.000	4.576.838
Kingdom of Belgium Government Bond 4,25 % 28.3.2041	2.308.488	3.527.242	Kingdom of Belgium Government Bond 1,45 % 22.6.2037	4.500.000	4.475.343
French Republic Government Bond OAT 4,00 % 25.4.2060	2.065.000	3.336.886	Kingdom of Belgium Government Bond 1,90 % 22.6.2038	3.800.000	4.188.329
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,25 % 4.7.2039	1.930.000	3.208.230	French Republic Government Bond OAT 1,75 % 25.6.2039	4.000.000	4.096.120
Finland Government Bond 1,38 % 15.4.2047	3.000.000	3.099.034			
Republic of Austria Government Bond 4,15 % 15.3.2037	1.700.000	2.581.807			
Republic of Austria Government Bond 3,80 % 26.1.2062	1.373.000	2.329.324			

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	Euro (€) Zum 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	517.736.790	714.765.192
Barmittel und liquide Vermögenswerte	885.766	1.292.388
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	7.056.585	10.900.937
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	417.311	7.485.685
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	465.657	40.419.120
Summe Umlaufvermögen	526.562.109	774.863.322
Kurzfristige Passiva		
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	—	2.333.205
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	727.886	46.012.824
Zahlbare Verwaltungsgebühren	117.176	156.705
Summe kurzfristige Passiva	845.062	48.502.734
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	525.717.047	726.360.588

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Nettovermögen	524.358.939	726.319.528	729.477.408
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.639.402	3.606.616	4.041.025
Nettoinventarwert je Anteil	198,67	201,39	180,52
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Nettovermögen	1.358.108	41.060	7.096
Anzahl der umlaufenden Anteile	14.157	423	82
Nettoinventarwert je Anteil	95,93	97,07	86,99

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	11.205.042	11.995.254
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	(16.725.900)	70.544.214
Summe Anlageerträge/(-verluste)	(5.520.858)	82.539.468
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	1.683.792	1.839.368
Sonstige Aufwendungen	—	119
Summe Aufwendungen	1.683.792	1.839.487
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	9.277	4.528
Summe Finanzierungskosten	9.277	4.528
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(7.213.927)	80.695.453
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	(7.213.927)	80.695.453

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	(7.213.927)	80.695.453
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	69.722.859	146.210.702
Rücknahmen	(263.152.473)	(230.030.071)
Summe Kapitalgeschäfte	(193.429.614)	(83.819.369)
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	(200.643.541)	(3.123.916)
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	726.360.588	729.484.504
Zum Jahresende	525.717.047	726.360.588

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Euro Government Bond Index Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Asset Management, Limited.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds strebt eine Rendite an, die der Wertentwicklung des Bloomberg Barclays Euro Government Float Adjusted Bond Index entspricht, eines marktgewichteten Index, der das gesamte Spektrum der auf Euro lautenden Schatztitel und regierungsnahen Wertpapiere aus der Eurozone mit Laufzeiten von mehr als einem Jahr widerspiegeln soll.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	733	1.139
Rendite auf Endfälligkeit	0,6 % ³	0,6 %
Durchschnittlicher Kupon	3,0 %	2,9 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	8,8 Jahre	8,8 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	A1	A1
Durchschnittliche Duration	7,1 Jahre	7,1 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,20 %	
Anlegeranteile	0,25 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %	
Thesaurierende Anteile	0,25 %	
Kurzfristige Reserven	1,5 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
R ²	1,00	1,00
Beta	1,01	1,00

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Frankreich	24,8 %	24,7 %
Deutschland	21,2	21,2
Italien	20,8	20,6
Spanien	12,5	12,5
Belgien	5,6	5,5
Niederlande	5,6	5,6
Österreich	3,7	3,7
Irland	1,7	1,7
Portugal	1,5	1,9
Finnland	1,4	1,4
Sonstige	1,2	1,2

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

Treasury-Titel	86,4 %
Agency-Titel	9,5
Lokale Behörde	4,1

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	24,3 %
Aa	36,9
A	3,5
Baa	35,0
nicht eingestuft	0,3

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	40,4 %
5-10 Jahre	33,5
Mehr als 10 Jahre	26,1

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit

	Kurz	Mittel	Lang
Kreditqualität			
Staats-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays Euro Government Float Adjusted Bond Index.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

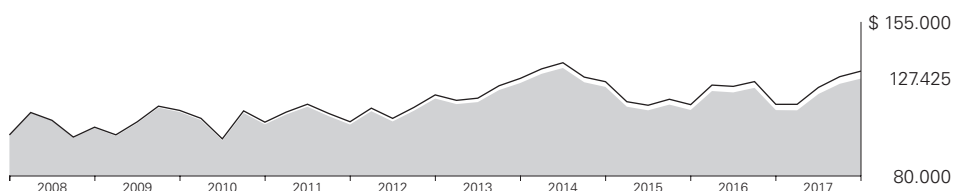
Euro Government Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays Euro Government Float Adjusted Bond Index

In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. \$ 100.000

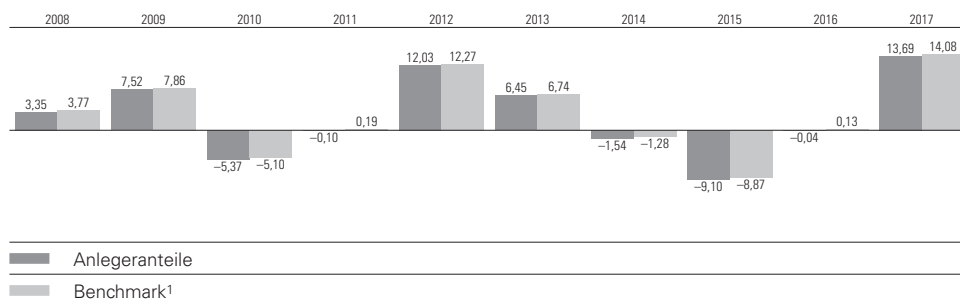


	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Anlegeranteile	13,69 %	1,60 %	2,45 %	\$ 127.425
Benchmark ¹	14,08	1,87	2,74	131.054

	Ein Jahr	Seit Auflegung ²	Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
Institutionelle Anteile	13,75 %	4,37 %	\$ 5.639.395
Benchmark	14,08	4,59	5.672.516

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,39 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,33 Prozentpunkte für institutionelle Anteile.³

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



1 Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Government Bond Index bis 30. Juni 2010; und danach Bloomberg Barclays Euro Government Float Adjusted Bond Index.

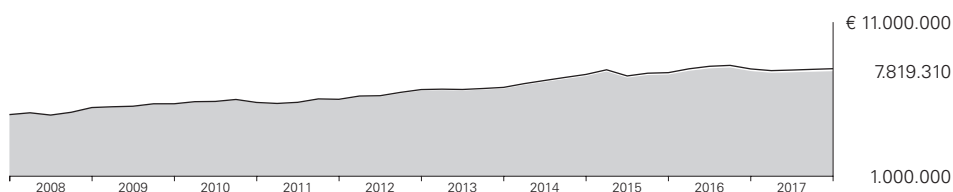
2 10. März 2015.

3 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Euro Government Bond Index Fund
Benchmark: Bloomberg Barclays Euro Government Float Adjusted Bond Index

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



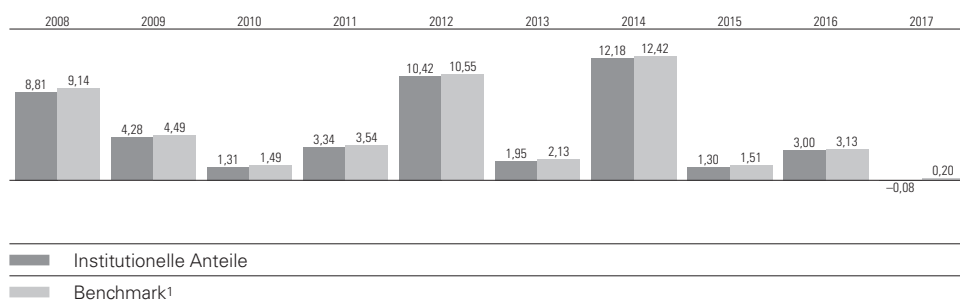
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Institutionelle Anteile	-0,08 %	3,58 %	4,57 %	€ 7.819.310
— Benchmark ¹	0,20	3,79	4,78	7.978.345

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Anlegeranteile	-0,13 %	3,52 %	4,49 %	€ 155.128
Benchmark ¹	0,20	3,79	4,78	159.567

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ²	
Institutionelle Plus-Anteile	0,02 %	4,02 %	€ 234.793.000
Benchmark	0,20	4,13	235.801.241

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,28 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,33 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,18 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.³

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



1 Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Government Bond Index bis 30. Juni 2010; und danach Bloomberg Barclays Euro Government Float Adjusted Bond Index.

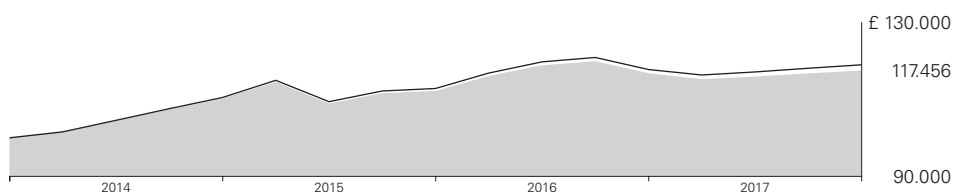
2 6. Dezember 2013.

3 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Euro Government Bond Index Fund
Benchmark: Bloomberg Barclays Euro Government Float Adjusted Bond Index GBP-Hedged

Abgesichert in GBP

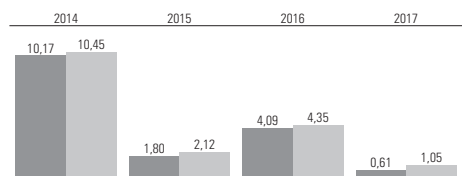
Kumulative Wertentwicklung: 31. Januar 2014–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP	0,61 %	4,20 %	£ 117.456
Benchmark	1,05	4,53	118.935

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,44 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte Thesaurierungsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Januar 2014–31. Dezember 2017



Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP
Benchmark

¹ 31. Januar 2014.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 98,66 % (2016: 98,71 %)					
Österreich 3,68 % (2016: 3,76 %)					
Republic of Austria Government Bond	15.300.000	0,25 %	18.10.2019	15.504.928	0,32 %
Republic of Austria Government Bond	14.000.000	0,00 %	15.07.2023	13.966.876	0,29 %
Republic of Austria Government Bond	10.600.000	1,65 %	21.10.2024	11.662.406	0,24 %
Republic of Austria Government Bond	7.219.000	4,15 %	15.03.2037	10.970.079	0,23 %
Republic of Austria Government Bond	6.950.000	4,85 %	15.03.2026	9.517.121	0,20 %
Republic of Austria Government Bond	8.004.000	3,50 %	15.09.2021	9.144.250	0,19 %
Republic of Austria Government Bond	8.000.000	0,75 %	20.10.2026	8.180.000	0,17 %
Republic of Austria Government Bond	6.450.000	2,40 %	23.05.2034	7.738.181	0,16 %
Republic of Austria Government Bond	7.450.000	1,95 %	18.06.2019	7.717.678	0,16 %
Republic of Austria Government Bond	7.000.000	0,50 %	20.04.2027	6.950.314	0,15 %
Republic of Austria Government Bond	6.074.000	4,35 %	15.03.2019	6.430.143	0,13 %
Republic of Austria Government Bond	5.783.000	3,90 %	15.07.2020	6.421.755	0,13 %
Republic of Austria Government Bond	5.450.000	3,40 %	22.11.2022	6.386.070	0,13 %
Republic of Austria Government Bond	4.062.000	6,25 %	15.07.2027	6.254.834	0,13 %
Republic of Austria Government Bond	4.300.000	3,15 %	20.06.2044	6.019.656	0,13 %
Republic of Austria Government Bond	4.750.000	3,65 %	20.04.2022	5.536.980	0,12 %
Republic of Austria Government Bond	2.600.000	3,80 %	26.01.2062	4.403.880	0,09 %
KAF Kaerntner Ausgleichszahlungs-Fonds	5.000.000	0,00 %	14.01.2032	4.186.010	0,09 %
Republic of Austria Government Bond	3.500.000	1,20 %	20.10.2025	3.735.305	0,08 %
Republic of Austria Government Bond	3.000.000	0,00 %	20.09.2022	3.019.182	0,06 %
Republic of Austria Government Bond	2.500.000	2,10 %	20.09.2117	2.665.950	0,06 %
Republic of Austria Government Bond	2.777.000	1,50 %	02.11.2086	2.437.551	0,05 %
Autobahnen- und Schnell- strassen-Finanzierungs AG	2.100.000	0,63 %	15.09.2022	2.155.083	0,05 %
KA Finanz AG	1.600.000	0,38 %	11.08.2020	1.622.333	0,03 %
OeBB-Infrastruktur AG	1.000.000	4,88 %	27.06.2022	1.216.879	0,03 %
OeBB-Infrastruktur AG	950.000	3,38 %	18.05.2032	1.211.000	0,03 %
Autobahnen- und Schnell- strassen-Finanzierungs AG	950.000	3,38 %	22.09.2025	1.158.350	0,02 %
OeBB-Infrastruktur AG	1.000.000	2,25 %	28.05.2029	1.133.006	0,02 %
OeBB-Infrastruktur AG	900.000	3,88 %	30.06.2025	1.122.529	0,02 %
OeBB-Infrastruktur AG	850.000	3,63 %	13.07.2021	962.841	0,02 %
OeBB-Infrastruktur AG	920.000	1,00 %	18.11.2024	957.564	0,02 %
Verbund AG	900.000	1,50 %	20.11.2024	941.782	0,02 %
Hypo Vorarlberg Bank AG	900.000	1,50 %	22.05.2019	919.332	0,02 %
OeBB-Infrastruktur AG	679.000	3,50 %	19.10.2020	750.985	0,02 %
Autobahnen- und Schnell- strassen-Finanzierungs AG	500.000	2,75 %	20.06.2033	599.054	0,01 %
Autobahnen- und Schnell- strassen-Finanzierungs AG	500.000	1,75 %	21.10.2020	528.664	0,01 %
OeBB-Infrastruktur AG	450.000	2,25 %	04.07.2023	500.452	0,01 %
OeBB-Infrastruktur AG	400.000	3,00 %	24.10.2033	492.847	0,01 %
Republic of Austria Government Bond	400.000	1,50 %	20.02.2047	404.253	0,01 %
Autobahnen- und Schnell- strassen-Finanzierungs AG	300.000	2,75 %	11.06.2032	358.111	0,01 %
Erdoel-Lagergesellschaft mbH	300.000	2,75 %	20.03.2028	347.307	0,01 %
EVN AG	200.000	4,25 %	13.04.2022	231.198	0,00 %
				176.462.719	3,68 %
Belgien 5,51 % (2016: 5,73 %)					
Kingdom of Belgium Government Bond	20.250.000	4,25 %	28.09.2022	24.476.681	0,51 %
Kingdom of Belgium Government Bond	11.471.486	4,25 %	28.03.2041	17.887.947	0,37 %
Kingdom of Belgium Government Bond	10.941.109	5,00 %	28.03.2035	17.561.333	0,37 %
Kingdom of Belgium Government Bond	16.300.000	0,80 %	22.06.2027	16.546.277	0,34 %
Kingdom of Belgium Government Bond	14.883.000	1,00 %	22.06.2026	15.544.207	0,32 %
Kingdom of Belgium Government Bond	12.300.000	2,60 %	22.06.2024	14.248.689	0,30 %
Kingdom of Belgium Government Bond	12.100.000	4,25 %	28.09.2021	14.175.465	0,30 %
Kingdom of Belgium Government Bond	12.400.000	4,00 %	28.03.2019	13.098.641	0,27 %
Kingdom of Belgium Government Bond	11.000.000	3,75 %	28.09.2020	12.269.059	0,26 %
Kingdom of Belgium Government Bond	11.900.000	1,00 %	22.06.2031	11.883.388	0,25 %
Kingdom of Belgium Government Bond	7.086.000	5,50 %	28.03.2028	10.539.008	0,22 %
Kingdom of Belgium Government Bond	8.070.000	4,00 %	28.03.2022	9.534.543	0,20 %
Kingdom of Belgium Government Bond	7.800.000	2,25 %	22.06.2023	8.771.989	0,18 %
Kingdom of Belgium Government Bond	8.000.000	3,00 %	28.09.2019	8.491.688	0,18 %
Kingdom of Belgium Government Bond	5.600.000	3,00 %	22.06.2034	7.132.171	0,15 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Kingdom of Belgium Government Bond	4.500.000	3,75 %	22.06.2045	6.676.272	0,14 %
Kingdom of Belgium Government Bond	4.850.000	4,50 %	28.03.2026	6.487.195	0,14 %
Kingdom of Belgium Government Bond	5.000.000	0,50 %	22.10.2024	5.093.050	0,11 %
Kingdom of Belgium Government Bond	4.000.000	1,90 %	22.06.2038	4.367.896	0,09 %
Kingdom of Belgium Government Bond	4.000.000	1,45 %	22.06.2037	4.081.760	0,08 %
Kingdom of Belgium Government Bond	4.000.000	0,20 %	22.10.2023	4.031.488	0,08 %
Kingdom of Belgium Government Bond	3.800.000	1,60 %	22.06.2047	3.720.200	0,08 %
Kingdom of Belgium Government Bond	3.300.000	2,25 %	22.06.2057	3.632.904	0,08 %
Kingdom of Belgium Government Bond	2.000.000	3,75 %	22.06.2045	2.967.232	0,06 %
Kingdom of Belgium Government Bond	2.500.000	2,60 %	22.06.2024	2.896.075	0,06 %
Dexia Credit Local SA	2.500.000	0,63 %	21.01.2022	2.558.770	0,05 %
Kingdom of Belgium Government Bond	2.120.000	2,15 %	22.06.2066	2.240.399	0,05 %
Kingdom of Belgium Government Bond	1.200.000	4,00 %	28.03.2032	1.681.754	0,03 %
Dexia Credit Local SA	1.500.000	1,25 %	27.10.2025	1.566.924	0,03 %
Dexia Credit Local SA	1.400.000	2,00 %	22.01.2021	1.490.037	0,03 %
Dexia Credit Local SA	1.200.000	0,75 %	25.01.2023	1.231.152	0,03 %
Eandis System Operator SCRL	1.000.000	1,75 %	04.12.2026	1.060.818	0,02 %
Dexia Credit Local SA	1.000.000	0,20 %	16.03.2021	1.009.239	0,02 %
Dexia Credit Local SA	700.000	1,25 %	26.11.2024	733.972	0,02 %
Eandis System Operator SCRL	600.000	2,75 %	30.11.2022	664.404	0,01 %
Proximus SADP	600.000	1,88 %	01.10.2025	641.932	0,01 %
Apetra NV	500.000	3,13 %	25.09.2023	573.994	0,01 %
Proximus SADP	500.000	2,38 %	04.04.2024	549.899	0,01 %
Dexia Credit Local SA	500.000	1,38 %	18.09.2019	514.650	0,01 %
Dexia Credit Local SA	500.000	0,25 %	19.03.2020	505.533	0,01 %
Apetra NV	400.000	2,13 %	17.12.2020	423.761	0,01 %
Eandis System Operator SCRL	300.000	2,88 %	07.05.2029	343.576	0,01 %
Eandis System Operator SCRL	300.000	2,88 %	09.10.2023	337.655	0,01 %
				264.243.627	5,51 %
Finnland 1,39 % (2016: 1,34 %)					
Finland Government Bond	5.400.000	2,75 %	04.07.2028	6.559.380	0,14 %
Finland Government Bond	6.100.000	0,75 %	15.04.2031	6.005.072	0,13 %
Finland Government Bond	4.900.000	3,50 %	15.04.2021	5.518.625	0,11 %
Finland Government Bond	4.350.000	1,50 %	15.04.2023	4.701.593	0,10 %
Finland Government Bond	4.500.000	0,38 %	15.09.2020	4.599.585	0,10 %
Finland Government Bond	4.000.000	2,00 %	15.04.2024	4.467.656	0,09 %
Finland Government Bond	4.050.000	3,38 %	15.04.2020	4.407.279	0,09 %
Finland Government Bond	4.000.000	0,50 %	15.04.2026	4.033.000	0,08 %
Finland Government Bond	2.950.000	2,63 %	04.07.2042	3.870.105	0,08 %
Finland Government Bond	3.300.000	0,00 %	15.09.2023	3.292.265	0,07 %
Finland Government Bond	2.500.000	4,00 %	04.07.2025	3.186.380	0,07 %
Finland Government Bond	2.465.000	4,38 %	04.07.2019	2.649.653	0,06 %
Finland Government Bond	2.000.000	0,00 %	15.04.2022	2.013.258	0,04 %
Finnvera OYJ	2.000.000	0,50 %	13.04.2026	1.987.696	0,04 %
Fortum OYJ	1.250.000	4,00 %	24.05.2021	1.400.312	0,03 %
Finland Government Bond	1.100.000	1,63 %	15.09.2022	1.191.890	0,02 %
Finland Government Bond	1.000.000	0,88 %	15.09.2025	1.042.312	0,02 %
Municipality Finance plc	1.000.000	0,75 %	07.09.2027	1.009.426	0,02 %
Finland Government Bond	1.000.000	1,38 %	15.04.2047	1.007.590	0,02 %
Municipality Finance plc	1.000.000	0,10 %	15.10.2021	1.006.761	0,02 %
Fortum OYJ	790.000	2,25 %	06.09.2022	844.940	0,02 %
Finnvera OYJ	800.000	0,63 %	22.09.2022	820.602	0,02 %
Finnvera OYJ	500.000	0,63 %	19.11.2021	513.438	0,01 %
Fingrid OYJ	250.000	3,50 %	03.04.2024	292.911	0,01 %
				66.421.729	1,39 %
Frankreich 24,64 % (2016: 24,55 %)					
French Republic Government Bond OAT	63.500.000	1,00 %	25.05.2027	65.605.787	1,37 %
French Republic Government Bond OAT	47.200.000	2,25 %	25.05.2024	53.595.600	1,12 %
French Republic Government Bond OAT	43.450.000	1,75 %	25.05.2023	47.599.475	0,99 %
French Republic Government Bond OAT	24.700.000	4,50 %	25.04.2041	39.421.249	0,82 %
French Republic Government Bond OAT	34.200.000	2,25 %	25.10.2022	38.077.391	0,79 %
French Republic Government Bond OAT	34.000.000	0,50 %	25.11.2019	34.657.220	0,72 %
French Republic Government Bond OAT	20.186.000	5,75 %	25.10.2032	33.127.285	0,69 %
French Republic Government Bond OAT	30.600.000	0,00 %	25.02.2019	30.821.544	0,64 %
French Republic Government Bond OAT	26.555.000	3,75 %	25.04.2021	30.179.226	0,63 %
French Republic Government Bond OAT	19.280.000	4,75 %	25.04.2035	29.947.855	0,62 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
French Republic Government Bond OAT	26.800.000	1,75 %	25.11.2024	29.647.232	0,62 %
French Republic Government Bond OAT	24.100.000	2,75 %	25.10.2027	28.855.267	0,60 %
French Republic Government Bond OAT	26.327.000	3,75 %	25.10.2019	28.401.462	0,59 %
French Republic Government Bond OAT	25.700.000	3,50 %	25.04.2020	28.069.283	0,59 %
French Republic Government Bond OAT	25.000.000	2,50 %	25.10.2020	27.056.800	0,56 %
French Republic Government Bond OAT	26.500.000	0,50 %	25.05.2025	26.907.994	0,56 %
French Republic Government Bond OAT	20.100.000	3,50 %	25.04.2026	25.241.982	0,53 %
French Republic Government Bond OAT	16.227.000	5,50 %	25.04.2029	24.469.991	0,51 %
French Republic Government Bond OAT	24.000.000	0,00 %	25.05.2022	24.142.560	0,50 %
French Republic Government Bond OAT	23.800.000	0,00 %	25.05.2020	24.060.229	0,50 %
French Republic Government Bond OAT	17.050.000	3,25 %	25.05.2045	22.996.153	0,48 %
French Republic Government Bond OAT	19.300.000	2,50 %	25.05.2030	22.784.885	0,48 %
French Republic Government Bond OAT	19.400.000	3,00 %	25.04.2022	22.082.244	0,46 %
French Republic Government Bond OAT	16.826.000	4,25 %	25.10.2023	20.962.739	0,44 %
French Republic Government Bond OAT	14.051.000	6,00 %	25.10.2025	20.281.719	0,42 %
French Republic Government Bond OAT	11.997.000	4,00 %	25.04.2055	18.955.860	0,40 %
French Republic Government Bond OAT	12.759.000	4,00 %	25.10.2038	18.815.110	0,39 %
French Republic Government Bond OAT	17.500.000	0,25 %	25.11.2020	17.811.885	0,37 %
French Republic Government Bond OAT	16.000.000	0,00 %	25.05.2021	16.158.432	0,34 %
French Republic Government Bond OAT	14.150.000	3,25 %	25.10.2021	16.059.825	0,34 %
French Republic Government Bond OAT	15.100.000	0,50 %	25.05.2026	15.162.363	0,32 %
French Republic Government Bond OAT	15.200.000	0,75 %	25.05.2028	15.149.901	0,32 %
French Republic Government Bond OAT	14.300.000	1,00 %	25.11.2025	15.003.160	0,31 %
French Republic Government Bond OAT	11.100.000	1,50 %	25.05.2031	11.726.218	0,24 %
French Republic Government Bond OAT	6.800.000	4,00 %	25.04.2060	11.014.354	0,23 %
French Republic Government Bond OAT	10.000.000	1,75 %	25.06.2039	10.535.780	0,22 %
French Republic Government Bond OAT	10.000.000	1,25 %	25.05.2036	9.824.010	0,21 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	7.300.000	0,50 %	25.05.2023	7.464.294	0,16 %
French Republic Government Bond OAT	7.040.000	2,00 %	25.05.2048	7.430.819	0,16 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	6.800.000	1,13 %	25.05.2019	6.947.703	0,15 %
French Republic Government Bond OAT	6.900.000	1,75 %	25.05.2066	6.532.092	0,14 %
UNEDIC A.S.SEO	6.000.000	0,13 %	25.11.2024	5.914.272	0,12 %
French Republic Government Bond OAT	5.300.000	1,00 %	25.05.2019	5.417.522	0,11 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	4.950.000	4,00 %	25.10.2019	5.351.465	0,11 %
French Republic Government Bond OAT	5.000.000	0,00 %	25.02.2020	5.050.240	0,11 %
French Republic Government Bond OAT	4.271.000	8,50 %	25.10.2019	4.975.578	0,10 %
Bpifrance Financement SA	4.800.000	0,75 %	25.10.2021	4.949.952	0,10 %
UNEDIC A.S.SEO	4.500.000	0,04 %	25.05.2019	4.528.143	0,09 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	4.400.000	0,05 %	25.11.2020	4.437.246	0,09 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	3.950.000	3,75 %	25.10.2020	4.403.010	0,09 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	3.500.000	4,13 %	25.04.2023	4.253.462	0,09 %
Agence Francaise de Developpement	4.000.000	1,38 %	17.09.2024	4.252.692	0,09 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	3.450.000	4,38 %	25.10.2021	4.054.112	0,08 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	3.400.000	2,38 %	25.01.2024	3.860.010	0,08 %
French Republic Government Bond OAT	2.631.000	8,50 %	25.04.2023	3.825.229	0,08 %
Electricite de France SA	4.000.000	1,88 %	13.10.2036	3.674.552	0,08 %
UNEDIC A.S.SEO	3.100.000	1,50 %	16.04.2021	3.275.181	0,07 %
Agence Francaise de Developpement	2.900.000	2,13 %	15.02.2021	3.100.500	0,07 %
Dexia Credit Local SA	3.000.000	0,63 %	03.02.2024	3.045.201	0,06 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	2.800.000	1,38 %	25.11.2024	3.011.828	0,06 %
French Republic Government Bond OAT	3.000.000	1,25 %	25.05.2036	2.947.203	0,06 %
Electricite de France SA^	2.700.000	4,13 %	22.01.2166	2.882.250	0,06 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	2.500.000	2,50 %	25.10.2022	2.803.040	0,06 %
Electricite de France SA	2.500.000	2,75 %	10.03.2023	2.771.850	0,06 %
SNCF Reseau EPIC	1.750.000	5,00 %	10.10.2033	2.650.191	0,06 %
Agence Francaise de Developpement	2.700.000	0,25 %	21.07.2026	2.594.660	0,05 %
SNCF Mobilites	2.316.000	3,63 %	03.06.2020	2.530.297	0,05 %
UNEDIC A.S.SEO	2.400.000	1,25 %	21.10.2027	2.521.430	0,05 %
SNCF Mobilites	1.850.000	4,63 %	02.02.2024	2.329.008	0,05 %
SNCF Reseau EPIC	1.950.000	6,00 %	12.10.2020	2.288.298	0,05 %
Bpifrance Financement SA	2.000.000	2,50 %	25.05.2024	2.277.172	0,05 %
Bpifrance Financement SA	2.200.000	1,00 %	25.10.2019	2.253.416	0,05 %
SNCF Reseau EPIC	1.800.000	3,13 %	25.10.2028	2.205.103	0,05 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	1.700.000	4,00 %	15.12.2025	2.179.303	0,05 %
La Poste SA	1.850.000	4,25 %	08.11.2021	2.140.766	0,04 %
SNCF Reseau EPIC	2.000.000	1,88 %	30.03.2034	2.127.840	0,04 %
Region of Ile de France	2.000.000	1,38 %	14.03.2029	2.084.980	0,04 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	1.850.000	4,25 %	25.04.2020	2.048.666	0,04 %
Electricite de France SA	1.800.000	5,38 %	29.05.2020	2.036.686	0,04 %
SNCF Reseau EPIC	2.000.000	0,10 %	27.05.2021	2.010.804	0,04 %
Bpifrance Financement SA	2.000.000	0,13 %	25.11.2023	1.986.088	0,04 %
SNCF Reseau EPIC	1.500.000	4,25 %	07.10.2026	1.961.326	0,04 %
SNCF Reseau EPIC	1.500.000	4,50 %	30.01.2024	1.880.833	0,04 %
Dexia Credit Local SA	1.700.000	0,25 %	02.06.2022	1.710.542	0,04 %
Electricite de France SA	1.400.000	4,00 %	12.11.2025	1.704.458	0,04 %
Bpifrance Financement SA	1.500.000	2,38 %	25.04.2022	1.655.153	0,03 %
Regie Autonome des Transports Parisiens	1.400.000	2,88 %	09.09.2022	1.583.936	0,03 %
UNEDIC A.S.SEO	1.500.000	3,00 %	25.04.2019	1.567.917	0,03 %
Agence Francaise de Developpement	1.400.000	3,63 %	21.04.2020	1.525.440	0,03 %
UNEDIC A.S.SEO	1.500.000	0,25 %	24.11.2023	1.510.428	0,03 %
Agence France Locale	1.500.000	0,50 %	20.06.2024	1.510.046	0,03 %
UNEDIC A.S.SEO	1.400.000	1,50 %	20.04.2032	1.464.515	0,03 %
Agence Francaise de Developpement	1.500.000	0,88 %	25.05.2031	1.434.038	0,03 %
Electricite de France SA	1.200.000	3,88 %	18.01.2022	1.371.662	0,03 %
Electricite de France SA	1.100.000	4,63 %	11.09.2024	1.369.012	0,03 %
French Republic Government Bond OAT	1.000.000	8,25 %	25.04.2022	1.366.400	0,03 %
UNEDIC A.S.SEO	1.300.000	0,88 %	25.10.2022	1.353.925	0,03 %
RTE Reseau de Transport d'Electricite SA	1.100.000	4,13 %	03.02.2021	1.239.586	0,03 %
La Poste SA	1.200.000	1,13 %	04.06.2025	1.233.970	0,03 %
Agence Francaise de Developpement	1.200.000	0,13 %	31.03.2021	1.208.520	0,03 %
Bpifrance Financement SA	1.200.000	0,10 %	19.02.2021	1.208.159	0,03 %
SNCF Reseau EPIC	1.000.000	4,38 %	02.06.2022	1.191.425	0,03 %
UNEDIC A.S.SEO	1.000.000	2,38 %	25.05.2024	1.137.672	0,02 %
Coentreprise de Transport d'Electricite SA	1.100.000	2,13 %	29.07.2032	1.137.408	0,02 %
Regie Autonome des Transports Parisiens	1.100.000	0,88 %	25.05.2027	1.102.688	0,02 %
RTE Reseau de Transport d'Electricite SA	1.000.000	1,63 %	08.10.2024	1.059.015	0,02 %
SNCF Reseau EPIC	1.000.000	2,25 %	20.12.2047	1.049.365	0,02 %
RTE Reseau de Transport d'Electricite SA	900.000	2,88 %	12.09.2023	1.018.535	0,02 %
UNEDIC A.S.SEO	1.000.000	0,30 %	04.11.2021	1.016.979	0,02 %
Agence Francaise de Developpement	900.000	2,25 %	27.05.2025	1.013.031	0,02 %
UNEDIC A.S.SEO	1.000.000	0,13 %	05.03.2020	1.008.770	0,02 %
Caisse Centrale du Credit Immobilier de France SA	1.000.000	0,13 %	05.02.2020	1.007.658	0,02 %
RTE Reseau de Transport d'Electricite SA	1.000.000	1,88 %	23.10.2037	1.002.748	0,02 %
Agence Francaise de Developpement	1.000.000	1,38 %	05.07.2032	1.002.212	0,02 %
Caisse des Depots et Consignations	950.000	4,13 %	20.02.2019	999.802	0,02 %
UNEDIC A.S.SEO	900.000	1,25 %	29.05.2020	933.963	0,02 %
RTE Reseau de Transport d'Electricite SA	800.000	1,63 %	27.11.2025	842.635	0,02 %
Agence Francaise de Developpement	700.000	4,00 %	14.03.2023	836.308	0,02 %
Agence Francaise de Developpement	800.000	0,50 %	25.10.2022	812.404	0,02 %
UNEDIC A.S.SEO	800.000	0,63 %	03.03.2026	811.554	0,02 %
Electricite de France SA	800.000	1,00 %	13.10.2026	783.341	0,02 %
SNCF Reseau EPIC	800.000	1,50 %	29.05.2037	779.875	0,02 %
Caisse Nationale des Autoroutes	600.000	3,75 %	15.07.2025	746.699	0,02 %
S.A. de Gestion de Stocks de Securite	700.000	1,75 %	22.10.2019	726.254	0,02 %
Aeroports de Paris	650.000	3,89 %	10.05.2020	709.566	0,02 %
Bpifrance Financement SA	700.000	0,13 %	25.11.2020	705.129	0,02 %
SNCF Reseau EPIC	700.000	1,13 %	25.05.2030	695.223	0,01 %
Region of Ile de France	600.000	2,38 %	24.04.2026	687.193	0,01 %
La Poste SA	600.000	2,75 %	26.11.2024	684.938	0,01 %
Region of Ile de France	600.000	2,25 %	10.06.2023	665.826	0,01 %
Electricite de France SA	450.000	5,63 %	21.02.2033	653.261	0,01 %
Electricite de France SA	450.000	4,50 %	12.11.2040	590.912	0,01 %
Aeroports de Paris	500.000	2,75 %	05.06.2028	576.514	0,01 %
S.A. de Gestion de Stocks de Securite	500.000	2,63 %	06.03.2025	575.251	0,01 %
S.A. de Gestion de Stocks de Securite	500.000	3,13 %	21.10.2022	571.396	0,01 %
La Banque Postale SA	500.000	4,38 %	30.11.2020	559.585	0,01 %
UNEDIC A.S.SEO	500.000	2,25 %	05.04.2023	556.950	0,01 %
Electricite de France SA^	500.000	5,00 %	22.01.2166	554.341	0,01 %
La Banque Postale SA^	500.000	2,75 %	19.11.2027	536.929	0,01 %
La Banque Postale SA^	500.000	2,75 %	23.04.2026	529.827	0,01 %
Aeroports de Paris	500.000	1,50 %	07.04.2025	524.220	0,01 %
UNEDIC A.S.SEO	500.000	0,63 %	17.02.2025	510.803	0,01 %
Agence France Locale	500.000	0,38 %	20.03.2022	507.188	0,01 %
Agence Francaise de Developpement	400.000	3,75 %	15.02.2027	504.555	0,01 %
Bpifrance Financement SA	500.000	0,50 %	25.05.2025	500.648	0,01 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
RTE Réseau de Transport d'Electricite SA	500.000	1,00 %	19.10.2026	499.673	0,01 %
Electricite de France SA^	400.000	4,25 %	29.01.2166	423.920	0,01 %
S.A. de Gestion de Stocks de Securite	300.000	4,00 %	24.01.2024	367.142	0,01 %
Aeroports de Paris	300.000	1,50 %	24.07.2023	316.087	0,01 %
Region of Ile de France	300.000	0,63 %	23.04.2027	294.990	0,01 %
Aeroports de Paris	200.000	3,13 %	11.06.2024	231.288	0,01 %
Agence Francaise de Developpement	100.000	1,25 %	25.05.2019	102.255	0,00 %
				1.181.150.041	24,64 %
Deutschland 20,92 % (2016: 21,83 %)					
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	23.637.495	5,50 %	04.01.2031	37.865.967	0,79 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	20.260.000	5,63 %	04.01.2028	30.512.168	0,64 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	18.566.000	4,00 %	04.01.2037	28.392.947	0,59 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	23.640.000	3,50 %	04.07.2019	25.149.887	0,52 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	18.900.000	2,50 %	15.08.2046	24.796.422	0,52 %
Bundesobligation	24.000.000	0,00 %	08.10.2021	24.341.040	0,51 %
Bundesobligation	23.000.000	0,00 %	08.04.2022	23.283.590	0,49 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	22.600.000	0,50 %	15.08.2027	22.744.685	0,47 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	20.550.000	3,00 %	04.07.2020	22.396.993	0,47 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	19.150.000	3,25 %	04.07.2021	21.636.896	0,45 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	19.665.000	3,25 %	04.01.2020	21.203.039	0,44 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	15.450.000	2,50 %	04.07.2044	20.087.503	0,42 %
Bundesobligation	18.500.000	0,50 %	12.04.2019	18.781.977	0,39 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	12.550.000	3,25 %	04.07.2042	18.288.952	0,38 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	16.800.000	1,00 %	15.08.2025	17.872.478	0,37 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	17.350.000	0,25 %	15.02.2027	17.175.667	0,36 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	15.750.000	1,50 %	04.09.2022	17.039.421	0,36 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	14.950.000	1,75 %	04.07.2022	16.321.184	0,34 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	10.076.000	4,75 %	04.07.2034	16.126.799	0,34 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	14.100.000	2,00 %	15.08.2023	15.757.229	0,33 %
KFW	15.000.000	0,00 %	30.06.2021	15.141.735	0,32 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	8.559.000	4,25 %	04.07.2039	13.893.482	0,29 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	12.575.000	2,00 %	04.01.2022	13.763.602	0,29 %
Bundesobligation	13.000.000	0,25 %	16.10.2020	13.288.886	0,28 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	12.150.000	1,50 %	15.05.2023	13.211.545	0,28 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	11.700.000	1,75 %	15.02.2024	12.966.712	0,27 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	11.760.000	1,50 %	15.05.2024	12.871.673	0,27 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	11.600.000	1,00 %	15.08.2024	12.334.744	0,26 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	11.125.000	2,50 %	04.01.2021	12.136.084	0,25 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	6.265.000	4,75 %	04.07.2040	10.928.666	0,23 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	6.525.000	6,25 %	04.01.2030	10.808.297	0,23 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	9.650.000	1,50 %	15.02.2023	10.471.987	0,22 %
Bundesschatzanweisungen	10.340.000	0,00 %	14.12.2018	10.404.108	0,22 %
FMS Wertmanagement Aoer	10.000.000	0,00 %	17.02.2020	10.085.750	0,21 %
KFW	8.600.000	3,38 %	18.01.2021	9.578.723	0,20 %
Land Nordrhein-Westfalen	9.200.000	0,20 %	16.02.2024	9.170.431	0,19 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	6.297.000	4,75 %	04.07.2028	9.026.221	0,19 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	5.650.000	6,50 %	04.07.2027	8.864.296	0,19 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	7.900.000	2,25 %	04.09.2021	8.673.773	0,18 %
Bundesobligation	8.500.000	0,25 %	11.10.2019	8.636.094	0,18 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	8.000.000	2,25 %	04.09.2020	8.603.376	0,18 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	5.693.000	6,25 %	04.01.2024	7.837.411	0,16 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	7.354.000	3,75 %	04.01.2019	7.682.768	0,16 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	6.900.000	0,50 %	15.02.2025	7.092.510	0,15 %
Bundesobligation	7.000.000	0,00 %	07.10.2022	7.065.310	0,15 %
KFW	6.575.000	0,88 %	18.03.2019	6.691.857	0,14 %
KFW	6.000.000	1,88 %	20.03.2019	6.178.680	0,13 %
Bundesobligation	6.000.000	0,00 %	09.04.2021	6.089.730	0,13 %
KFW	6.000.000	0,00 %	15.09.2023	5.969.076	0,12 %
KFW	5.000.000	1,25 %	17.10.2019	5.161.390	0,11 %
Bundesobligation	5.000.000	1,00 %	22.02.2019	5.098.050	0,11 %
Land Niedersachsen	5.000.000	0,00 %	01.03.2021	5.034.620	0,11 %
KFW	5.000.000	0,63 %	22.02.2027	5.034.400	0,11 %
KFW	4.423.000	3,50 %	04.07.2021	5.006.955	0,10 %
NRW Bank	5.000.000	0,50 %	11.05.2026	4.976.195	0,10 %
KFW	5.000.000	0,50 %	15.09.2027	4.950.340	0,10 %
Land Hessen	4.550.000	1,75 %	19.06.2020	4.786.550	0,10 %
Land Rheinland-Pfalz	4.600.000	0,00 %	23.03.2020	4.638.120	0,10 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
KFW	4.175.000	0,63 %	15.01.2025	4.277.893	0,09 %
KFW	4.000.000	0,63 %	04.07.2022	4.132.604	0,09 %
FMS Wertmanagement AoeR	3.300.000	3,00 %	08.09.2021	3.681.038	0,08 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	3.500.000	0,38 %	23.06.2020	3.561.250	0,07 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	3.500.000	0,38 %	22.01.2024	3.542.966	0,07 %
NRW Bank	3.400.000	0,25 %	16.05.2024	3.386.995	0,07 %
KFW	3.250.000	1,13 %	15.01.2020	3.358.040	0,07 %
Land Hessen	3.100.000	1,40 %	12.12.2022	3.305.790	0,07 %
KFW	3.000.000	3,63 %	20.01.2020	3.254.976	0,07 %
Bundesland Berlin Deutschland	3.000.000	0,50 %	10.02.2025	3.026.340	0,06 %
KFW	3.000.000	1,25 %	04.07.2036	3.022.398	0,06 %
Land Niedersachsen	3.000.000	0,00 %	10.01.2022	3.009.957	0,06 %
Land Nordrhein-Westfalen	3.000.000	0,00 %	05.12.2022	2.993.253	0,06 %
KFW	3.000.000	0,38 %	09.03.2026	2.989.998	0,06 %
Free & Hanseatic City of Hamburg	3.000.000	0,25 %	20.01.2025	2.977.149	0,06 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	2.900.000	0,50 %	15.02.2026	2.966.851	0,06 %
FMS Wertmanagement AoeR	2.800.000	1,88 %	09.05.2019	2.889.303	0,06 %
Land Nordrhein-Westfalen	2.700.000	1,50 %	15.12.2020	2.841.469	0,06 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	2.800.000	0,63 %	18.05.2027	2.799.742	0,06 %
KFW	2.700.000	0,00 %	28.04.2022	2.717.072	0,06 %
KFW	2.500.000	1,63 %	15.01.2021	2.650.167	0,06 %
Land Nordrhein-Westfalen	2.450.000	1,38 %	16.05.2022	2.598.784	0,05 %
Land Nordrhein-Westfalen	2.200.000	2,38 %	13.05.2033	2.551.820	0,05 %
KFW	2.500.000	0,38 %	15.03.2023	2.546.257	0,05 %
KFW	2.500.000	0,13 %	01.06.2020	2.533.525	0,05 %
NRW Bank	2.500.000	0,13 %	18.01.2021	2.525.400	0,05 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	2.500.000	0,13 %	14.04.2023	2.502.055	0,05 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	2.500.000	1,25 %	15.08.2048	2.491.252	0,05 %
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	2.300.000	0,38 %	10.03.2020	2.317.889	0,05 %
Land Berlin	2.000.000	0,75 %	08.09.2023	2.065.300	0,04 %
Land Nordrhein-Westfalen	2.000.000	1,75 %	26.10.2057	2.043.388	0,04 %
Land Rheinland-Pfalz	2.000.000	0,75 %	19.01.2026	2.038.330	0,04 %
KFW	2.000.000	0,00 %	29.04.2019	2.015.392	0,04 %
Land Niedersachsen	2.000.000	0,25 %	06.02.2024	2.004.322	0,04 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	2.000.000	0,25 %	18.03.2024	2.000.568	0,04 %
Land Nordrhein-Westfalen	2.000.000	0,50 %	16.04.2026	1.995.128	0,04 %
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	2.000.000	0,38 %	13.04.2026	1.975.314	0,04 %
Land Berlin	1.870.000	1,50 %	21.01.2021	1.970.138	0,04 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	2.000.000	0,63 %	26.09.2028	1.947.564	0,04 %
KFW	1.850.000	3,88 %	21.01.2019	1.936.950	0,04 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	1.850.000	2,00 %	20.02.2019	1.903.855	0,04 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	2.000.000	0,88 %	11.07.2031	1.899.508	0,04 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	1.900.000	0,25 %	29.08.2025	1.880.635	0,04 %
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	1.800.000	0,13 %	05.11.2020	1.818.144	0,04 %
Land Rheinland-Pfalz	1.800.000	0,50 %	21.01.2025	1.814.688	0,04 %
Land Nordrhein-Westfalen	1.650.000	1,88 %	15.09.2022	1.793.873	0,04 %
Land Baden-Württemberg	1.600.000	2,00 %	13.11.2023	1.770.536	0,04 %
Land Berlin	2.000.000	0,63 %	25.08.2036	1.759.340	0,04 %
Land Nordrhein-Westfalen	1.700.000	0,88 %	16.12.2019	1.743.392	0,04 %
Land Nordrhein-Westfalen	2.000.000	0,75 %	16.08.2041	1.708.910	0,04 %
Land Hessen	1.550.000	1,75 %	20.01.2023	1.680.333	0,04 %
Land Rheinland-Pfalz	1.700.000	0,10 %	18.08.2026	1.633.666	0,03 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	1.500.000	1,25 %	20.05.2022	1.590.622	0,03 %
Land Baden-Württemberg	1.500.000	1,00 %	18.07.2022	1.569.935	0,03 %
Land Niedersachsen	1.500.000	1,00 %	18.08.2022	1.568.681	0,03 %
Bundesland Berlin Deutschland	1.500.000	0,25 %	15.07.2020	1.522.242	0,03 %
Land Niedersachsen	1.500.000	0,38 %	19.01.2023	1.521.618	0,03 %
Land Hessen	1.400.000	2,75 %	22.09.2020	1.516.889	0,03 %
FMS Wertmanagement AoeR	1.500.000	0,13 %	16.04.2020	1.516.719	0,03 %
Land Hessen	1.500.000	0,13 %	14.10.2019	1.515.440	0,03 %
Land Nordrhein-Westfalen	1.500.000	0,13 %	16.03.2023	1.500.479	0,03 %
Land Hessen	1.400.000	1,38 %	10.06.2024	1.497.653	0,03 %
Land Berlin	1.350.000	1,63 %	03.06.2024	1.465.602	0,03 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.500.000	0,00 %	15.08.2026	1.463.220	0,03 %
FMS Wertmanagement AoeR	1.400.000	1,38 %	15.01.2020	1.451.075	0,03 %
Bund Laender Anleihe	1.200.000	1,50 %	15.07.2020	1.256.771	0,03 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
KFW	1.300.000	0,38 %	23.04.2030	1.224.513	0,03 %
Land Hessen	1.175.000	0,88 %	10.12.2024	1.217.676	0,03 %
Land Baden-Württemberg	1.200.000	0,63 %	27.01.2026	1.212.712	0,03 %
NRW Bank	1.050.000	3,88 %	27.01.2020	1.141.664	0,02 %
Wirtschafts- und Infrastrukturbank Hessen	1.050.000	1,75 %	15.04.2024	1.134.119	0,02 %
EnBW International Finance BV	1.000.000	2,50 %	04.06.2026	1.131.058	0,02 %
Land Nordrhein-Westfalen	950.000	4,38 %	29.04.2022	1.130.812	0,02 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	1.100.000	1,50 %	08.12.2032	1.122.142	0,02 %
Bundesland Berlin Deutschland	1.000.000	3,13 %	17.08.2021	1.119.089	0,02 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	1.100.000	0,25 %	15.07.2024	1.101.227	0,02 %
Bayerische Landesbodenkreditanstalt	1.000.000	1,88 %	25.01.2023	1.084.360	0,02 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	1.000.000	5,00 %	24.07.2019	1.082.419	0,02 %
EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG^	1.000.000	3,38 %	05.04.2077	1.076.115	0,02 %
Freistaat Bayern	1.000.000	2,38 %	08.09.2020	1.072.256	0,02 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	950.000	2,88 %	30.08.2021	1.058.772	0,02 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	1.000.000	1,13 %	30.09.2024	1.053.893	0,02 %
Land Nordrhein-Westfalen	1.000.000	1,50 %	14.01.2021	1.053.534	0,02 %
Land Niedersachsen	950.000	2,75 %	13.09.2021	1.051.355	0,02 %
Land Rheinland-Pfalz	950.000	2,38 %	23.02.2022	1.045.775	0,02 %
Land Thuringen	1.000.000	0,88 %	25.11.2024	1.036.037	0,02 %
Free & Hanseatic City of Hamburg	950.000	1,88 %	26.09.2022	1.032.488	0,02 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	950.000	1,75 %	31.01.2023	1.029.937	0,02 %
Land Nordrhein-Westfalen	1.000.000	0,50 %	15.12.2021	1.023.624	0,02 %
Land Bremen	1.000.000	0,50 %	07.10.2022	1.021.099	0,02 %
Land Baden-Wuerttemberg	1.000.000	0,63 %	16.01.2025	1.018.602	0,02 %
Bayerische Landesbodenkreditanstalt	1.000.000	0,75 %	28.05.2025	1.017.921	0,02 %
KFW	1.000.000	0,13 %	27.10.2020	1.014.535	0,02 %
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	1.000.000	0,25 %	25.11.2019	1.012.756	0,02 %
FMS Wertmanagement AoeR	900.000	3,38 %	17.06.2021	1.011.129	0,02 %
Land Niedersachsen	950.000	1,63 %	23.07.2021	1.010.457	0,02 %
Land Berlin	1.000.000	0,63 %	20.03.2026	1.008.666	0,02 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	1.000.000	0,50 %	05.02.2025	1.008.504	0,02 %
FMS Wertmanagement AoeR	1.000.000	0,05 %	06.07.2021	1.007.370	0,02 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg	1.000.000	0,50 %	07.06.2022	1.002.295	0,02 %
Bayerische Landesbodenkreditanstalt	1.000.000	0,63 %	23.11.2026	997.114	0,02 %
Land Baden-Wuerttemberg	950.000	4,00 %	22.01.2019	995.353	0,02 %
Land Berlin	1.000.000	0,25 %	22.04.2025	989.002	0,02 %
Land Brandenburg	950.000	1,50 %	12.02.2020	987.859	0,02 %
Land Niedersachsen	950.000	1,25 %	10.01.2020	982.135	0,02 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	950.000	1,38 %	11.10.2019	980.839	0,02 %
Land Nordrhein-Westfalen	950.000	1,25 %	15.01.2019	967.290	0,02 %
Land Thuringen	1.000.000	0,20 %	26.10.2026	966.472	0,02 %
Land Sachsen-Anhalt	850.000	1,63 %	25.04.2023	917.662	0,02 %
Land Hessen	1.000.000	0,75 %	04.08.2036	899.998	0,02 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	1.000.000	0,63 %	31.10.2036	894.053	0,02 %
Bundesland Berlin Deutschland	850.000	1,50 %	28.08.2020	891.079	0,02 %
Land Nordrhein-Westfalen	1.000.000	1,00 %	16.10.2046	876.475	0,02 %
Land Nordrhein-Westfalen	750.000	2,00 %	15.10.2025	838.051	0,02 %
Land Hessen	750.000	3,00 %	23.08.2021	836.308	0,02 %
Free & Hanseatic City of Hamburg	800.000	0,38 %	20.01.2022	814.268	0,02 %
NRW Bank	800.000	1,13 %	23.01.2019	813.198	0,02 %
Land Nordrhein-Westfalen	800.000	0,20 %	17.04.2023	802.960	0,02 %
Land Rheinland-Pfalz	750.000	1,25 %	16.01.2020	775.513	0,02 %
Land Berlin	700.000	1,88 %	12.06.2023	766.013	0,02 %
Land Niedersachsen	750.000	0,40 %	10.07.2020	763.647	0,02 %
Land Nordrhein-Westfalen	700.000	1,25 %	14.03.2025	742.436	0,02 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	700.000	1,50 %	29.01.2021	737.595	0,02 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	650.000	3,75 %	01.06.2021	734.755	0,02 %
Land Nordrhein-Westfalen	700.000	0,38 %	16.02.2023	710.058	0,01 %
Land Niedersachsen	700.000	0,13 %	12.08.2019	706.553	0,01 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	650.000	1,75 %	13.06.2022	701.420	0,01 %
Land Nordrhein-Westfalen	700.000	1,25 %	12.05.2036	687.618	0,01 %
Land Hessen	600.000	1,13 %	10.12.2021	629.152	0,01 %
Land Hessen	600.000	0,38 %	10.03.2022	610.859	0,01 %
Land Hessen	600.000	0,38 %	04.07.2022	610.499	0,01 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg	600.000	0,38 %	29.01.2019	603.311	0,01 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Land Nordrhein-Westfalen	500.000	1,88 %	15.03.2024	549.862	0,01 %
Land Rheinland-Pfalz	500.000	1,75 %	05.09.2022	540.273	0,01 %
EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG^	500.000	3,63 %	02.04.2076	538.086	0,01 %
NRW Bank	500.000	4,25 %	29.04.2019	531.131	0,01 %
Land Nordrhein-Westfalen	500.000	1,00 %	16.01.2025	522.165	0,01 %
Land Niedersachsen	503.000	1,38 %	26.09.2019	518.922	0,01 %
NRW Bank	500.000	0,88 %	10.11.2025	514.628	0,01 %
Land Rheinland-Pfalz	500.000	0,50 %	03.09.2021	511.783	0,01 %
Land Sachsen-Anhalt	450.000	3,75 %	06.04.2021	508.241	0,01 %
Land Hessen	500.000	0,50 %	17.02.2025	504.240	0,01 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	450.000	2,50 %	12.09.2023	504.157	0,01 %
Land Thueringen	500.000	0,50 %	12.05.2025	503.204	0,01 %
Land Niedersachsen	450.000	2,13 %	16.01.2024	501.230	0,01 %
Land Nordrhein-Westfalen	450.000	1,25 %	13.03.2020	466.235	0,01 %
KFW	450.000	0,38 %	22.07.2019	456.604	0,01 %
EWE AG	400.000	4,13 %	04.11.2020	445.348	0,01 %
Land Niedersachsen	400.000	2,13 %	11.10.2023	444.646	0,01 %
Land Bremen	400.000	1,88 %	18.03.2024	438.616	0,01 %
EWE AG	400.000	4,88 %	14.10.2019	435.239	0,01 %
Land Nordrhein-Westfalen	400.000	1,63 %	24.10.2030	425.523	0,01 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	350.000	3,38 %	04.11.2022	404.336	0,01 %
Land Bremen	400.000	0,50 %	03.03.2025	401.750	0,01 %
Free & Hanseatic City of Hamburg	400.000	0,38 %	01.04.2025	399.258	0,01 %
EnBW International Finance BV	300.000	4,88 %	16.01.2025	386.168	0,01 %
Free & Hanseatic City of Hamburg	350.000	1,88 %	27.02.2024	384.648	0,01 %
Land Hessen	350.000	1,38 %	05.02.2020	363.106	0,01 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	300.000	2,75 %	19.03.2029	352.423	0,01 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	300.000	2,00 %	20.02.2023	326.525	0,01 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	300.000	1,63 %	06.11.2030	315.932	0,01 %
Land Bremen	300.000	1,38 %	28.04.2021	315.438	0,01 %
EWE AG	250.000	5,25 %	16.07.2021	294.871	0,01 %
FMS Wertmanagement AoeR	300.000	0,38 %	29.04.2030	278.632	0,01 %
EnBW International Finance BV	150.000	6,13 %	07.07.2039	250.431	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	200.000	0,63 %	20.02.2030	193.602	0,00 %
FMS Wertmanagement AoeR	100.000	0,00 %	26.02.2019	100.555	0,00 %
				1.002.963.708	20,92 %
Irland 1,70 % (2016: 1,63 %)					
Ireland Government Bond	8.050.000	5,40 %	13.03.2025	10.873.634	0,23 %
Ireland Government Bond	9.500.000	5,90 %	18.10.2019	10.587.104	0,22 %
Ireland Government Bond	10.030.000	1,00 %	15.05.2026	10.287.370	0,21 %
Ireland Government Bond	9.200.000	0,00 %	18.10.2022	9.181.223	0,19 %
Ireland Government Bond	6.931.000	4,50 %	18.04.2020	7.730.782	0,16 %
Ireland Government Bond	5.270.000	2,40 %	15.05.2030	6.063.346	0,13 %
Ireland Government Bond	4.650.000	3,40 %	18.03.2024	5.547.636	0,12 %
Ireland Government Bond	4.800.000	2,00 %	18.02.2045	5.030.467	0,11 %
Ireland Government Bond	4.000.000	3,90 %	20.03.2023	4.790.256	0,10 %
Ireland Government Bond	3.940.000	1,70 %	15.05.2037	4.064.134	0,09 %
Ireland Government Bond	3.681.000	4,40 %	18.06.2019	3.945.465	0,08 %
Ireland Government Bond	1.700.000	5,00 %	18.10.2020	1.960.379	0,04 %
ESB Finance DAC	600.000	3,49 %	12.01.2024	696.576	0,01 %
ESB Finance DAC	600.000	2,13 %	08.06.2027	648.584	0,01 %
				81.406.956	1,70 %
Italien 20,59 % (2016: 20,75 %)					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	56.460.000	2,05 %	01.08.2027	56.776.684	1,18 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	34.850.000	4,50 %	01.02.2020	38.136.355	0,80 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	23.950.000	5,00 %	01.03.2022	28.312.013	0,59 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	27.000.000	1,45 %	15.09.2022	27.861.732	0,58 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	20.600.000	5,00 %	01.09.2040	26.926.672	0,56 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	26.000.000	1,05 %	01.12.2019	26.557.440	0,55 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	18.745.000	6,00 %	01.05.2031	26.439.373	0,55 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	24.000.000	2,00 %	01.12.2025	24.589.344	0,51 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	18.200.000	5,25 %	01.11.2029	23.853.393	0,50 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	23.100.000	1,50 %	01.06.2025	23.015.870	0,48 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	20.200.000	4,00 %	01.09.2020	22.292.801	0,47 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	18.350.000	4,50 %	01.03.2026	22.284.607	0,46 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	15.700.000	5,75 %	01.02.2033	21.892.080	0,46 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	20.500.000	2,50 %	01.05.2019	21.249.993	0,44 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	21.400.000	0,65 %	15.10.2023	20.882.334	0,44 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	17.356.000	4,00 %	01.02.2037	20.373.306	0,42 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	18.000.000	2,50 %	01.12.2024	19.292.436	0,40 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	16.300.000	4,50 %	01.05.2023	19.289.224	0,40 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	19.400.000	2,45 %	01.09.2033	19.021.118	0,40 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	16.350.000	4,75 %	01.09.2021	18.943.110	0,40 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	14.298.000	5,00 %	01.08.2034	18.764.123	0,39 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	15.300.000	4,75 %	01.08.2023	18.425.790	0,38 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	15.350.000	4,50 %	01.03.2024	18.313.625	0,38 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	18.500.000	1,60 %	01.06.2026	18.250.990	0,38 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	15.750.000	3,75 %	01.08.2021	17.639.055	0,37 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	15.900.000	4,25 %	01.09.2019	17.068.777	0,36 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	15.500.000	4,25 %	01.03.2020	16.936.509	0,35 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	15.175.000	3,75 %	01.03.2021	16.838.089	0,35 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	15.950.000	4,50 %	01.03.2019	16.830.615	0,35 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	16.000.000	2,20 %	01.06.2027	16.345.760	0,34 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	12.300.000	5,00 %	01.08.2039	16.132.938	0,34 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	15.200.000	1,35 %	15.04.2022	15.658.128	0,33 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	13.500.000	3,75 %	01.09.2024	15.558.750	0,32 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	13.400.000	3,75 %	01.05.2021	14.917.604	0,31 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	10.900.000	4,75 %	01.09.2044	13.968.132	0,29 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	11.300.000	5,50 %	01.11.2022	13.825.618	0,29 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	13.500.000	0,65 %	01.11.2020	13.692.591	0,29 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	9.300.000	7,25 %	01.11.2026	13.448.042	0,28 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	12.602.000	3,45 %	01.03.2048	13.073.700	0,27 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	13.000.000	0,35 %	01.11.2021	12.967.266	0,27 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	12.175.000	4,25 %	01.02.2019	12.768.945	0,27 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	11.000.000	3,50 %	01.03.2030	12.347.929	0,26 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	11.500.000	2,15 %	15.12.2021	12.240.727	0,26 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	9.450.000	4,75 %	01.09.2028	11.808.134	0,25 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	9.100.000	5,50 %	01.09.2022	11.097.614	0,23 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	10.000.000	0,35 %	15.06.2020	10.068.590	0,21 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	9.000.000	1,50 %	01.08.2019	9.239.688	0,19 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	9.100.000	0,95 %	15.03.2023	9.114.560	0,19 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	9.000.000	0,10 %	15.04.2019	9.041.103	0,19 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	7.500.000	0,45 %	01.06.2021	7.538.355	0,16 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	5.100.000	9,00 %	01.11.2023	7.372.560	0,15 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	8.110.000	2,80 %	01.03.2067	7.014.696	0,15 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	6.300.000	3,25 %	01.09.2046	6.415.353	0,13 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4.850.000	5,00 %	01.03.2025	6.014.490	0,13 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	5.500.000	2,25 %	01.09.2036	5.082.033	0,11 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	5.000.000	1,45 %	15.11.2024	5.016.180	0,10 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4.500.000	1,25 %	01.12.2026	4.291.461	0,09 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4.000.000	0,70 %	01.05.2020	4.062.552	0,08 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	2.000.000	3,75 %	01.03.2021	2.219.188	0,05 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	2.000.000	1,20 %	01.04.2022	2.048.112	0,04 %
Ferrovie dello Stato Italiane SpA	2.000.000	0,88 %	07.12.2023	1.989.676	0,04 %
Hera SpA	1.200.000	2,38 %	04.07.2024	1.320.216	0,03 %
Hera SpA	500.000	5,20 %	29.01.2028	660.779	0,01 %
ACEA SpA	500.000	2,63 %	15.07.2024	550.908	0,01 %
Cassa Depositi e Prestiti SpA	500.000	2,38 %	12.02.2019	514.029	0,01 %
Cassa Depositi e Prestiti SpA	400.000	1,50 %	09.04.2025	392.408	0,01 %
Cassa Depositi e Prestiti SpA	300.000	2,75 %	31.05.2021	323.216	0,01 %
				987.199.489	20,59 %
Lettland 0,06 % (2016: 0,04 %)					
Latvia Government International Bond	1.000.000	2,25 %	15.02.2047	1.107.550	0,02 %
Latvia Government International Bond	800.000	2,63 %	21.01.2021	869.184	0,02 %
Latvia Government International Bond	600.000	0,38 %	07.10.2026	588.636	0,01 %
Latvia Government International Bond	300.000	2,88 %	30.04.2024	350.100	0,01 %
				2.915.470	0,06 %
Litauen 0,05 % (2016: 0,06 %)					
Lithuania Government International Bond	1.000.000	2,13 %	22.10.2035	1.119.500	0,02 %
Lithuania Government International Bond	1.000.000	1,25 %	22.10.2025	1.055.008	0,02 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Lithuania Government International Bond	300.000	3,38 %	22.01.2024	356.985	0,01 %
Lithuania Government International Bond	100.000	2,13 %	29.10.2026	112.620	0,00 %
				2.644.113	0,05 %
Luxemburg 0,12 % (2016: 0,09 %)					
Luxembourg Government Bond	2.000.000	0,63 %	01.02.2027	2.009.980	0,04 %
Luxembourg Government Bond	1.400.000	3,38 %	18.05.2020	1.526.318	0,03 %
Luxembourg Government Bond	1.250.000	2,13 %	10.07.2023	1.394.875	0,03 %
Luxembourg Government Bond	700.000	2,25 %	21.03.2022	771.784	0,02 %
				5.702.957	0,12 %
Niederlande 5,52 % (2016: 5,89 %)					
Netherlands Government Bond	14.197.596	4,00 %	15.01.2037	21.610.842	0,45 %
Netherlands Government Bond	18.400.000	2,00 %	15.07.2024	20.674.976	0,43 %
Netherlands Government Bond	9.800.000	2,75 %	15.01.2047	13.333.370	0,28 %
Netherlands Government Bond	8.898.834	5,50 %	15.01.2028	13.227.227	0,28 %
Netherlands Government Bond	12.950.000	1,25 %	15.01.2019	13.207.912	0,28 %
Netherlands Government Bond	10.450.000	2,50 %	15.01.2033	12.817.970	0,27 %
Netherlands Government Bond	8.150.000	3,75 %	15.01.2042	12.645.744	0,26 %
Netherlands Government Bond	11.350.000	2,25 %	15.07.2022	12.623.209	0,26 %
Netherlands Government Bond	11.500.000	0,25 %	15.01.2020	11.699.939	0,24 %
Netherlands Government Bond	10.100.000	0,25 %	15.07.2025	10.097.394	0,21 %
Netherlands Government Bond	7.900.000	3,75 %	15.01.2023	9.448.937	0,20 %
Netherlands Government Bond	8.592.000	4,00 %	15.07.2019	9.208.158	0,19 %
Netherlands Government Bond	7.850.000	3,50 %	15.07.2020	8.655.959	0,18 %
Netherlands Government Bond	8.500.000	0,50 %	15.07.2026	8.587.032	0,18 %
Netherlands Government Bond	7.000.000	1,75 %	15.07.2023	7.692.923	0,16 %
Netherlands Government Bond	6.600.000	3,25 %	15.07.2021	7.456.574	0,16 %
Netherlands Government Bond	6.750.000	1,75 %	15.07.2023	7.418.176	0,15 %
Netherlands Government Bond	5.500.000	0,00 %	15.01.2022	5.558.905	0,12 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	4.000.000	0,75 %	04.10.2041	3.380.152	0,07 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	3.000.000	2,63 %	01.09.2020	3.238.527	0,07 %
Netherlands Government Bond	3.000.000	0,75 %	15.07.2027	3.059.787	0,06 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	2.800.000	0,50 %	27.10.2022	2.858.442	0,06 %
Netherlands Government Bond	1.633.513	7,50 %	15.01.2023	2.260.238	0,05 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	2.000.000	3,00 %	25.10.2021	2.237.970	0,05 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	2.000.000	0,50 %	26.08.2022	2.046.650	0,04 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	2.000.000	0,38 %	14.01.2022	2.036.682	0,04 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	2.000.000	0,13 %	03.11.2020	2.024.336	0,04 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	1.950.000	1,88 %	06.06.2019	2.015.463	0,04 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	2.000.000	0,25 %	07.06.2024	1.999.454	0,04 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	1.900.000	0,38 %	14.10.2019	1.928.880	0,04 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	1.750.000	3,88 %	17.02.2020	1.909.810	0,04 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	1.700.000	0,63 %	19.06.2027	1.695.024	0,04 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	1.500.000	1,00 %	12.01.2026	1.560.282	0,03 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	1.500.000	0,50 %	19.01.2023	1.532.045	0,03 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	1.500.000	0,63 %	03.07.2019	1.525.181	0,03 %
Nederlandse Financierings Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV	1.400.000	0,13 %	04.11.2020	1.415.917	0,03 %
TenneT Holding BV	1.000.000	2,13 %	01.11.2020	1.059.235	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	1.000.000	1,38 %	21.10.2030	1.038.962	0,02 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	1.000.000	1,63 %	23.08.2019	1.033.963	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	950.000	3,75 %	14.01.2020	1.031.480	0,02 %
Nederlandse Gasunie NV	900.000	3,63 %	13.10.2021	1.020.550	0,02 %
Nederlandse Gasunie NV	1.000.000	1,00 %	11.05.2026	1.017.240	0,02 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	900.000	0,05 %	10.02.2021	908.381	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	750.000	3,88 %	26.05.2023	902.213	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	750.000	2,25 %	30.08.2022	828.443	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	750.000	1,50 %	15.04.2020	782.613	0,02 %
Alliander NV	700.000	4,50 %	17.12.2019	763.755	0,02 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	600.000	3,00 %	11.09.2031	739.717	0,02 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	600.000	1,13 %	28.01.2019	610.372	0,01 %
TenneT Holding BV	600.000	1,00 %	13.06.2026	604.578	0,01 %
Royal Schiphol Group NV	500.000	4,43 %	28.04.2021	569.677	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	500.000	1,88 %	14.01.2021	532.410	0,01 %
TenneT Holding BV	450.000	4,50 %	09.02.2022	528.999	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	500.000	1,13 %	04.09.2024	528.373	0,01 %
TenneT Holding BV	500.000	0,88 %	04.06.2021	512.850	0,01 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Nederlandse Financierings Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV	500.000	0,13 %	20.04.2022	503.728	0,01 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	400.000	3,25 %	09.03.2027	492.352	0,01 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	500.000	1,25 %	27.05.2036	489.889	0,01 %
TenneT Holding BV	400.000	4,63 %	21.02.2023	486.451	0,01 %
TenneT Holding BV	500.000	1,25 %	24.10.2033	479.538	0,01 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	500.000	0,50 %	29.04.2030	470.071	0,01 %
Alliander NV	400.000	2,25 %	14.11.2022	438.848	0,01 %
Enexis Holding NV	400.000	1,88 %	13.11.2020	421.388	0,01 %
Netherlands Government Bond	400.000	1,00 %	18.02.2019	406.614	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	400.000	0,25 %	07.05.2025	396.136	0,01 %
Enexis Holding NV	300.000	0,88 %	28.04.2026	298.527	0,01 %
				264.587.440	5,52 %
Portugal 1,44 % (2016: 0,00 %)					
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT	40.000.000	2,88 %	15.10.2025	44.072.800	0,92 %
Obrigacoes do Tesouro	9.960.000	4,80 %	15.06.2020	11.120.539	0,23 %
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT	6.300.000	4,10 %	15.02.2045	7.363.528	0,15 %
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT	3.100.000	4,13 %	14.04.2027	3.674.362	0,08 %
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT	2.400.000	4,10 %	15.04.2037	2.856.072	0,06 %
				69.087.301	1,44 %
Slowakei 0,44 % (2016: 0,39 %)					
Slovakia Government Bond	3.800.000	0,00 %	13.11.2023	3.752.029	0,08 %
Slovakia Government Bond	3.200.000	1,63 %	21.01.2031	3.351.213	0,07 %
Slovakia Government Bond	2.400.000	3,00 %	28.02.2023	2.784.982	0,06 %
Slovakia Government Bond	2.500.000	0,63 %	22.05.2026	2.506.250	0,05 %
Slovakia Government Bond	1.750.000	4,35 %	14.10.2025	2.309.039	0,05 %
Slovakia Government Bond	1.300.000	1,88 %	09.03.2037	1.357.041	0,03 %
Slovakia Government Bond	950.000	4,00 %	27.04.2020	1.046.159	0,02 %
Slovakia Government Bond	1.000.000	2,00 %	17.10.2047	1.041.808	0,02 %
SPP Infrastructure Financing BV	700.000	2,63 %	12.02.2025	747.670	0,02 %
Slovakia Government Bond	700.000	1,38 %	21.01.2027	740.628	0,01 %
Slovakia Government Bond	500.000	3,63 %	16.01.2029	635.962	0,01 %
Slovakia Government International Bond	400.000	4,00 %	26.03.2021	458.580	0,01 %
SPP Infrastructure Financing BV	300.000	3,75 %	18.07.2020	326.349	0,01 %
				21.057.710	0,44 %
Slowenien 0,33 % (2016: 0,31 %)					
Staatsanleihe von Slowenien	5.714.000	2,25 %	25.03.2022	6.299.342	0,13 %
Staatsanleihe von Slowenien	2.800.000	1,75 %	03.11.2040	2.777.947	0,06 %
Staatsanleihe von Slowenien	1.850.000	4,63 %	09.09.2024	2.402.591	0,05 %
Staatsanleihe von Slowenien	1.500.000	3,13 %	07.08.2045	1.893.711	0,04 %
Staatsanleihe von Slowenien	950.000	4,13 %	26.01.2020	1.037.900	0,02 %
Staatsanleihe von Slowenien	900.000	2,13 %	28.07.2025	1.007.793	0,02 %
Staatsanleihe von Slowenien	600.000	1,50 %	25.03.2035	591.909	0,01 %
				16.011.193	0,33 %
Spanien 12,27 % (2016: 12,33 %)					
Spain Government Bond	31.600.000	5,90 %	30.07.2026	43.444.091	0,91 %
Spain Government Bond	32.000.000	4,00 %	30.04.2020	35.110.400	0,73 %
Spain Government Bond	23.900.000	5,85 %	31.01.2022	29.400.991	0,61 %
Spain Government Bond	16.335.785	6,00 %	31.01.2029	23.379.383	0,49 %
Spain Government Bond	20.000.000	2,75 %	31.10.2024	22.544.000	0,47 %
Spain Government Bond	19.853.000	4,60 %	30.07.2019	21.395.896	0,45 %
Spain Government Bond	19.990.000	1,95 %	30.04.2026	21.083.913	0,44 %
Spain Government Bond	20.700.000	2,35 %	30.07.2033	21.031.200	0,44 %
Spain Government Bond	13.513.000	5,75 %	30.07.2032	19.834.395	0,41 %
Spain Government Bond	13.489.000	4,90 %	30.07.2040	18.900.382	0,39 %
Spain Government Bond	17.300.000	2,75 %	30.04.2019	18.010.182	0,38 %
Spain Government Bond	16.800.000	1,50 %	30.04.2027	16.878.187	0,35 %
Spain Government Bond	13.094.000	4,20 %	31.01.2037	16.790.227	0,35 %
Spain Government Bond	13.350.000	4,40 %	31.10.2023	16.244.747	0,34 %
Spain Government Bond	12.750.000	4,65 %	30.07.2025	16.128.138	0,34 %
Spain Government Bond	14.000.000	2,15 %	31.10.2025	15.068.256	0,31 %
Spain Government Bond	15.000.000	0,05 %	31.01.2021	15.023.790	0,31 %
Spain Government Bond	14.000.000	0,25 %	31.01.2019	14.091.098	0,29 %
Spain Government Bond	10.950.000	4,80 %	31.01.2024	13.640.481	0,28 %
Spain Government Bond	10.750.000	5,40 %	31.01.2023	13.431.458	0,28 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Spain Government Bond	11.728.000	4,30 %	31.10.2019	12.718.946	0,27 %
Spain Government Bond	9.180.000	4,70 %	30.07.2041	12.572.946	0,26 %
Spain Government Bond	8.350.000	5,15 %	31.10.2044	12.109.304	0,25 %
Spain Government Bond	9.900.000	1,40 %	31.01.2020	10.236.105	0,21 %
Spain Government Bond	10.000.000	1,45 %	31.10.2027	9.905.630	0,21 %
Spain Government Bond	9.100.000	4,30 %	31.10.2019	9.868.895	0,21 %
Spain Government Bond	8.325.000	4,85 %	31.10.2020	9.486.079	0,20 %
Spain Government Bond	9.300.000	1,95 %	30.07.2030	9.321.167	0,19 %
Spain Government Bond	8.500.000	3,45 %	30.07.2066	9.103.092	0,19 %
Spain Government Bond	8.700.000	1,60 %	30.04.2025	9.096.772	0,19 %
Spain Government Bond	8.800.000	0,40 %	30.04.2022	8.858.520	0,19 %
Spain Government Bond	5.700.000	5,15 %	31.10.2028	7.635.150	0,16 %
Spain Government Bond	5.350.000	5,50 %	30.04.2021	6.316.012	0,13 %
Spain Government Bond	5.700.000	0,75 %	30.07.2021	5.836.509	0,12 %
Spain Government Bond	5.000.000	0,45 %	31.10.2022	5.015.805	0,11 %
Spain Government Bond	4.724.000	2,90 %	31.10.2046	4.787.415	0,10 %
Autonomous Community of Madrid Spain	4.700.000	0,73 %	19.05.2021	4.780.567	0,10 %
Autonomous Community of Madrid Spain	4.346.000	1,00 %	30.09.2024	4.369.251	0,09 %
FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico	2.600.000	3,38 %	17.03.2019	2.712.996	0,06 %
FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico	2.100.000	0,03 %	17.06.2020	2.102.953	0,04 %
Autonomous Community of Madrid Spain	2.000.000	2,15 %	30.04.2027	2.093.828	0,04 %
Instituto de Credito Oficial	2.000.000	0,05 %	30.07.2020	2.006.740	0,04 %
Spain Government Bond	1.779.000	1,15 %	30.07.2020	1.837.639	0,04 %
FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico	1.400.000	5,90 %	17.03.2021	1.655.273	0,03 %
Adif-Alta Velocidad	1.500.000	1,88 %	28.01.2025	1.570.064	0,03 %
Autonomous Community of Madrid Spain	1.500.000	0,75 %	30.04.2022	1.522.376	0,03 %
Instituto de Credito Oficial	1.100.000	6,00 %	08.03.2021	1.305.590	0,03 %
Autonomous Community of Madrid Spain	1.200.000	2,88 %	06.04.2019	1.245.463	0,03 %
Autonomous Community of Madrid Spain	1.000.000	4,30 %	15.09.2026	1.231.757	0,03 %
Autonomous Community of Madrid Spain	1.000.000	4,13 %	21.05.2024	1.201.435	0,03 %
Instituto de Credito Oficial	950.000	4,38 %	20.05.2019	1.010.951	0,02 %
Autonomous Community of Madrid Spain	900.000	1,83 %	30.04.2025	947.579	0,02 %
Instituto de Credito Oficial	850.000	4,75 %	30.04.2020	945.834	0,02 %
Adif-Alta Velocidad	500.000	1,88 %	22.09.2022	528.404	0,01 %
Autonomous Community of Madrid Spain	450.000	4,69 %	12.03.2020	495.869	0,01 %
Autonomous Community of Madrid Spain	350.000	2,88 %	17.07.2023	391.983	0,01 %
				588.256.114	12,27 %
Summe Anleihen				4.730.110.567	98,66 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				4.730.110.567	98,66 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures 0,00 % (2016: (0,00 %))				
Euro-Bobl Futures März 2018	(48)	(6.363.360)	46.080	0,00 %
Euro-Bund Futures März 2018	(9)	(1.466.460)	11.340	0,00 %
			57.420	0,00 %

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf- betrag)	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte zu Absicherungszwecken auf Ebene der Anteilsklasse (0,04 %) (2016: (0,02 %))							
EUR	1.640.000	GBP	(1.445.898)	BNP Paribas	03.01.2018	11.137	0,00 %
GBP	1.821.314	EUR	(2.050.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	1.785	0,00 %
EUR	295.442.115	GBP	(262.255.102)	JP Morgan Chase	03.01.2018	998	0,00 %
GBP	435.272	EUR	(490.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	352	0,00 %
GBP	204.556	EUR	(230.000)	UBS	02.02.2018	247	0,00 %
GBP	1.796.867	EUR	(2.024.243)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	1	0,00 %
EUR	3.760.000	GBP	(3.340.516)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(64)	(0,00 %)
GBP	370.262	EUR	(420.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(2.885)	(0,00 %)
GBP	493.946	EUR	(560.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(3.549)	(0,00 %)
GBP	599.555	EUR	(680.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(4.577)	(0,00 %)
GBP	518.792	EUR	(590.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(5.560)	(0,00 %)
GBP	829.024	EUR	(940.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(6.071)	(0,00 %)
GBP	1.357.005	EUR	(1.540.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(11.278)	(0,00 %)
GBP	1.053.168	EUR	(1.200.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(13.563)	(0,00 %)
GBP	6.175.254	EUR	(6.980.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(23.323)	(0,00 %)
GBP	262.393.665	EUR	(295.442.115)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(93.446)	(0,00 %)
GBP	248.250.542	EUR	(281.632.115)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(1.967.709)	(0,04 %)
						(2.117.505)	(0,04 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente						(2.060.085)	(0,04 %)
						Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva						66.301.306	1,38 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)						4.794.351.788	100,00 %
						% des Gesamt- Euro (€)	nettovermögens
Analyse des Gesamtvermögens							
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind						3.076.378.003	64,17 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						1.651.746.476	34,45 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						1.986.088	0,04 %
(d) Derivative Finanzinstrumente						(2.060.085)	(0,04 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva						66.301.306	1,38 %
Gesamt Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)						4.794.351.788	100,00 %

^ Zinsvariable Anleihe (FRN). Der Effektivzins zum 31. Dezember 2017.

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Kapital Euro (€)	Kosten Euro (€)		Kapital Euro (€)	Erlöse Euro (€)
Käufe			Verkäufe		
French Republic Government Bond OAT 1,00 % 25.5.2027	68.500.000	70.298.291	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50 % 1.3.2026	31.300.000	37.762.981
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,05 % 1.8.2027	56.460.000	56.532.940	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,50 % 15.8.2027	33.400.000	33.737.948
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,50 % 15.8.2027	56.000.000	56.311.150	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,25 % 15.2.2027	33.150.000	32.794.529
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,25 % 15.2.2027	50.500.000	50.064.815	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,00 % 15.8.2026	31.500.000	30.666.440
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2,88 % 15.10.2025	40.000.000	44.291.920	Bundessobligation 0,25 % 13.4.2018	28.400.000	28.714.246
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50 % 1.3.2026	34.700.000	41.917.520	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,50 % 1.11.2027	20.100.000	28.330.548
French Republic Government Bond OAT 2,25 % 25.5.2024	30.000.000	34.309.220	French Republic Government Bond OAT 3,50 % 25.4.2026	21.200.000	26.627.632
French Republic Government Bond OAT 3,50 % 25.4.2026	25.000.000	31.334.250	French Republic Government Bond OAT 4,25 % 25.10.2018	21.550.000	22.710.759
Bundesschatzanweisungen 0,00 % 14.12.2018	30.000.000	30.428.400	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,65 % 1.3.2032	24.800.000	22.635.456
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50 % 1.2.2020	25.000.000	28.262.750	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,25 % 15.5.2018	21.700.000	21.802.928
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,50 % 15.8.2046	18.500.000	24.907.250	French Republic Government Bond OAT 1,00 % 25.5.2019	20.000.000	20.587.300
Bundessobligation 0,00 % 8.4.2022	23.000.000	23.339.310	French Republic Government Bond OAT 5,75 % 25.10.2032	12.400.000	20.303.928
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 5,50 % 4.1.2031	13.800.000	22.833.676	Bundesschatzanweisungen 0,00 % 14.12.2018	19.660.000	19.883.651
French Republic Government Bond OAT 2,25 % 25.10.2022	20.000.000	22.584.000	French Republic Government Bond OAT 2,75 % 25.10.2027	16.500.000	19.824.283
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,45 % 1.9.2033	22.000.000	21.808.820	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,30 % 15.10.2018	19.000.000	19.125.940
Spain Government Bond 5,90 % 30.7.2026	15.500.000	21.555.080	French Republic Government Bond OAT 4,00 % 25.4.2018	18.225.000	19.047.307
Spain Government Bond 2,35 % 30.7.2033	20.700.000	21.145.111	French Republic Government Bond OAT 4,25 % 25.4.2019	16.824.000	18.369.789
Spain Government Bond 1,50 % 30.4.2027	20.000.000	19.877.080	Spain Government Bond 4,10 % 30.7.2018	15.575.000	16.273.539
French Republic Government Bond OAT 0,00 % 25.2.2019	19.600.000	19.803.448	Spain Government Bond 4,50 % 31.1.2018	15.450.000	16.184.184
French Republic Government Bond OAT 0,00 % 25.5.2022	19.000.000	19.068.220	French Republic Government Bond OAT 4,50 % 25.4.2041	9.800.000	15.190.794
Kingdom of Belgium Government Bond 0,80 % 22.6.2027	18.800.000	18.914.548	Bundesschatzanweisungen 0,00 % 14.9.2018	15.000.000	15.131.670
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,00 % 4.1.2037	12.000.000	18.738.000	French Republic Government Bond OAT 0,00 % 25.2.2018	15.000.000	15.083.250
French Republic Government Bond OAT 4,50 % 25.4.2041	11.800.000	18.458.741	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,50 % 1.8.2018	14.150.000	14.775.734
Bundessobligation 0,00 % 7.10.2022	18.000.000	18.313.560	French Republic Government Bond OAT 1,00 % 25.5.2018	14.250.000	14.475.738
Spain Government Bond 5,85 % 31.1.2022	14.400.000	18.297.340	French Republic Government Bond OAT 1,00 % 25.11.2018	14.000.000	14.229.740
Spain Government Bond 4,00 % 30.4.2020	16.000.000	17.928.720	Netherlands Government Bond 4,00 % 15.7.2018	13.487.000	14.172.997
			Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,75 % 15.1.2018	14.000.000	14.125.580
			Bundesrepublik Deutschland 4,25 % 4.7.2018	12.976.000	13.612.845
			Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,50 % 15.2.2025	13.000.000	13.499.460
			Spain Government Bond 5,50 % 30.4.2021	11.000.000	13.383.410
			KFW 3,13 % 15.6.2018	12.650.000	13.087.690

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	Euro (€) Zum 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	4.730.110.567	4.332.039.515
Derivative Finanzinstrumente	71.940	21.627
Barmittel und liquide Vermögenswerte	18.655.337	12.770.171
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenkassageschäften	—	8.283
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	52.712.281	50.097.049
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	33.248.138	67.789.644
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	13.524.844	—
Bareinschüsse für Futures	—	86.400
Summe Umlaufvermögen	4.848.323.107	4.462.812.689
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	2.132.025	946.774
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	1.820	—
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	45.815.625	51.502.250
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	5.193.178	20.931.941
An Broker zu zahlende Bareinschüsse	48.089	—
Zahlbare Verwaltungsgebühren	780.582	684.914
Summe kurzfristige Passiva	53.971.319	74.065.879
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken) („Nettovermögen“)	4.794.351.788	4.388.746.810

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Nettovermögen	3.399.464.187	3.043.890.633	2.691.542.653
Anzahl der umlaufenden Anteile	15.313.853	13.699.983	12.477.292
Nettoinventarwert je Anteil	221,99	222,18	215,72
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Gegenwert in Euro (€)	4.113.590	106.285.195	4.448.965
Nettovermögen	4.939.599	112.104.309	4.832.911
Anzahl der umlaufenden Anteile	43.797	1.130.605	48.745
Nettoinventarwert je Anteil	112,78	99,15	99,15
EUR-Anlegeranteile (€)			
Nettovermögen	350.622.881	412.300.437	90.386.272
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.674.046	1.965.807	443.651
Nettoinventarwert je Anteil	209,45	209,74	203,73
USD-Anlegeranteile (\$)			
Gegenwert in Euro (€)	16.071.638	15.880.953	21.576.429
Nettovermögen	19.298.823	16.750.435	23.438.475
Anzahl der umlaufenden Anteile	76.709	75.694	105.871
Nettoinventarwert je Anteil	251,58	221,29	221,39
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Nettovermögen	732.934.590	639.123.982	679.735.526
Anzahl der umlaufenden Anteile	6.243.424	5.444.950	5.970.492
Nettoinventarwert je Anteil	117,39	117,38	113,85
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in Euro (€)	291.144.902	171.265.610	116.983.412
Nettovermögen	258.441.557	146.192.218	86.219.609
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.200.396	1.252.263	768.774
Nettoinventarwert je Anteil	117,45	116,74	112,15

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	64.834.900	65.405.256
Verschiedene Erträge	13	104
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	(65.217.575)	36.515.781
Summe Anlageerträge/(-verluste)	(382.662)	101.921.141
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	8.771.014	7.313.312
Transaktionsgebühren und Provisionen	484	65
Sonstige Aufwendungen	—	932
Summe Aufwendungen	8.771.498	7.314.309
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	79.988	41.459
Summe Finanzierungskosten	79.988	41.459
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(9.234.148)	94.565.373
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	(9.234.148)	94.565.373

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	(9.234.148)	94.565.373
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	1.479.052.873	1.568.559.914
Rücknahmen	(1.064.213.747)	(879.051.734)
Summe Kapitalgeschäfte	414.839.126	689.508.180
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	405.604.978	784.073.553
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	4.388.746.810	3.604.673.257
Zum Jahresende	4.794.351.788	4.388.746.810

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Euro Investment Grade Bond Index Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Asset Management, Limited.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds strebt eine Rendite an, die der Wertentwicklung des Bloomberg Barclays EUR Non-Government Float Adjusted Bond Index entspricht, eines marktgewichteten Index für auf Euro lautende festverzinsliche Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating und Laufzeiten von mehr als einem Jahr, ausgenommen Schatztitel und regierungsnahe Wertpapiere aus der Eurozone.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	2.428	3.432
Rendite auf Endfälligkeit	0,5 % ³	0,5 %
Durchschnittlicher Kupon	2,1 %	2,1 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	6,0 Jahre	6,0 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	A1	A1
Durchschnittliche Duration	5,5 Jahre	5,5 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,25 %	
Anlegeranteile	0,30 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,15 %	
Thesaurierende Anteile	0,30 %	
Kurzfristige Reserven	1,7 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
R ²	0,99	1,00
Beta	1,03	1,00

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Frankreich	16,4 %	16,9 %
Supranationale Anleihen	15,2	15,1
Deutschland	10,5	10,3
USA	10,3	10,2
Vereinigtes Königreich	7,3	7,3
Spanien	6,2	6,3
Italien	4,6	4,6
Niederlande	4,6	5,0
Schweden	2,9	3,0
Australien	2,3	2,3
Kanada	2,1	2,1
Schweiz	2,1	2,0
Norwegen	2,0	2,0
Belgien	1,5	1,5
Dänemark	1,3	1,2
Österreich	1,1	1,2
Polen	1,1	1,2
Mexiko	1,0	1,0
Sonstige	7,5	6,8

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

Behörden	2,7 %
Forderungsbesicherte Wertpapiere	24,1
Finanzinstitute	21,6
Industriegüter	27,1
Lokale Behörde	0,7
Staatlich	3,3
Supranationale Anleihen	15,2
Treasury/Federal	1,2
Versorger	4,1

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	26,0 %
Aa	17,6
A	25,0
Baa	30,3
nicht eingestuft	1,1

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	48,2 %
5-10 Jahre	37,3
Mehr als 10 Jahre	14,5

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit

Durchschnittliche Fälligkeit	Kurz	Mittel	Lang
Kreditqualität Staats-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays EUR Non-Government Float Adjusted Bond Index.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

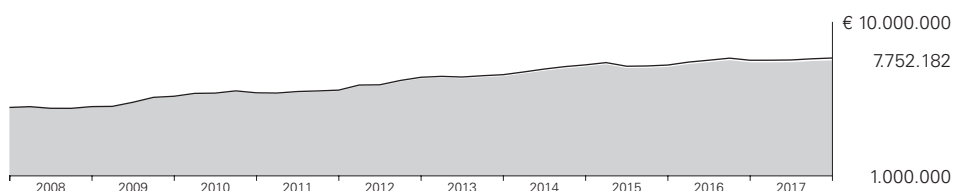
Euro Investment Grade Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays EUR Non-Government Float Adjusted Bond Index

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Institutionelle Anteile	1,52 %	2,99 %	4,48 %	€ 7.752.182
Benchmark ¹	1,70	3,13	4,67	7.889.336

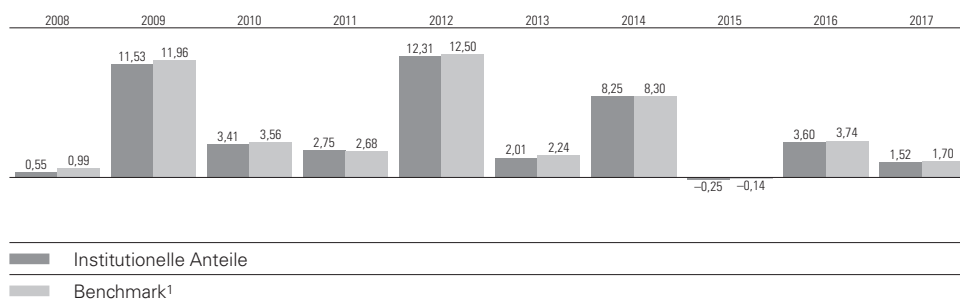
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Anlegeranteile	1,47 %	2,93 %	4,40 %	€ 153.809
Benchmark ¹	1,70	3,13	4,67	157.787

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ²	
Institutionelle Plus-Anteile	1,63 %	3,27 %	€ 228.009.600
Benchmark ¹	1,70	3,29	228.139.132

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,18 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,23 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,07 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.³

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,30 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



¹ Bloomberg Barclays EUR Non-Government Bond Index bis 30. Juni 2010; und danach Bloomberg Barclays Euro Non-Government Float Adjusted Bond Index.

² 6. Dezember 2013.

³ Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

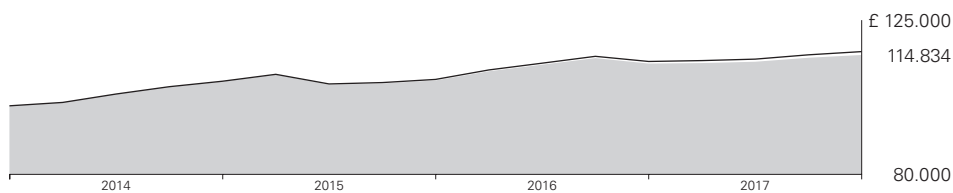
Euro Investment Grade Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays EUR Non-Government Float Adjusted Bond Index GBP-Hedged

Abgesichert in GBP

Kumulative Wertentwicklung: 31. Januar 2014–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. £ 100.000

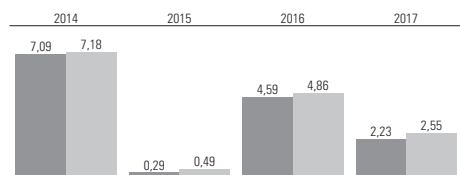


	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenden Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP	2,23 %	3,60 %	£ 114.834
Benchmark	2,55	3,82	115.818

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,32 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte Thesaurierungsanteile.²

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,30 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 31. Januar 2014–31. Dezember 2017



Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP
Benchmark

¹ 31. Januar 2014.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 97,85 % (2016: 98,00 %)					
Australien 2,28 % (2016: 2,19 %)					
Commonwealth Bank of Australia	2.000.000	0,38 %	10.02.2021	2.026.082	0,10 %
Westpac Banking Corp.	1.500.000	0,88 %	16.02.2021	1.535.758	0,07 %
Westpac Banking Corp.	1.300.000	0,50 %	17.05.2024	1.301.891	0,06 %
Telstra Corp., Ltd.	1.100.000	3,50 %	21.09.2022	1.256.901	0,06 %
National Australia Bank Ltd.	1.100.000	0,88 %	19.02.2027	1.102.867	0,05 %
Bank of Queensland Ltd.	1.000.000	0,50 %	10.07.2022	1.009.940	0,05 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	1.000.000	0,45 %	22.11.2023	1.003.292	0,05 %
Commonwealth Bank of Australia [^]	1.000.000	1,94 %	03.10.2029	1.003.272	0,05 %
National Australia Bank Ltd.	1.000.000	0,63 %	10.11.2023	1.001.796	0,05 %
Westpac Banking Corp.	1.000.000	0,25 %	17.01.2022	997.664	0,05 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	1.000.000	0,75 %	29.09.2026	985.757	0,05 %
BHP Billiton Finance Ltd.	800.000	3,13 %	29.04.2033	953.280	0,05 %
Westpac Banking Corp.	900.000	1,50 %	24.03.2021	943.939	0,05 %
National Australia Bank Ltd.	900.000	1,25 %	18.05.2026	924.856	0,04 %
Westpac Banking Corp.	900.000	0,63 %	14.01.2022	918.263	0,04 %
Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd.	800.000	3,13 %	26.09.2023	908.499	0,04 %
BHP Billiton Finance Ltd. [^]	800.000	4,75 %	22.04.2076	894.585	0,04 %
Commonwealth Bank of Australia	750.000	4,38 %	25.02.2020	820.615	0,04 %
Westpac Banking Corp.	800.000	0,75 %	22.07.2021	820.126	0,04 %
National Australia Bank Ltd.	750.000	4,63 %	10.02.2020	819.482	0,04 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	700.000	3,63 %	18.07.2022	808.918	0,04 %
Commonwealth Bank of Australia	700.000	3,00 %	03.05.2022	785.806	0,04 %
National Australia Bank Ltd.	700.000	4,00 %	13.07.2020	770.056	0,04 %
Telstra Corp., Ltd.	670.000	2,50 %	15.09.2023	739.096	0,04 %
Commonwealth Bank of Australia [^]	700.000	2,00 %	22.04.2027	723.078	0,03 %
Commonwealth Bank of Australia	700.000	0,75 %	04.11.2021	718.315	0,03 %
BHP Billiton Finance Ltd.	620.000	2,25 %	25.09.2020	657.622	0,03 %
National Australia Bank Ltd.	600.000	1,88 %	13.01.2023	647.720	0,03 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	600.000	1,13 %	13.05.2020	618.280	0,03 %
BHP Billiton Finance Ltd. [^]	500.000	5,63 %	22.10.2079	612.750	0,03 %
Commonwealth Bank of Australia	600.000	1,38 %	22.01.2019	610.931	0,03 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	550.000	0,38 %	19.11.2019	556.633	0,03 %
Commonwealth Bank of Australia	500.000	5,50 %	06.08.2019	543.227	0,03 %
Scentre Group Trust 1	500.000	2,25 %	16.07.2024	540.972	0,03 %
Transurban Finance Co. Pty Ltd.	500.000	2,00 %	28.08.2025	530.530	0,03 %
AusNet Services Holdings Pty Ltd.	500.000	2,38 %	24.07.2020	529.339	0,03 %
National Australia Bank Ltd.	500.000	2,00 %	12.11.2020	527.270	0,03 %
APT Pipelines Ltd.	500.000	2,00 %	22.03.2027	516.500	0,03 %
Telstra Corp., Ltd.	450.000	3,75 %	16.05.2022	516.001	0,03 %
Scentre Group Trust 1	500.000	1,50 %	16.07.2020	515.490	0,02 %
National Australia Bank Ltd.	500.000	0,88 %	16.11.2022	515.488	0,02 %
National Australia Bank Ltd. [^]	500.000	2,00 %	12.11.2024	513.109	0,02 %
Commonwealth Bank of Australia	500.000	1,63 %	04.02.2019	509.584	0,02 %
BHP Billiton Finance Ltd.	500.000	1,50 %	29.04.2030	507.713	0,02 %
Macquarie Bank Ltd.	500.000	0,38 %	03.03.2021	505.296	0,02 %
Telstra Corp., Ltd.	500.000	1,13 %	14.04.2026	503.768	0,02 %
Commonwealth Bank of Australia	500.000	0,38 %	11.04.2024	496.616	0,02 %
Telstra Corp., Ltd.	450.000	4,25 %	23.03.2020	492.529	0,02 %
Macquarie Bank Ltd.	400.000	6,00 %	21.09.2020	457.436	0,02 %
National Australia Bank Ltd.	400.000	2,25 %	06.06.2025	446.957	0,02 %
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd.	400.000	2,75 %	23.04.2024	443.440	0,02 %
SGSP Australia Assets Pty Ltd.	400.000	2,00 %	30.06.2022	426.097	0,02 %
Transurban Finance Co. Pty Ltd.	400.000	2,50 %	08.10.2020	423.725	0,02 %
Transurban Finance Co. Pty Ltd.	400.000	1,88 %	16.09.2024	422.780	0,02 %
Aurizon Network Pty Ltd.	400.000	2,00 %	18.09.2024	422.296	0,02 %
Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd.	400.000	1,75 %	15.10.2024	421.360	0,02 %
Commonwealth Bank of Australia	400.000	1,63 %	10.02.2031	421.180	0,02 %
National Australia Bank Ltd.	400.000	1,38 %	28.05.2021	418.582	0,02 %
Rio Tinto Finance plc	400.000	2,00 %	11.05.2020	417.976	0,02 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Scentre Group Trust 1/Scentre Group Trust 2	400.000	1,38 %	22.03.2023	413.438	0,02 %
APT Pipelines Ltd.	400.000	1,38 %	22.03.2022	412.927	0,02 %
National Australia Bank Ltd.	400.000	0,88 %	20.01.2022	408.784	0,02 %
BHP Billiton Finance Ltd.	300.000	3,00 %	29.05.2024	345.561	0,02 %
Rio Tinto Finance plc	300.000	2,88 %	11.12.2024	344.301	0,02 %
Wesfarmers Ltd.	300.000	2,75 %	02.08.2022	331.447	0,02 %
Amcor Ltd.	300.000	2,75 %	22.03.2023	330.372	0,02 %
Amcor Ltd.	300.000	4,63 %	16.04.2019	317.580	0,02 %
Stockland Trust	300.000	1,50 %	03.11.2021	311.010	0,02 %
Optus Finance Pty Ltd.	250.000	3,50 %	15.09.2020	272.583	0,01 %
Scentre Group Trust 2	206.000	3,25 %	11.09.2023	234.006	0,01 %
Telstra Corp., Ltd.	200.000	3,63 %	15.03.2021	222.268	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	200.000	5,13 %	10.09.2019	217.032	0,01 %
Macquarie Bank Ltd.	200.000	1,13 %	20.01.2022	205.773	0,01 %
Transurban Finance Co. Pty Ltd.	200.000	1,75 %	29.03.2028	203.833	0,01 %
Macquarie Bank Ltd.	200.000	1,00 %	16.09.2019	203.458	0,01 %
				47.237.704	2,28 %
Österreich 1,08 % (2016: 0,95 %)					
Erste Group Bank AG	1.800.000	0,63 %	19.01.2023	1.836.842	0,09 %
UniCredit Bank Austria AG	900.000	4,13 %	24.02.2021	1.017.175	0,05 %
JAB Holdings BV	1.000.000	1,25 %	22.05.2024	1.016.392	0,05 %
Hypoe NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG	900.000	1,75 %	15.10.2020	944.003	0,05 %
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	900.000	0,38 %	13.09.2024	895.270	0,04 %
UniCredit Bank Austria AG	800.000	0,50 %	16.01.2020	811.364	0,04 %
OMV AG^	600.000	6,25 %	09.12.2166	752.392	0,04 %
JAB Holdings BV	700.000	2,00 %	18.05.2028	725.442	0,04 %
OMV AG	575.000	4,25 %	12.10.2021	662.169	0,03 %
UNIQA Insurance Group AG^	500.000	6,00 %	27.07.2046	626.711	0,03 %
Erste Group Bank AG	600.000	0,75 %	05.02.2025	611.434	0,03 %
OMV AG	500.000	3,50 %	27.09.2027	603.794	0,03 %
Raiffeisen Bank International AG	500.000	6,63 %	18.05.2021	597.655	0,03 %
OMV AG^	500.000	5,25 %	09.12.2166	568.750	0,03 %
Telekom Finanzmanagement GmbH	500.000	3,13 %	03.12.2021	555.600	0,03 %
Erste Group Bank AG	400.000	7,13 %	10.10.2022	518.800	0,03 %
Hypoe NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG	500.000	1,63 %	17.09.2019	515.913	0,02 %
Telekom Finanzmanagement GmbH	500.000	1,50 %	07.12.2026	512.810	0,02 %
Hypo Vorarlberg Bank AG	500.000	0,75 %	11.02.2025	505.239	0,02 %
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	500.000	0,38 %	23.02.2022	505.228	0,02 %
Hypoe NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG	500.000	0,38 %	04.04.2023	501.089	0,02 %
OMV AG	500.000	1,00 %	14.12.2026	493.155	0,02 %
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	450.000	1,75 %	02.10.2020	472.979	0,02 %
UniCredit Bank Austria AG	400.000	2,38 %	22.01.2024	447.176	0,02 %
OMV AG	400.000	1,75 %	25.11.2019	413.897	0,02 %
UniCredit Bank Austria AG	400.000	1,25 %	14.10.2019	410.790	0,02 %
Raiffeisen-Landesbank Steiermark AG	400.000	0,63 %	20.01.2023	406.471	0,02 %
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe^	300.000	5,50 %	09.10.2043	363.739	0,02 %
Raiffeisen-Landesbank Steiermark AG	300.000	2,38 %	14.06.2028	342.233	0,02 %
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe^	300.000	3,75 %	02.03.2046	334.793	0,02 %
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	300.000	2,13 %	12.09.2022	326.920	0,02 %
Atrium European Real Estate Ltd.	300.000	4,00 %	20.04.2020	323.025	0,02 %
UniCredit Bank Austria AG	300.000	1,88 %	29.10.2020	316.545	0,02 %
KA Finanz AG	300.000	1,63 %	19.02.2021	314.132	0,02 %
Hypo Vorarlberg Bank AG	300.000	1,25 %	23.04.2020	309.625	0,01 %
Hypoe NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG	300.000	0,50 %	11.09.2020	304.334	0,01 %
UniCredit Bank Austria AG	300.000	0,75 %	25.02.2025	304.056	0,01 %
Telekom Finanzmanagement GmbH	250.000	4,00 %	04.04.2022	287.969	0,01 %
OMV AG	250.000	4,38 %	10.02.2020	273.035	0,01 %
UNIQA Insurance Group AG^	200.000	6,88 %	31.07.2043	250.808	0,01 %
Telekom Finanzmanagement GmbH	200.000	3,50 %	04.07.2023	230.661	0,01 %
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	200.000	1,88 %	18.09.2019	207.297	0,01 %
				22.417.712	1,08 %
Belgien 1,45 % (2016: 1,43 %)					
Anheuser-Busch InBev SA	1.950.000	2,75 %	17.03.2036	2.140.022	0,10 %
Anheuser-Busch InBev SA	2.000.000	2,00 %	17.03.2028	2.135.536	0,10 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Anheuser-Busch InBev SA	1.800.000	1,50 %	17.03.2025	1.888.547	0,09 %
Belfius Bank SA	1.600.000	0,63 %	14.10.2021	1.638.632	0,08 %
Anheuser-Busch InBev SA	1.500.000	0,88 %	17.03.2022	1.536.265	0,07 %
Anheuser-Busch InBev SA	1.500.000	0,63 %	17.03.2020	1.520.433	0,07 %
Belfius Bank SA	1.200.000	1,25 %	28.01.2019	1.220.740	0,06 %
Anheuser-Busch InBev SA	1.000.000	2,88 %	25.09.2024	1.141.675	0,06 %
BNP Paribas Fortis SA	1.000.000	0,50 %	23.09.2024	1.004.099	0,05 %
KBC Group NV	1.000.000	0,75 %	18.10.2023	1.000.741	0,05 %
Argenta Spaarbank NV^	900.000	3,88 %	24.05.2026	976.320	0,05 %
Anheuser-Busch InBev SA	750.000	2,70 %	31.03.2026	848.396	0,04 %
Anheuser-Busch InBev SA	700.000	2,25 %	24.09.2020	741.335	0,04 %
Solvay SA	700.000	1,63 %	02.12.2022	735.088	0,04 %
KBC Bank NV	700.000	1,25 %	28.05.2020	725.300	0,04 %
Belfius Bank SA	600.000	1,75 %	24.06.2024	652.024	0,03 %
Delhaize Le Lion/De Leeuw BV	600.000	3,13 %	27.02.2020	638.995	0,03 %
KBC Bank NV	600.000	0,13 %	28.04.2021	604.680	0,03 %
KBC Bank NV	600.000	0,75 %	24.10.2027	597.677	0,03 %
Belfius Bank SA	500.000	1,38 %	05.06.2020	519.302	0,03 %
KBC Group NV^	500.000	1,88 %	11.03.2027	516.620	0,02 %
KBC Bank NV	500.000	0,45 %	22.01.2022	509.110	0,02 %
KBC Bank NV	500.000	0,38 %	01.09.2022	506.888	0,02 %
Belfius Bank SA	500.000	0,75 %	12.09.2022	501.204	0,02 %
Anheuser-Busch InBev SA	460.000	1,88 %	20.01.2020	477.741	0,02 %
Belfius Bank SA	400.000	2,13 %	30.01.2023	438.804	0,02 %
KBC Bank NV	400.000	2,00 %	31.01.2023	437.247	0,02 %
KBC Group NV^	400.000	2,38 %	25.11.2024	415.305	0,02 %
ASR Nederland NV^	350.000	5,00 %	30.09.2166	408.363	0,02 %
Elia System Operator SA	300.000	3,25 %	04.04.2028	354.224	0,02 %
Elia System Operator SA	300.000	3,00 %	07.04.2029	345.910	0,02 %
Belfius Bank SA	300.000	3,13 %	11.05.2026	328.512	0,02 %
Brussels Airport Co. NV	300.000	3,25 %	01.07.2020	322.966	0,02 %
Anheuser-Busch InBev SA	300.000	1,95 %	30.09.2021	319.115	0,02 %
KBC Group NV	300.000	1,00 %	26.04.2021	307.229	0,01 %
KBC Bank NV	300.000	1,00 %	25.02.2019	304.759	0,01 %
Brussels Airport Co. NV	300.000	1,00 %	03.05.2024	301.660	0,01 %
Anheuser-Busch InBev SA	200.000	4,00 %	02.06.2021	225.951	0,01 %
Solvay SA	200.000	2,75 %	02.12.2027	223.726	0,01 %
Belfius Bank SA	200.000	0,75 %	10.02.2025	203.430	0,01 %
Anheuser-Busch InBev SA	200.000	1,50 %	18.04.2030	199.150	0,01 %
Elia System Operator SA	150.000	5,25 %	13.05.2019	160.921	0,01 %
				30.074.642	1,45 %
Bermuda 0,09 % (2016: 0,04 %)					
XLIT Ltd.^	800.000	3,25 %	29.06.2047	806.940	0,04 %
Bacardi Ltd.	450.000	2,75 %	03.07.2023	497.283	0,03 %
PartnerRe Ireland Finance DAC	491.000	1,25 %	15.09.2026	481.072	0,02 %
				1.785.295	0,09 %
Brasilien 0,01 % (2016: 0,04 %)					
BRF SA	270.000	2,75 %	03.06.2022	279.956	0,01 %
				279.956	0,01 %
Bulgarien 0,21 % (2016: 0,21 %)					
Bulgaria Government International Bond	1.000.000	1,88 %	21.03.2023	1.085.600	0,05 %
Bulgaria Government International Bond	800.000	2,63 %	26.03.2027	905.971	0,05 %
Bulgaria Government International Bond	800.000	2,00 %	26.03.2022	868.000	0,04 %
Bulgaria Government International Bond	700.000	3,00 %	21.03.2028	806.050	0,04 %
Bulgaria Government International Bond	400.000	3,13 %	26.03.2035	450.500	0,02 %
Bulgaria Government International Bond	200.000	2,95 %	03.09.2024	230.336	0,01 %
				4.346.457	0,21 %
Kanada 2,06 % (2016: 1,97 %)					
Bank of Montreal	2.500.000	0,20 %	26.01.2023	2.491.110	0,12 %
Bank of Nova Scotia	2.000.000	0,10 %	21.01.2019	2.009.650	0,10 %
Bank of Montreal	2.000.000	0,13 %	19.04.2021	2.009.472	0,10 %
Provinz Quebec (Kanada)	1.600.000	2,25 %	17.07.2023	1.767.962	0,09 %
Province Ontario Kanada	1.500.000	0,88 %	21.01.2025	1.532.280	0,07 %
National Bank of Canada	1.400.000	0,00 %	29.09.2023	1.371.871	0,07 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Royal Bank of Canada	1.300.000	1,63 %	04.08.2020	1.359.431	0,07 %
Canada Government International Bond	1.150.000	3,50 %	13.01.2020	1.241.876	0,06 %
Toronto-Dominion Bank	1.100.000	0,63 %	29.07.2019	1.116.558	0,05 %
CPPIB Capital, Inc.	1.100.000	0,38 %	20.06.2024	1.093.308	0,05 %
Province Ontario Kanada	950.000	4,75 %	23.04.2019	1.014.033	0,05 %
Bank of Montreal	1.000.000	0,38 %	05.08.2020	1.013.508	0,05 %
Toronto-Dominion Bank	1.000.000	0,38 %	12.01.2021	1.013.483	0,05 %
Toronto-Dominion Bank	1.000.000	0,50 %	03.04.2024	1.006.196	0,05 %
Province Ontario Kanada	1.000.000	0,38 %	14.06.2024	992.632	0,05 %
Bank of Nova Scotia	900.000	0,75 %	17.09.2021	923.423	0,05 %
Bank of Montreal	900.000	0,75 %	21.09.2022	923.035	0,04 %
Provinz Quebec (Kanada)	850.000	5,00 %	29.04.2019	910.694	0,04 %
Toronto-Dominion Bank	900.000	0,25 %	27.04.2022	904.315	0,04 %
Provinz Quebec (Kanada)	800.000	2,38 %	22.01.2024	893.102	0,04 %
Province Ontario Kanada	800.000	1,88 %	21.05.2024	870.273	0,04 %
National Bank of Canada	800.000	1,50 %	25.03.2021	839.220	0,04 %
Provinz Quebec (Kanada)	800.000	0,88 %	15.01.2025	818.080	0,04 %
Province Ontario Kanada	750.000	3,00 %	28.09.2020	815.668	0,04 %
Bank of Nova Scotia	800.000	1,00 %	02.04.2019	813.438	0,04 %
Bank of Nova Scotia	800.000	0,50 %	23.07.2020	813.214	0,04 %
Province Ontario Kanada	750.000	4,00 %	03.12.2019	812.491	0,04 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	800.000	0,38 %	15.10.2019	809.606	0,04 %
Bank of Montreal	800.000	0,25 %	22.01.2020	807.930	0,04 %
Provinz Quebec (Kanada)	800.000	0,88 %	04.05.2027	801.652	0,04 %
National Bank of Canada	700.000	0,50 %	26.01.2022	710.879	0,03 %
Bank of Nova Scotia	700.000	0,38 %	10.03.2023	703.891	0,03 %
Royal Bank of Canada	600.000	0,88 %	17.06.2022	619.018	0,03 %
Toronto-Dominion Bank	600.000	0,75 %	29.10.2021	615.841	0,03 %
Bank of Montreal	600.000	1,00 %	07.05.2019	610.850	0,03 %
Caisse Centrale Desjardins	600.000	1,13 %	11.03.2019	610.285	0,03 %
Caisse Centrale Desjardins	600.000	0,38 %	22.10.2019	606.835	0,03 %
Great-West Lifeco, Inc.	500.000	1,75 %	07.12.2026	519.698	0,03 %
Caisse Centrale Desjardins	500.000	0,38 %	25.11.2020	506.421	0,02 %
Toronto-Dominion Bank	500.000	0,38 %	27.04.2023	502.992	0,02 %
Royal Bank of Canada	500.000	0,13 %	11.03.2021	502.519	0,02 %
Bank of Nova Scotia	500.000	0,38 %	06.04.2022	499.695	0,02 %
CDP Financial, Inc.	400.000	3,50 %	23.06.2020	432.425	0,02 %
Royal Bank of Canada	400.000	0,50 %	16.12.2020	406.815	0,02 %
Toronto-Dominion Bank	400.000	0,50 %	15.06.2020	406.735	0,02 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	400.000	0,25 %	28.01.2020	404.168	0,02 %
Royal Bank of Canada	300.000	0,75 %	19.06.2019	304.891	0,02 %
				42.753.469	2,06 %
Kaimaninseln 0,10 % (2016: 0,12 %)					
IPIC GMTN Ltd.	1.200.000	5,88 %	14.03.2021	1.411.003	0,07 %
IPIC GMTN Ltd.	500.000	3,63 %	30.05.2023	571.500	0,03 %
				1.982.503	0,10 %
Chile 0,15 % (2016: 0,12 %)					
Chile Government International Bond	1.000.000	1,88 %	27.05.2030	1.041.550	0,05 %
Chile Government International Bond	800.000	1,75 %	20.01.2026	850.640	0,04 %
Chile Government International Bond	700.000	1,63 %	30.01.2025	741.125	0,04 %
Corp. Nacional del Cobre de Chile	500.000	2,25 %	09.07.2024	532.573	0,02 %
				3.165.888	0,15 %
China 0,59 % (2016: 0,46 %)					
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.	1.500.000	1,25 %	19.05.2022	1.531.050	0,07 %
China Development Bank	1.500.000	0,50 %	01.06.2021	1.499.727	0,07 %
Export-Import Bank von China	1.400.000	0,25 %	02.12.2019	1.399.244	0,07 %
China Development Bank Corp.	1.400.000	0,88 %	24.01.2024	1.373.751	0,07 %
Export-Import Bank von China	1.200.000	0,75 %	28.05.2023	1.187.400	0,06 %
China Development Bank Corp.	900.000	0,13 %	03.11.2019	898.096	0,04 %
China Development Bank	600.000	0,38 %	16.11.2021	595.620	0,03 %
Sinopec Group Overseas Development 2013 Ltd.	500.000	2,63 %	17.10.2020	530.657	0,03 %
Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd.	500.000	1,00 %	28.04.2022	505.735	0,02 %
CNOOC Curtis Funding No 1 Pty Ltd.	400.000	2,75 %	03.10.2020	425.758	0,02 %
BAIC Inalfa HK Investment Co., Ltd.	400.000	1,90 %	02.11.2020	410.370	0,02 %
Shanghai Electric Newage Co., Ltd.	400.000	1,13 %	22.05.2020	405.882	0,02 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Export-Import Bank von China	400.000	0,38 %	26.04.2019	400.706	0,02 %
Bank of China Ltd.	400.000	0,75 %	12.07.2021	399.786	0,02 %
China Construction Bank Asia Corp., Ltd.	300.000	1,50 %	11.02.2020	306.312	0,01 %
State Grid Europe Development 2014 plc	200.000	2,45 %	26.01.2027	212.996	0,01 %
State Grid Europe Development 2014 plc	100.000	1,50 %	26.01.2022	102.921	0,01 %
				12.186.011	0,59 %
Kolumbien 0,03 % (2016: 0,03 %)					
Colombia Government International Bond	600.000	3,88 %	22.03.2026	698.932	0,03 %
				698.932	0,03 %
Tschechische Republik 0,35 % (2016: 0,41 %)					
Tschechische Republik Internationale	1.900.000	3,88 %	24.05.2022	2.223.000	0,11 %
Tschechische Republik Internationale	1.400.000	3,63 %	14.04.2021	1.576.029	0,08 %
CEZ A.S.	500.000	4,88 %	16.04.2025	625.918	0,03 %
CEZ A.S.	500.000	5,00 %	19.10.2021	586.880	0,03 %
Tschechische Republik Internationale	500.000	4,13 %	18.03.2020	548.860	0,03 %
CEZ A.S.	400.000	3,00 %	05.06.2028	447.176	0,02 %
CEZ A.S.	400.000	4,50 %	29.06.2020	442.871	0,02 %
Raiffeisenbank A.S.	400.000	0,75 %	05.11.2019	404.017	0,02 %
Ceske Drahy A.S.	300.000	4,13 %	23.07.2019	318.017	0,01 %
				7.172.768	0,35 %
Dänemark 1,26 % (2016: 1,22 %)					
Danske Bank A/S	2.600.000	0,25 %	04.06.2020	2.628.345	0,13 %
Kommunekredit	1.500.000	0,25 %	29.03.2023	1.505.001	0,07 %
AP Moller – Maersk A/S	1.300.000	1,75 %	18.03.2021	1.357.845	0,07 %
Danske Bank A/S^	1.000.000	2,75 %	19.05.2026	1.067.675	0,05 %
AP Moller – Maersk A/S	1.000.000	3,38 %	28.08.2019	1.055.976	0,05 %
Danske Bank A/S	1.000.000	1,25 %	11.06.2021	1.044.227	0,05 %
Danske Bank A/S	1.000.000	0,38 %	26.08.2019	1.011.354	0,05 %
Nykredit Realkredit A/S	992.000	0,88 %	13.06.2019	1.004.224	0,05 %
Kommunekredit	1.000.000	0,75 %	18.05.2027	1.000.820	0,05 %
Carlsberg Breweries A/S	900.000	2,50 %	28.05.2024	988.382	0,05 %
BRFkredit A/S	1.000.000	0,50 %	01.10.2026	979.077	0,05 %
Nykredit Realkredit A/S^	800.000	2,75 %	17.11.2027	857.120	0,04 %
Danske Bank A/S	750.000	4,13 %	26.11.2019	812.909	0,04 %
TDC A/S	800.000	1,75 %	27.02.2027	808.720	0,04 %
Danske Bank A/S	800.000	0,75 %	22.11.2027	793.610	0,04 %
Danske Bank A/S	800.000	0,25 %	28.11.2022	791.488	0,04 %
Orsted A/S	600.000	1,50 %	26.11.2029	596.413	0,03 %
Danske Bank A/S	500.000	3,75 %	23.06.2022	580.868	0,03 %
Danske Bank A/S	500.000	1,63 %	28.02.2020	520.062	0,03 %
Danfoss A/S	500.000	1,38 %	23.02.2022	518.183	0,02 %
Nykredit Realkredit A/S	500.000	1,75 %	28.01.2019	510.729	0,02 %
Danske Bank A/S	500.000	0,75 %	04.05.2020	508.769	0,02 %
Orsted A/S^	416.000	6,25 %	26.06.3013	507.595	0,02 %
Danske Bank A/S	500.000	0,75 %	02.06.2023	506.413	0,02 %
BRFkredit A/S	500.000	0,25 %	01.07.2023	498.253	0,02 %
Carlsberg Breweries A/S	400.000	2,63 %	15.11.2022	441.843	0,02 %
Orsted A/S^	400.000	3,00 %	06.11.3015	420.800	0,02 %
Nykredit Realkredit A/S	412.000	0,38 %	16.06.2020	414.282	0,02 %
ISS Global A/S	400.000	1,13 %	07.01.2021	408.938	0,02 %
Kommunekredit	400.000	0,63 %	11.05.2026	399.776	0,02 %
ISS Global A/S	300.000	2,13 %	02.12.2024	320.155	0,02 %
Jyske Bank A/S^	217.000	2,25 %	05.04.2029	222.514	0,01 %
Carlsberg Breweries A/S	200.000	2,63 %	03.07.2019	208.049	0,01 %
ISS Global A/S	200.000	1,13 %	09.01.2020	203.516	0,01 %
Orsted A/S^	200.000	2,25 %	24.11.3017	203.000	0,01 %
Danske Bank A/S	200.000	0,13 %	14.02.2022	200.454	0,01 %
Kommunekredit	200.000	0,88 %	03.11.2036	182.651	0,01 %
				26.080.036	1,26 %
Finnland 0,94 % (2016: 1,00 %)					
Nordea Mortgage Bank plc	2.000.000	4,00 %	10.02.2021	2.255.272	0,11 %
Nordea Mortgage Bank plc	1.500.000	0,03 %	24.01.2022	1.499.247	0,07 %
Nordea Mortgage Bank plc	1.100.000	0,13 %	17.06.2020	1.109.113	0,05 %
Sampo OYJ	1.000.000	1,00 %	18.09.2023	1.017.064	0,05 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
OP Mortgage Bank	1.000.000	0,75 %	07.06.2027	998.807	0,05 %
OP Mortgage Bank	1.000.000	0,05 %	22.02.2023	992.210	0,05 %
OP Corporate Bank plc	900.000	2,00 %	03.03.2021	954.289	0,05 %
Nordea Mortgage Bank plc	900.000	0,63 %	19.10.2022	920.540	0,04 %
OP Mortgage Bank	900.000	0,25 %	13.03.2024	895.130	0,04 %
Nordea Mortgage Bank plc	900.000	0,63 %	17.03.2027	892.373	0,04 %
Nordea Mortgage Bank plc	700.000	1,38 %	15.01.2020	723.666	0,04 %
Danske Kiinnitysluottopankki OYJ	700.000	0,25 %	26.11.2020	707.881	0,03 %
OP Mortgage Bank	700.000	0,25 %	23.11.2020	707.592	0,03 %
OP Corporate Bank plc	600.000	0,88 %	21.06.2021	615.309	0,03 %
OP Corporate Bank plc	600.000	1,13 %	17.06.2019	610.974	0,03 %
Danske Kiinnitysluottopankki OYJ	550.000	1,63 %	27.09.2019	568.562	0,03 %
Danske Kiinnitysluottopankki OYJ	500.000	3,88 %	21.06.2021	567.561	0,03 %
Nordea Mortgage Bank plc	500.000	1,25 %	14.01.2019	508.391	0,03 %
OP Mortgage Bank	500.000	0,75 %	11.06.2019	508.005	0,02 %
Citycon Treasury BV	400.000	2,50 %	01.10.2024	430.792	0,02 %
Sampo OYJ	400.000	1,50 %	16.09.2021	417.882	0,02 %
Aktia Bank OYJ	400.000	0,25 %	31.03.2022	402.822	0,02 %
SP-Mortgage Bank plc	370.000	0,13 %	24.10.2022	368.290	0,02 %
Citycon Oyj	300.000	3,75 %	24.06.2020	325.912	0,02 %
OP Corporate Bank plc	200.000	5,75 %	28.02.2022	242.911	0,01 %
Nordea Mortgage Bank plc	200.000	1,00 %	05.11.2024	207.826	0,01 %
				19.448.421	0,94 %
Frankreich 16,33 % (2016: 16,80 %)					
Cie de Financement Foncier SA	3.450.000	3,50 %	05.11.2020	3.814.023	0,18 %
Caisse Francaise de Financement Local	2.900.000	0,63 %	26.01.2023	2.967.529	0,14 %
BPCE SFH SA	2.500.000	1,50 %	30.01.2020	2.594.878	0,13 %
Cie de Financement Foncier SA	2.400.000	0,38 %	29.10.2020	2.441.114	0,12 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	2.000.000	4,30 %	24.02.2023	2.429.968	0,12 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	2.150.000	5,00 %	08.04.2019	2.297.421	0,11 %
Credit Agricole SA	2.000.000	2,63 %	17.03.2027	2.161.056	0,10 %
Societe Generale SCF SA	2.000.000	5,00 %	27.03.2019	2.133.748	0,10 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	1.900.000	3,75 %	11.01.2021	2.128.916	0,10 %
Cie de Financement Foncier SA	1.650.000	4,00 %	24.10.2025	2.085.775	0,10 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	2.000.000	1,38 %	17.06.2020	2.082.916	0,10 %
Veolia Environnement SA	2.100.000	0,31 %	04.10.2023	2.060.734	0,10 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	1.700.000	3,60 %	08.03.2024	2.049.454	0,10 %
Engie SA	2.000.000	0,88 %	27.03.2024	2.025.692	0,10 %
Caisse Francaise de Financement Local	2.000.000	1,25 %	11.05.2032	2.011.670	0,10 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	2.000.000	0,38 %	13.01.2022	2.006.132	0,10 %
TOTAL SA^	1.900.000	2,63 %	26.02.2166	1.998.800	0,10 %
Engie SA	2.000.000	0,38 %	28.02.2023	1.993.200	0,10 %
Caisse Francaise de Financement Local	1.700.000	4,88 %	02.06.2021	1.990.292	0,10 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	1.900.000	0,38 %	24.03.2023	1.921.069	0,09 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	1.500.000	4,00 %	16.07.2025	1.889.506	0,09 %
Sanofi	1.800.000	0,00 %	13.01.2020	1.803.474	0,09 %
Cie de Financement Foncier SA	1.650.000	4,38 %	25.04.2019	1.753.135	0,08 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	1.488.459	4,00 %	10.01.2022	1.733.241	0,08 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	1.500.000	3,30 %	23.09.2022	1.731.687	0,08 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH S.A.	1.700.000	0,38 %	12.09.2022	1.725.143	0,08 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	1.500.000	3,88 %	12.07.2021	1.712.070	0,08 %
Cie de Financement Foncier SA	1.400.000	4,88 %	25.05.2021	1.637.429	0,08 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	1.400.000	3,00 %	28.11.2023	1.596.531	0,08 %
Credit Agricole Assurances SA^	1.400.000	4,25 %	13.01.2167	1.563.906	0,08 %
BNP Paribas SA	1.500.000	1,13 %	15.01.2023	1.550.532	0,07 %
Cie de Financement Foncier SA	1.500.000	0,63 %	10.02.2023	1.536.075	0,07 %
BNP Paribas SA	1.500.000	1,13 %	10.10.2023	1.535.457	0,07 %
Caisse Francaise de Financement Local	1.500.000	0,75 %	11.01.2027	1.509.313	0,07 %
Gecina SA	1.500.000	1,38 %	26.01.2028	1.505.930	0,07 %
Credit Agricole SA	1.400.000	2,38 %	27.11.2020	1.495.157	0,07 %
BNP Paribas SA	1.446.000	1,50 %	17.11.2025	1.492.872	0,07 %
BNP Paribas SA	1.400.000	2,25 %	13.01.2021	1.490.031	0,07 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	1.300.000	4,38 %	17.03.2021	1.489.513	0,07 %
Orange SA	791.000	8,13 %	28.01.2033	1.474.740	0,07 %
TOTAL SA^	1.400.000	2,25 %	26.02.2166	1.461.334	0,07 %
Unibail-Rodamco SE	1.446.000	0,88 %	21.02.2025	1.452.070	0,07 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Bouygues SA	1.350.000	3,64 %	29.10.2019	1.440.166	0,07 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	1.200.000	4,00 %	17.06.2022	1.414.501	0,07 %
Caisse Francaise de Financement Local	1.300.000	4,25 %	07.02.2019	1.366.456	0,07 %
Eutelsat SA	1.300.000	2,63 %	13.01.2020	1.358.370	0,07 %
APRR SA	1.300.000	1,13 %	15.01.2021	1.335.281	0,06 %
BNP Paribas SA	1.100.000	4,50 %	21.03.2023	1.332.301	0,06 %
Credit Agricole SA	1.200.000	2,38 %	20.05.2024	1.325.894	0,06 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	1.200.000	4,13 %	20.07.2020	1.325.340	0,06 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	1.100.000	4,13 %	16.01.2023	1.320.086	0,06 %
Danone SA	1.300.000	0,17 %	03.11.2020	1.304.924	0,06 %
Cie de Financement Foncier SA	1.050.000	5,75 %	04.10.2021	1.279.089	0,06 %
BPCE SFH SA	1.100.000	3,75 %	13.09.2021	1.254.924	0,06 %
BPCE SFH SA	1.200.000	1,75 %	29.11.2019	1.248.166	0,06 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	1.200.000	2,00 %	19.09.2019	1.243.363	0,06 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	1.100.000	3,88 %	12.01.2021	1.236.772	0,06 %
Autoroutes du Sud de la France SA	1.000.000	5,63 %	04.07.2022	1.234.982	0,06 %
Orange SA^	1.100.000	4,00 %	01.10.2166	1.216.050	0,06 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	1.200.000	0,13 %	28.08.2020	1.212.437	0,06 %
Caisse Francaise de Financement Local	1.050.000	4,25 %	26.01.2021	1.192.649	0,06 %
BPCE SA	1.000.000	4,50 %	10.02.2022	1.174.373	0,06 %
CNP Assurances	1.100.000	1,88 %	20.10.2022	1.159.857	0,06 %
Capgemini SE	1.100.000	1,75 %	01.07.2020	1.140.470	0,05 %
Gecina SA	1.100.000	2,00 %	30.06.2032	1.133.958	0,05 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	1.000.000	3,13 %	22.03.2022	1.131.847	0,05 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	1.000.000	2,50 %	11.09.2023	1.128.611	0,05 %
BPCE SA	1.100.000	1,38 %	22.05.2019	1.123.313	0,05 %
Caisse Francaise de Financement Local	850.000	5,38 %	08.07.2024	1.123.242	0,05 %
Carrefour SA	1.100.000	1,25 %	03.06.2025	1.122.728	0,05 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	980.000	2,40 %	17.01.2025	1.116.822	0,05 %
AXA SA^	1.000.000	3,38 %	06.07.2047	1.107.486	0,05 %
Capgemini SE	1.000.000	2,50 %	01.07.2023	1.097.119	0,05 %
Cie de Financement Foncier SA	950.000	4,38 %	15.04.2021	1.090.932	0,05 %
Total Capital International SA	1.000.000	2,13 %	19.11.2021	1.075.799	0,05 %
BNP Paribas SA	950.000	2,88 %	26.09.2023	1.073.763	0,05 %
CIF Euromortgage SA	1.000.000	3,75 %	23.10.2019	1.073.323	0,05 %
Accor SA	1.000.000	2,63 %	05.02.2021	1.069.540	0,05 %
Orange SA^	900.000	5,00 %	01.10.2166	1.067.288	0,05 %
BPCE SA	1.000.000	2,13 %	17.03.2021	1.064.120	0,05 %
Unibail-Rodamco SE	950.000	3,88 %	05.11.2020	1.053.801	0,05 %
Caisse Francaise de Financement Local	1.000.000	1,75 %	16.07.2020	1.051.169	0,05 %
Mercialys SA	1.000.000	4,13 %	26.03.2019	1.048.839	0,05 %
Societe Generale SFH SA	1.000.000	2,88 %	14.03.2019	1.039.195	0,05 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	950.000	3,75 %	19.02.2020	1.032.915	0,05 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	1.000.000	1,38 %	03.02.2032	1.029.262	0,05 %
Credit Agricole SA	1.000.000	1,38 %	03.05.2027	1.028.135	0,05 %
Suez	950.000	6,25 %	08.04.2019	1.025.753	0,05 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	1.000.000	0,63 %	28.11.2022	1.025.007	0,05 %
Credit Agricole SA	1.000.000	0,88 %	19.01.2022	1.023.859	0,05 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	1.000.000	1,88 %	04.11.2026	1.023.370	0,05 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	1.000.000	0,63 %	11.09.2023	1.022.604	0,05 %
Cie de Financement Foncier SA	1.000.000	0,75 %	21.01.2025	1.021.602	0,05 %
Cie de Financement Foncier SA	700.000	3,88 %	25.04.2055	1.020.474	0,05 %
BNP Paribas SA	1.000.000	0,75 %	11.11.2022	1.017.111	0,05 %
JCDecaux SA	1.000.000	1,00 %	01.06.2023	1.015.971	0,05 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	1.000.000	0,63 %	10.02.2025	1.014.747	0,05 %
Suez	1.000.000	1,63 %	21.09.2032	1.012.910	0,05 %
Cie de Financement Foncier SA	1.000.000	0,50 %	04.09.2024	1.009.236	0,05 %
AXA Bank Europe SCF	1.000.000	0,38 %	23.03.2023	1.008.279	0,05 %
TOTAL SA^	900.000	3,88 %	18.05.2166	1.008.000	0,05 %
Engie SA	1.000.000	1,38 %	28.02.2029	1.007.849	0,05 %
BPCE SFH SA	1.000.000	1,00 %	08.06.2029	1.006.411	0,05 %
BPCE SFH SA	1.000.000	0,88 %	13.04.2028	1.005.210	0,05 %
BPCE SFH SA	1.000.000	0,38 %	21.02.2024	1.002.887	0,05 %
Danone SA	1.000.000	1,21 %	03.11.2028	1.000.276	0,05 %
Cie de Financement Foncier SA	1.000.000	0,38 %	11.12.2024	999.020	0,05 %
Societe Generale SFH SA	1.000.000	0,25 %	23.01.2024	998.368	0,05 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Credit Agricole Home Loan SFH SA	1.000.000	0,25 %	23.02.2024	997.191	0,05 %
Arkea Home Loans SFH SA	1.000.000	0,75 %	05.10.2027	997.079	0,05 %
Holding d'Infrastructures de Transport SAS	1.000.000	0,63 %	27.03.2023	996.581	0,05 %
BNP Paribas SA	900.000	2,88 %	01.10.2026	996.120	0,05 %
BPCE SA	900.000	2,88 %	22.04.2026	995.175	0,05 %
HSBC SFH France SA	900.000	2,00 %	16.10.2023	991.595	0,05 %
Total Capital International SA	1.000.000	0,25 %	12.07.2023	990.080	0,05 %
BPCE SA	1.000.000	0,38 %	05.10.2023	990.053	0,05 %
Total Capital Canada Ltd.	900.000	2,13 %	18.09.2029	989.609	0,05 %
TOTAL SA^	900.000	3,37 %	06.10.2166	986.625	0,05 %
Renault SA	1.000.000	1,00 %	28.11.2025	986.484	0,05 %
Orange SA	1.000.000	0,88 %	03.02.2027	985.495	0,05 %
Credit Agricole Public Sector SCF SA	900.000	1,88 %	07.06.2023	980.796	0,05 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	900.000	2,63 %	31.03.2027	972.729	0,05 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	800.000	3,90 %	20.10.2023	971.146	0,05 %
Cie de Financement Foncier SA	1.000.000	0,23 %	14.09.2026	962.766	0,05 %
Carrefour SA	850.000	3,88 %	25.04.2021	952.816	0,05 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	900.000	1,63 %	19.01.2026	950.360	0,05 %
Credit Agricole SA	900.000	1,88 %	20.12.2026	945.266	0,05 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	850.000	3,00 %	21.05.2024	941.234	0,05 %
Credit Agricole SA	800.000	3,13 %	05.02.2026	940.590	0,05 %
Arkema SA	900.000	1,50 %	20.01.2025	933.921	0,04 %
AXA SA	900.000	1,13 %	15.05.2028	932.038	0,04 %
Credit Agricole SA	900.000	1,25 %	14.04.2026	923.149	0,04 %
Klepierre SA	900.000	1,00 %	17.04.2023	921.397	0,04 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	900.000	1,13 %	06.02.2019	915.146	0,04 %
Renault SA	900.000	1,00 %	08.03.2023	913.680	0,04 %
Autoroutes du Sud de la France SA	900.000	1,13 %	20.04.2026	913.331	0,04 %
Cie de Financement Foncier SA	900.000	0,38 %	17.09.2019	911.498	0,04 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	900.000	0,75 %	26.05.2024	909.811	0,04 %
BNP Paribas SA	820.000	2,38 %	20.05.2024	908.042	0,04 %
RCI Banque SA	900.000	0,75 %	26.09.2022	905.814	0,04 %
AXA SA^	800.000	3,88 %	08.10.2166	905.690	0,04 %
Cie de Financement Foncier SA	900.000	0,33 %	12.09.2023	905.089	0,04 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	800.000	3,90 %	18.01.2021	901.118	0,04 %
Airbus Finance BV	900.000	1,38 %	13.05.2031	892.080	0,04 %
Unibail-Rodamco SE	800.000	2,50 %	26.02.2024	891.163	0,04 %
AXA SA^	740.000	5,13 %	04.07.2043	888.214	0,04 %
AXA SA^	800.000	5,25 %	16.04.2040	886.558	0,04 %
BNP Paribas SA	800.000	2,75 %	27.01.2026	874.970	0,04 %
Sanofi	800.000	4,13 %	11.10.2019	861.468	0,04 %
BNP Paribas SA^	800.000	2,88 %	20.03.2026	854.488	0,04 %
BNP Paribas SA	750.000	2,88 %	24.10.2022	839.011	0,04 %
Credit Agricole SA	750.000	3,90 %	19.04.2021	838.428	0,04 %
Pernod Ricard SA	800.000	2,00 %	22.06.2020	838.037	0,04 %
Caisse Francaise de Financement Local	800.000	1,13 %	09.09.2025	836.785	0,04 %
Orange SA	800.000	4,13 %	23.01.2019	835.394	0,04 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	800.000	1,38 %	22.04.2020	831.242	0,04 %
Engie SA	800.000	1,38 %	19.05.2020	826.103	0,04 %
Societe Generale SA	700.000	4,25 %	13.07.2022	823.592	0,04 %
Bouygues SA	700.000	4,50 %	09.02.2022	820.527	0,04 %
Klepierre SA	800.000	1,38 %	16.02.2027	816.868	0,04 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	800.000	0,38 %	21.10.2021	814.242	0,04 %
Credit Agricole SA	750.000	5,88 %	11.06.2019	813.075	0,04 %
Credit Mutuel Arkea SA	800.000	1,25 %	31.05.2024	812.320	0,04 %
BNP Paribas SA	700.000	4,13 %	14.01.2022	810.990	0,04 %
Air Liquide Finance SA	800.000	0,75 %	13.06.2024	808.660	0,04 %
Societe Generale SA	700.000	4,00 %	07.06.2023	808.464	0,04 %
Valeo SA	800.000	0,63 %	11.01.2023	806.714	0,04 %
BNP Paribas SA	800.000	1,50 %	23.05.2028	802.712	0,04 %
Air Liquide Finance SA	800.000	0,13 %	13.06.2020	802.538	0,04 %
Societe Generale SA	700.000	4,75 %	02.03.2021	802.423	0,04 %
Caisse Francaise de Financement Local	800.000	0,63 %	13.04.2026	801.798	0,04 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	800.000	0,38 %	30.09.2024	799.835	0,04 %
Cie de Saint-Gobain	800.000	0,00 %	27.03.2020	798.790	0,04 %
La Banque Postale Home Loan SFH SA	800.000	0,38 %	24.01.2025	798.203	0,04 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	700.000	3,60 %	13.09.2021	796.572	0,04 %
Vivendi SA	800.000	0,88 %	18.09.2024	795.494	0,04 %
Suez	700.000	4,08 %	17.05.2021	792.910	0,04 %
Total Capital International SA	700.000	2,50 %	25.03.2026	792.135	0,04 %
La Banque Postale Home Loan SFH SA	700.000	2,38 %	15.01.2024	787.317	0,04 %
Engie SA^	700.000	3,88 %	02.06.2166	786.702	0,04 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	700.000	2,63 %	18.03.2024	783.211	0,04 %
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA	800.000	0,38 %	07.02.2025	775.167	0,04 %
Sanofi	800.000	0,50 %	13.01.2027	774.678	0,04 %
Orange SA^	650.000	5,25 %	07.02.2166	771.670	0,04 %
Airbus Finance BV	700.000	2,38 %	02.04.2024	771.047	0,04 %
Autoroutes du Sud de la France SA	700.000	4,13 %	13.04.2020	765.082	0,04 %
Gecina SA	800.000	1,00 %	30.01.2029	761.422	0,04 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	750.000	0,00 %	26.05.2020	750.231	0,04 %
TOTAL SA^	700.000	2,71 %	05.05.2166	746.788	0,04 %
Societe Generale SA^	700.000	2,50 %	16.09.2026	742.279	0,04 %
Carrefour SA	700.000	1,75 %	15.07.2022	739.566	0,04 %
Sodexo SA	700.000	1,75 %	24.01.2022	738.221	0,04 %
APRR SA	700.000	1,50 %	15.01.2024	732.605	0,04 %
Publicis Groupe SA	700.000	1,63 %	16.12.2024	732.571	0,04 %
Kering	700.000	1,38 %	01.10.2021	730.188	0,04 %
Cie de Financement Foncier SA	700.000	0,63 %	12.11.2021	718.278	0,03 %
Sanofi	700.000	0,88 %	22.09.2021	717.903	0,03 %
BPCE SA	700.000	1,13 %	18.01.2023	717.115	0,03 %
Bouygues SA	700.000	1,38 %	07.06.2027	716.702	0,03 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	700.000	0,88 %	07.04.2026	716.510	0,03 %
Arkema SA	700.000	1,50 %	20.04.2027	715.208	0,03 %
Gecina SA	700.000	1,38 %	30.06.2027	710.725	0,03 %
CNP Assurances^	600.000	4,50 %	10.06.2047	709.620	0,03 %
Credit Agricole Public Sector SCF SA	700.000	0,88 %	02.08.2027	708.888	0,03 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	700.000	0,75 %	05.05.2027	702.292	0,03 %
Holding d'Infrastructures de Transport SAS	700.000	1,63 %	27.11.2027	701.692	0,03 %
Danone SA	700.000	0,71 %	03.11.2024	699.991	0,03 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	600.000	4,00 %	17.01.2022	698.062	0,03 %
AXA SA^	600.000	3,94 %	07.11.2166	679.380	0,03 %
BNP Paribas SA	650.000	2,50 %	23.08.2019	678.014	0,03 %
Caisse Francaise de Financement Local	600.000	2,38 %	17.01.2024	675.050	0,03 %
Credit Mutuel Arkea SA	600.000	3,25 %	01.06.2026	666.886	0,03 %
Wendel SA	600.000	2,75 %	02.10.2024	659.647	0,03 %
Auchan Holding SA	600.000	2,38 %	12.12.2022	654.688	0,03 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH S.A.	600.000	1,75 %	19.06.2024	654.240	0,03 %
Pernod Ricard SA	600.000	2,13 %	27.09.2024	649.462	0,03 %
Engie SA	600.000	6,88 %	24.01.2019	644.766	0,03 %
Veolia Environnement SA	400.000	6,13 %	25.11.2033	644.722	0,03 %
Gecina SA	600.000	2,00 %	17.06.2024	643.199	0,03 %
BNP Paribas SA	600.000	2,38 %	17.02.2025	641.750	0,03 %
Klepierre SA	600.000	1,88 %	19.02.2026	640.739	0,03 %
Total Capital SA	500.000	5,13 %	26.03.2024	640.317	0,03 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	600.000	2,38 %	24.03.2026	639.840	0,03 %
HSBC SFH France SA	600.000	1,88 %	28.10.2020	636.157	0,03 %
Legrand SA	600.000	1,88 %	06.07.2032	634.877	0,03 %
Essilor International Cie Generale d'Optique SA	600.000	1,75 %	09.04.2021	629.312	0,03 %
Total Capital Canada Ltd.	600.000	1,88 %	09.07.2020	628.512	0,03 %
Societe Generale SFH SA	600.000	1,75 %	05.03.2020	627.184	0,03 %
Total Capital Canada Ltd.	600.000	1,13 %	18.03.2022	622.200	0,03 %
Danone SA	600.000	1,25 %	30.05.2024	621.133	0,03 %
Engie SA^	600.000	3,00 %	02.06.2166	620.694	0,03 %
Engie SA	600.000	2,00 %	28.09.2037	620.166	0,03 %
Suez	600.000	1,50 %	03.04.2029	615.200	0,03 %
Unibail-Rodamco SE	600.000	2,00 %	28.04.2036	615.176	0,03 %
Societe Generale SA	600.000	1,00 %	01.04.2022	612.581	0,03 %
Orange SA	550.000	3,88 %	14.01.2021	612.099	0,03 %
Total Capital International SA	600.000	1,38 %	04.10.2029	610.645	0,03 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	600.000	1,00 %	25.02.2019	609.823	0,03 %
Sanofi	600.000	1,13 %	05.04.2028	608.837	0,03 %
Vivendi SA	600.000	0,75 %	26.05.2021	608.464	0,03 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
BPCE SA	600.000	0,63 %	20.04.2020	608.303	0,03 %
APRR SA	600.000	1,13 %	09.01.2026	607.840	0,03 %
Caisse Francaise de Financement Local	500.000	3,00 %	02.10.2028	607.777	0,03 %
Societe Generale SA	600.000	0,75 %	26.05.2023	607.673	0,03 %
BPCE SFH SA	600.000	0,38 %	10.02.2023	606.598	0,03 %
Schneider Electric SE	600.000	0,88 %	11.03.2025	603.256	0,03 %
Cie de Saint-Gobain	600.000	1,00 %	17.03.2025	602.491	0,03 %
ICADE	600.000	1,13 %	17.11.2025	598.041	0,03 %
BPCE SA	500.000	4,25 %	06.02.2023	596.350	0,03 %
Credit Agricole Assurances SA^	500.000	4,75 %	27.09.2048	593.750	0,03 %
Orange SA^	550.000	4,25 %	07.02.2166	590.771	0,03 %
COFACE SA	500.000	4,13 %	27.03.2024	585.000	0,03 %
CIF Euromortgage SA	500.000	4,13 %	19.01.2022	582.103	0,03 %
CNP Assurances^	500.000	6,00 %	14.09.2040	575.000	0,03 %
Orange SA	500.000	3,13 %	09.01.2024	572.216	0,03 %
Orange SA	500.000	3,38 %	16.09.2022	569.497	0,03 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	500.000	3,25 %	23.08.2022	568.300	0,03 %
Cie de Saint-Gobain	500.000	3,63 %	28.03.2022	567.144	0,03 %
Orange SA	500.000	3,00 %	15.06.2022	558.210	0,03 %
Cie de Financement Foncier SA	500.000	2,00 %	07.05.2024	552.413	0,03 %
Air Liquide Finance SA	500.000	3,89 %	09.06.2020	547.920	0,03 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	500.000	3,50 %	22.06.2020	547.146	0,03 %
CIF Euromortgage SA	500.000	3,50 %	17.06.2020	545.545	0,03 %
TDF Infrastructure SAS	500.000	2,88 %	19.10.2022	544.797	0,03 %
BPCE SFH SA	500.000	1,75 %	27.06.2024	544.740	0,03 %
Veolia Environnement SA	500.000	6,75 %	24.04.2019	544.439	0,03 %
Renault SA	500.000	3,13 %	05.03.2021	543.930	0,03 %
Schneider Electric SE	500.000	2,50 %	06.09.2021	541.900	0,03 %
Air Liquide Finance SA	500.000	1,88 %	05.06.2024	539.995	0,03 %
Accor SA	500.000	2,38 %	17.09.2023	539.820	0,03 %
Legrand SA	500.000	1,88 %	16.12.2027	538.830	0,03 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	500.000	2,63 %	24.02.2021	538.816	0,03 %
BNP Paribas SA^	500.000	2,63 %	14.10.2027	538.155	0,03 %
Sanofi	500.000	1,75 %	10.09.2026	538.144	0,03 %
Danone SA	500.000	2,25 %	15.11.2021	537.497	0,03 %
Vinci SA	500.000	3,38 %	30.03.2020	537.494	0,03 %
Carmila SAS	500.000	2,38 %	18.09.2023	535.501	0,03 %
Societe Fonciere Lyonnaise SA	500.000	2,25 %	16.11.2022	534.680	0,03 %
BPCE SA^	500.000	2,75 %	08.07.2026	533.169	0,03 %
BPCE SFH SA	500.000	2,13 %	17.09.2020	532.111	0,03 %
Suez^	500.000	2,88 %	19.04.2166	528.750	0,03 %
La Banque Postale Home Loan SFH SA	500.000	1,88 %	11.09.2020	528.557	0,03 %
Societe Generale SFH SA	500.000	1,63 %	05.01.2021	527.541	0,03 %
Societe Generale SCF SA	450.000	4,13 %	15.02.2022	526.964	0,03 %
Auchan Holding SA	500.000	1,75 %	23.04.2021	525.805	0,03 %
Schneider Electric SE	500.000	1,50 %	08.09.2023	525.413	0,03 %
Societe Generale SA	500.000	2,25 %	23.01.2020	523.392	0,03 %
Total Capital International SA	500.000	1,38 %	19.03.2025	523.381	0,03 %
Sanofi	500.000	1,88 %	04.09.2020	523.024	0,03 %
Engie SA	300.000	5,95 %	16.03.2111	521.550	0,03 %
BPCE SFH SA	500.000	1,00 %	24.02.2025	519.698	0,03 %
Credit Agricole Public Sector SCF SA	500.000	1,88 %	20.09.2019	519.468	0,03 %
HSBC France SA	500.000	1,88 %	16.01.2020	519.389	0,03 %
Air Liquide Finance SA	500.000	1,25 %	03.06.2025	518.682	0,02 %
Imerys SA	500.000	1,88 %	31.03.2028	518.379	0,02 %
Mercialys SA	500.000	1,79 %	31.03.2023	518.199	0,02 %
RCI Banque SA	500.000	1,63 %	11.04.2025	517.548	0,02 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	500.000	1,25 %	14.01.2025	516.849	0,02 %
Publicis Groupe SA	500.000	1,13 %	16.12.2021	513.763	0,02 %
RCI Banque SA	500.000	1,38 %	08.03.2024	513.302	0,02 %
Infra Park SAS	500.000	1,25 %	16.10.2020	513.176	0,02 %
Danone SA	500.000	1,13 %	14.01.2025	513.001	0,02 %
Edenred	500.000	1,38 %	10.03.2025	511.370	0,02 %
Societe Generale SA	500.000	0,75 %	25.11.2020	509.940	0,02 %
Societe Generale SA	500.000	0,75 %	19.02.2021	509.762	0,02 %
Credit Agricole SA	500.000	1,00 %	16.09.2024	509.667	0,02 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Vivendi SA	500.000	1,13 %	24.11.2023	509.374	0,02 %
Societe Generale SFH SA	500.000	0,50 %	20.01.2023	509.305	0,02 %
BPCE SFH SA	500.000	0,50 %	11.10.2022	509.243	0,02 %
HSBC SFH France SA	500.000	0,38 %	11.03.2022	508.167	0,02 %
Unibail-Rodamco SE	500.000	1,00 %	14.03.2025	506.169	0,02 %
Sanofi	500.000	0,63 %	05.04.2024	504.176	0,02 %
Air Liquide Finance SA	500.000	0,38 %	18.04.2022	503.230	0,02 %
RCI Banque SA	500.000	0,63 %	10.11.2021	503.112	0,02 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	500.000	0,38 %	26.05.2022	501.840	0,02 %
AXA Bank Europe SCF	500.000	0,13 %	14.03.2022	501.475	0,02 %
Airbus Finance BV	500.000	0,88 %	13.05.2026	497.500	0,02 %
Caisse Francaise de Financement Local	500.000	1,25 %	22.01.2035	494.050	0,02 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	450.000	3,13 %	09.09.2020	491.089	0,02 %
Schneider Electric SE	450.000	3,63 %	20.07.2020	490.864	0,02 %
BNP Paribas Public Sector SCF SA	450.000	3,75 %	26.02.2020	489.647	0,02 %
BPCE SA	400.000	4,63 %	18.07.2023	476.950	0,02 %
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA	500.000	0,75 %	09.09.2028	474.836	0,02 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	450.000	1,38 %	25.10.2019	464.247	0,02 %
Valeo SA	400.000	3,25 %	22.01.2024	462.485	0,02 %
Arkea Public Sector SCF SA	400.000	3,75 %	07.10.2021	457.869	0,02 %
Engie SA^	400.000	4,75 %	10.07.2166	452.482	0,02 %
Suez	400.000	2,75 %	09.10.2023	451.284	0,02 %
Veolia Environnement SA	400.000	4,25 %	06.01.2021	448.949	0,02 %
Arkea Home Loans SFH SA	400.000	2,38 %	11.07.2023	446.958	0,02 %
Sanofi	400.000	2,50 %	14.11.2023	446.914	0,02 %
Air Liquide SA	400.000	2,38 %	06.09.2023	442.750	0,02 %
Danone SA	400.000	3,60 %	23.11.2020	440.855	0,02 %
Orange SA	400.000	3,88 %	09.04.2020	434.912	0,02 %
Auchan Holding SA	400.000	2,25 %	06.04.2023	434.086	0,02 %
BPCE SA^	400.000	2,75 %	30.11.2027	431.938	0,02 %
Suez	400.000	1,75 %	10.09.2025	426.294	0,02 %
Sanofi	400.000	1,50 %	22.09.2025	426.176	0,02 %
Kering	400.000	2,50 %	15.07.2020	424.837	0,02 %
ICADE	400.000	1,88 %	14.09.2022	424.770	0,02 %
Suez^	400.000	3,00 %	23.06.2166	421.400	0,02 %
APRR SA	400.000	4,88 %	21.01.2019	420.690	0,02 %
TDF Infrastructure SAS	400.000	2,50 %	07.04.2026	418.471	0,02 %
Caisse Francaise de Financement Local	400.000	1,50 %	13.01.2031	418.323	0,02 %
Credit Agricole SA	400.000	3,88 %	13.02.2019	417.922	0,02 %
Valeo SA	400.000	1,63 %	18.03.2026	417.852	0,02 %
APRR SA	400.000	2,25 %	16.01.2020	417.819	0,02 %
Pernod Ricard SA	400.000	1,50 %	18.05.2026	415.107	0,02 %
Schneider Electric SE	400.000	3,50 %	22.01.2019	415.006	0,02 %
Sanofi	400.000	1,13 %	10.03.2022	414.379	0,02 %
RCI Banque SA	400.000	1,38 %	17.11.2020	413.536	0,02 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	400.000	1,25 %	04.11.2019	410.627	0,02 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	400.000	1,25 %	24.03.2031	410.280	0,02 %
Kering	400.000	1,25 %	10.05.2026	409.136	0,02 %
Autoroutes du Sud de la France SA	400.000	1,25 %	18.01.2027	408.049	0,02 %
Orange SA	400.000	1,00 %	12.05.2025	404.464	0,02 %
RCI Banque SA	400.000	0,63 %	04.03.2020	404.212	0,02 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	400.000	0,25 %	14.06.2019	402.060	0,02 %
Danone SA^	400.000	1,75 %	23.06.2166	401.988	0,02 %
Sanofi	400.000	0,00 %	05.04.2019	400.969	0,02 %
Danone SA	400.000	0,42 %	03.11.2022	400.751	0,02 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	400.000	1,63 %	15.11.2027	395.436	0,02 %
Veolia Environnement SA	350.000	4,38 %	11.12.2020	393.568	0,02 %
APRR SA	400.000	1,50 %	17.01.2033	390.113	0,02 %
Total Capital International SA	400.000	0,75 %	12.07.2028	386.868	0,02 %
Societe Generale SCF SA	300.000	4,25 %	03.02.2023	362.605	0,02 %
Caisse Francaise de Financement Local	319.000	3,50 %	24.09.2020	351.490	0,02 %
CNP Assurances^	300.000	4,25 %	05.06.2045	349.169	0,02 %
Total Capital International SA	300.000	2,88 %	19.11.2025	347.912	0,02 %
Transport et Infrastructures Gaz France SA	300.000	4,34 %	07.07.2021	340.828	0,02 %
Autoroutes du Sud de la France SA	300.000	2,95 %	17.01.2024	340.289	0,02 %
Cie de Saint-Gobain	300.000	3,63 %	15.06.2021	334.712	0,02 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Societe Generale SFH SA	300.000	2,00 %	29.04.2024	331.832	0,02 %
Suez	250.000	5,50 %	22.07.2024	329.763	0,02 %
SCOR SE^	300.000	3,00 %	08.06.2046	329.220	0,02 %
Arkema SA	300.000	3,85 %	30.04.2020	326.261	0,02 %
Unibail-Rodamco SE	316.000	1,38 %	09.03.2026	325.701	0,02 %
Cie de Saint-Gobain	300.000	4,50 %	30.09.2019	323.744	0,02 %
Transport et Infrastructures Gaz France SA	300.000	2,20 %	05.08.2025	323.382	0,02 %
Credit Agricole Public Sector SCF SA	333.000	0,25 %	31.10.2026	320.914	0,02 %
Infra Park SAS	300.000	2,13 %	16.04.2025	320.513	0,02 %
Engie SA	300.000	3,13 %	21.01.2020	319.373	0,02 %
ICADE	300.000	2,25 %	16.04.2021	317.968	0,02 %
BNP Paribas SA	300.000	2,25 %	11.01.2027	315.641	0,02 %
Eutelsat SA	300.000	5,00 %	14.01.2019	315.290	0,02 %
Fonciere Des Regions	300.000	1,88 %	20.05.2026	312.998	0,02 %
BNP Paribas SA	300.000	1,50 %	25.05.2028	311.045	0,01 %
Orange SA	300.000	1,88 %	02.10.2019	310.396	0,01 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	300.000	1,00 %	24.09.2021	308.986	0,01 %
RCI Banque SA	300.000	1,25 %	08.06.2022	308.651	0,01 %
Arkea Home Loans SFH SA	300.000	0,63 %	30.09.2022	306.984	0,01 %
Kering	300.000	0,88 %	28.03.2022	306.907	0,01 %
Danone SA	300.000	1,38 %	10.06.2019	306.486	0,01 %
APRR SA	300.000	1,25 %	06.01.2027	304.994	0,01 %
BPCE SA	300.000	0,75 %	22.01.2020	304.891	0,01 %
Caisse Francaise de Financement Local	300.000	0,38 %	16.09.2019	303.819	0,01 %
APRR SA	300.000	1,63 %	13.01.2032	302.170	0,01 %
Credit Mutuel Arkea SA^	300.000	1,88 %	25.10.2029	301.128	0,01 %
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA	300.000	1,13 %	13.10.2027	300.531	0,01 %
Suez	250.000	4,13 %	24.06.2022	293.574	0,01 %
SANEF SA	300.000	0,95 %	19.10.2028	283.092	0,01 %
RCI Banque SA	250.000	1,13 %	30.09.2019	254.920	0,01 %
BPCE SFH SA	200.000	2,38 %	29.11.2023	224.667	0,01 %
CNP Assurances^	200.000	4,00 %	18.11.2166	224.496	0,01 %
Sodexo SA	200.000	2,50 %	24.06.2026	224.049	0,01 %
AXA Bank Europe SCF	200.000	3,50 %	05.11.2020	221.279	0,01 %
Orange SA	200.000	2,50 %	01.03.2023	220.764	0,01 %
Total Capital International SA	200.000	2,13 %	15.03.2023	217.953	0,01 %
Societe Generale SA	200.000	2,63 %	27.02.2025	215.662	0,01 %
Holding d'Infrastructures de Transport SAS	200.000	2,25 %	24.03.2025	214.165	0,01 %
Michelin Luxembourg SCS	200.000	1,75 %	28.05.2027	213.585	0,01 %
Klepierre SA	200.000	1,75 %	06.11.2024	212.480	0,01 %
Vivendi SA	200.000	1,88 %	26.05.2026	212.046	0,01 %
APRR SA	200.000	1,88 %	06.01.2031	210.043	0,01 %
Kering	200.000	1,50 %	05.04.2027	206.506	0,01 %
Cie de Financement Foncier SA	200.000	1,13 %	11.03.2019	203.620	0,01 %
Imerys SA	200.000	1,50 %	15.01.2027	202.568	0,01 %
RCI Banque SA	200.000	1,00 %	17.05.2023	202.286	0,01 %
Cie de Financement Foncier SA	200.000	0,13 %	18.02.2020	201.884	0,01 %
RCI Banque SA	200.000	0,75 %	12.01.2022	201.650	0,01 %
Total Capital International SA	200.000	0,63 %	04.10.2024	199.795	0,01 %
Unibail-Rodamco SE	200.000	1,38 %	15.04.2030	197.616	0,01 %
Veolia Environnement SA	100.000	5,13 %	24.05.2022	120.525	0,01 %
Arkea Home Loans SFH SA	100.000	4,50 %	13.04.2021	115.258	0,01 %
Sogecap SA^	100.000	4,13 %	18.02.2166	112.685	0,01 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	100.000	3,00 %	11.09.2025	111.246	0,01 %
Carmila SAS	100.000	2,38 %	16.09.2024	107.100	0,01 %
RCI Banque SA	100.000	2,25 %	29.03.2021	106.049	0,01 %
Suez^	100.000	2,50 %	30.03.2166	105.439	0,01 %
GELF Bond Issuer I SA	100.000	1,75 %	22.11.2021	104.405	0,01 %
PSA Banque France SA	100.000	0,50 %	17.01.2020	100.771	0,00 %
Capgemini SE	100.000	0,50 %	09.11.2021	100.765	0,00 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	100.000	0,38 %	07.05.2025	99.678	0,00 %
Carrefour SA	100.000	0,75 %	26.04.2024	99.630	0,00 %
				338.812.578	16,33 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Deutschland 10,42 % (2016: 11,18 %)					
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.730.000	2,50 %	15.08.2046	2.269.725	0,11 %
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale	2.100.000	1,00 %	25.02.2019	2.133.470	0,10 %
Deutsche Bank AG	2.000.000	1,00 %	18.03.2019	2.022.034	0,10 %
Daimler International Finance BV	2.000.000	0,00 %	15.03.2019	2.002.860	0,10 %
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	2.000.000	0,38 %	09.10.2024	1.996.096	0,10 %
Deutsche Hypothekenbank AG	2.000.000	0,25 %	17.05.2024	1.990.292	0,10 %
Commerzbank AG	1.900.000	0,25 %	26.01.2022	1.919.118	0,09 %
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen^	1.500.000	6,25 %	26.05.2042	1.848.825	0,09 %
Daimler AG	1.800.000	0,25 %	11.05.2020	1.808.748	0,09 %
Allianz Finance II BV^	1.500.000	5,75 %	08.07.2041	1.758.289	0,09 %
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA	1.500.000	8,50 %	31.10.2019	1.733.205	0,08 %
Deutsche Telekom International Finance BV	1.700.000	0,63 %	03.04.2023	1.712.798	0,08 %
Allianz SE^	1.500.000	3,10 %	06.07.2047	1.641.303	0,08 %
HSH Nordbank AG	1.600.000	0,38 %	27.04.2023	1.589.770	0,08 %
Deutsche Telekom International Finance BV	1.500.000	1,50 %	03.04.2028	1.527.321	0,07 %
E.ON SE	1.500.000	0,38 %	23.08.2021	1.509.867	0,07 %
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale	1.400.000	2,00 %	26.04.2019	1.443.795	0,07 %
Deutsche Bank AG	1.400.000	1,25 %	08.09.2021	1.435.612	0,07 %
Volkswagen International Finance NV	1.400.000	1,13 %	02.10.2023	1.428.658	0,07 %
German Postal Pensions Securitisation plc	1.200.000	3,75 %	18.01.2021	1.336.328	0,06 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg	1.300.000	0,50 %	04.08.2022	1.326.514	0,06 %
Volkswagen International Finance NV	1.300.000	0,50 %	30.03.2021	1.309.594	0,06 %
Deutsche Bank AG	1.549.380	0,00 %	15.10.2026	1.267.768	0,06 %
E.ON International Finance BV	1.100.000	5,75 %	07.05.2020	1.250.700	0,06 %
Vonovia Finance BV	1.200.000	1,63 %	15.12.2020	1.250.146	0,06 %
BMW Finance NV	1.200.000	3,25 %	14.01.2019	1.242.458	0,06 %
innogy Finance BV	1.150.000	6,63 %	31.01.2019	1.233.765	0,06 %
Deutsche Postbank AG	1.100.000	3,63 %	15.02.2021	1.227.828	0,06 %
Daimler AG	1.200.000	1,50 %	03.07.2029	1.212.372	0,06 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	1.200.000	0,05 %	05.09.2022	1.196.533	0,06 %
Daimler AG	1.150.000	2,13 %	03.07.2037	1.174.329	0,06 %
Linde AG	1.100.000	1,75 %	17.09.2020	1.154.000	0,06 %
Volkswagen International Finance NV^	1.000.000	4,63 %	24.03.2166	1.126.250	0,05 %
BMW US Capital LLC	1.100.000	0,63 %	20.04.2022	1.116.782	0,05 %
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale	1.100.000	0,13 %	21.11.2022	1.101.106	0,05 %
Allianz SE^	900.000	5,63 %	17.10.2042	1.095.395	0,05 %
Bayer AG^	1.000.000	3,75 %	01.07.2074	1.094.952	0,05 %
Volkswagen Bank GmbH	1.100.000	1,25 %	15.12.2025	1.093.689	0,05 %
Allianz Finance II BV	1.000.000	4,75 %	22.07.2019	1.077.137	0,05 %
HeidelbergCement AG	1.000.000	2,25 %	03.06.2024	1.075.124	0,05 %
Deutsche Telekom International Finance BV	1.000.000	2,13 %	18.01.2021	1.061.150	0,05 %
innogy Finance BV	700.000	5,75 %	14.02.2033	1.059.118	0,05 %
Volkswagen International Finance NV^	1.000.000	3,88 %	14.06.2166	1.055.664	0,05 %
Bayer AG^	1.000.000	3,00 %	01.07.2075	1.048.750	0,05 %
Vier Gas Transport GmbH	1.000.000	2,00 %	12.06.2020	1.047.444	0,05 %
ATF Netherlands BV	1.000.000	1,50 %	03.05.2022	1.033.864	0,05 %
Volkswagen International Finance NV^	1.000.000	2,70 %	14.12.2166	1.029.974	0,05 %
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA	1.000.000	1,63 %	07.04.2026	1.028.546	0,05 %
Volkswagen International Finance NV^	1.000.000	2,50 %	20.03.2166	1.025.906	0,05 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	950.000	4,00 %	22.10.2019	1.023.976	0,05 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	1.000.000	1,25 %	04.02.2019	1.013.359	0,05 %
Daimler AG	1.000.000	0,63 %	05.03.2020	1.013.272	0,05 %
Commerzbank AG	886.000	4,00 %	30.03.2027	1.011.536	0,05 %
Linde Finance BV	1.000.000	0,25 %	18.01.2022	1.006.583	0,05 %
Volkswagen Leasing GmbH	1.000.000	1,13 %	04.04.2024	1.006.492	0,05 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg	1.000.000	0,10 %	21.01.2019	1.005.171	0,05 %
Deutsche Apotheker-und Aerztebank eG	1.000.000	0,75 %	05.10.2027	1.004.920	0,05 %
Muenchener Hypothekenbank eG	1.000.000	0,63 %	23.10.2026	1.002.721	0,05 %
Volkswagen Leasing GmbH	1.000.000	0,25 %	05.10.2020	1.001.790	0,05 %
Santander Consumer Bank AG	1.000.000	0,75 %	17.10.2022	1.000.636	0,05 %
LANXESS AG	1.000.000	0,25 %	07.10.2021	1.000.352	0,05 %
Allianz SE^	900.000	3,38 %	18.09.2166	998.100	0,05 %
German Postal Pensions Securitisation 2 plc	850.000	4,38 %	18.01.2022	993.997	0,05 %
Commerzbank AG	1.000.000	0,63 %	24.08.2027	993.977	0,05 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	1.000.000	0,63 %	30.08.2027	993.851	0,05 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	1.000.000	0,38 %	06.06.2025	993.336	0,05 %
Deutsche Hypothekenbank AG	1.000.000	0,13 %	23.11.2023	991.220	0,05 %
Daimler AG	1.000.000	1,00 %	15.11.2027	983.597	0,05 %
Commerzbank AG	800.000	7,75 %	16.03.2021	972.470	0,05 %
Volkswagen International Finance NV^	950.000	3,50 %	20.03.2166	960.882	0,05 %
Merck KGaA^	904.000	2,63 %	12.12.2074	955.980	0,05 %
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen^	800.000	6,00 %	26.05.2041	943.736	0,05 %
BMW Finance NV	900.000	0,75 %	12.07.2024	908.380	0,04 %
Dexia Kommunalbank Deutschland AG	900.000	0,38 %	03.03.2022	906.887	0,04 %
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	900.000	0,00 %	23.11.2020	905.392	0,04 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	900.000	0,20 %	01.03.2022	905.283	0,04 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	900.000	0,20 %	24.03.2023	902.066	0,04 %
Volkswagen Bank GmbH	900.000	0,75 %	15.06.2023	896.463	0,04 %
DVB Bank SE	900.000	1,00 %	25.04.2022	893.833	0,04 %
Commerzbank AG	900.000	0,50 %	13.09.2023	890.596	0,04 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	900.000	0,88 %	18.01.2030	885.960	0,04 %
Daimler AG	800.000	2,38 %	12.09.2022	876.608	0,04 %
Muenchener Hypothekenbank eG	850.000	0,38 %	10.11.2021	863.755	0,04 %
Deutsche Bank AG	800.000	2,38 %	11.01.2023	859.811	0,04 %
Volkswagen International Finance NV^	800.000	3,75 %	24.03.2166	856.800	0,04 %
UniCredit Bank AG	850.000	0,05 %	16.12.2019	855.965	0,04 %
Bertelsmann SE & Co. KGaA	800.000	1,75 %	14.10.2024	855.440	0,04 %
Wurth Finance International BV	820.000	1,75 %	21.05.2020	855.116	0,04 %
Deutsche Telekom International Finance BV	650.000	4,88 %	22.04.2025	838.890	0,04 %
SAP SE	800.000	1,13 %	20.02.2023	835.205	0,04 %
Allianz SE^	800.000	2,24 %	07.07.2045	831.846	0,04 %
SAP SE	800.000	1,00 %	01.04.2025	828.576	0,04 %
Deutsche Bank AG	800.000	1,50 %	20.01.2022	826.143	0,04 %
Bayerische Landesbank	800.000	0,88 %	10.09.2025	825.442	0,04 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	800.000	0,50 %	29.07.2022	816.051	0,04 %
BMW Finance NV	800.000	0,88 %	03.04.2025	810.056	0,04 %
Daimler AG	800.000	0,50 %	09.09.2019	807.838	0,04 %
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	800.000	0,10 %	04.03.2020	806.928	0,04 %
Muenchener Hypothekenbank eG	750.000	1,75 %	03.06.2022	806.530	0,04 %
Deutsche Telekom International Finance BV	800.000	0,25 %	19.04.2021	803.192	0,04 %
Allianz Finance II BV	800.000	0,00 %	21.04.2020	802.398	0,04 %
Deutsche Bank AG	800.000	1,13 %	17.03.2025	796.898	0,04 %
TLG Immobilien AG	800.000	1,38 %	27.11.2024	796.857	0,04 %
Grand City Properties SA	800.000	1,38 %	03.08.2026	795.706	0,04 %
Commerzbank AG	700.000	4,00 %	23.03.2026	794.277	0,04 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	650.000	2,88 %	10.03.2028	768.186	0,04 %
Volkswagen Leasing GmbH	700.000	2,63 %	15.01.2024	765.968	0,04 %
Deutsche Telekom International Finance BV	750.000	0,88 %	30.01.2024	760.065	0,04 %
innogy Finance BV	750.000	1,25 %	19.10.2027	750.764	0,04 %
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH	700.000	2,38 %	10.02.2021	747.307	0,04 %
Deutsche Bank AG	750.000	0,25 %	08.03.2024	745.554	0,04 %
Deutsche Telekom International Finance BV	650.000	2,75 %	24.10.2024	737.935	0,04 %
Daimler AG	700.000	1,40 %	12.01.2024	734.013	0,04 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	700.000	1,50 %	18.03.2020	727.047	0,04 %
Bayer AG^	700.000	2,38 %	02.04.2075	721.025	0,04 %
Deutsche Börse AG	650.000	2,38 %	05.10.2022	717.241	0,03 %
BMW Finance NV	650.000	2,38 %	24.01.2023	715.537	0,03 %
Fresenius Finance Ireland plc	680.000	2,13 %	01.02.2027	714.902	0,03 %
Aroundtown SA	700.000	1,88 %	19.01.2026	714.768	0,03 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	700.000	1,13 %	27.04.2020	714.608	0,03 %
LEG Immobilien AG	700.000	1,25 %	23.01.2024	714.412	0,03 %
Deutsche Telekom International Finance BV	700.000	1,38 %	30.01.2027	713.945	0,03 %
Allianz SE^	600.000	4,75 %	24.10.2166	712.610	0,03 %
Volkswagen Leasing GmbH	700.000	0,75 %	11.08.2020	711.171	0,03 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	700.000	0,50 %	19.01.2023	710.994	0,03 %
Bertelsmann SE & Co. KGaA	700.000	1,13 %	27.04.2026	710.315	0,03 %
innogy Finance BV	700.000	1,00 %	13.04.2025	705.827	0,03 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg	700.000	0,05 %	11.11.2021	702.752	0,03 %
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	700.000	0,13 %	30.09.2022	701.045	0,03 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg	700.000	0,38 %	27.02.2025	700.923	0,03 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Brenntag Finance BV	700.000	1,13 %	27.09.2025	694.365	0,03 %
Volkswagen International Finance NV^	600.000	5,13 %	04.09.2166	693.000	0,03 %
Berlin Hyp AG	650.000	4,50 %	03.05.2019	692.179	0,03 %
Bayer AG	650.000	1,88 %	25.01.2021	684.254	0,03 %
Allianz Finance II BV	600.000	3,50 %	14.02.2022	682.270	0,03 %
innogy Finance BV	650.000	1,88 %	30.01.2020	674.808	0,03 %
Vonovia Finance BV	600.000	3,63 %	08.10.2021	673.123	0,03 %
BMW Finance NV	650.000	1,00 %	15.02.2022	671.321	0,03 %
Commerzbank AG	700.000	0,13 %	15.12.2026	669.482	0,03 %
Deutsche Boerse AG^	625.000	2,75 %	05.02.2041	668.731	0,03 %
BASF SE	700.000	0,88 %	06.10.2031	662.254	0,03 %
Merck Financial Services GmbH	600.000	4,50 %	24.03.2020	660.476	0,03 %
Vonovia Finance BV^	600.000	4,00 %	17.12.2166	655.584	0,03 %
UniCredit Bank AG	600.000	1,88 %	12.09.2022	649.964	0,03 %
CRH Finance Germany GmbH	600.000	1,75 %	16.07.2021	628.469	0,03 %
BMW Finance NV	600.000	0,88 %	17.11.2020	614.409	0,03 %
Fresenius Finance Ireland plc	566.000	3,00 %	30.01.2032	611.217	0,03 %
Deutsche Bank SA Espanola	600.000	0,63 %	25.11.2020	610.611	0,03 %
Vonovia Finance BV	600.000	0,88 %	30.03.2020	610.053	0,03 %
Fresenius Finance Ireland plc	600.000	0,88 %	31.01.2022	609.844	0,03 %
Vonovia Finance BV	600.000	1,25 %	06.12.2024	608.039	0,03 %
Commerzbank AG	600.000	0,38 %	30.09.2019	607.585	0,03 %
BMW Finance NV	600.000	0,50 %	21.01.2020	607.241	0,03 %
Hella Finance International BV	600.000	1,00 %	17.05.2024	605.848	0,03 %
Deutsche Post AG	600.000	0,38 %	01.04.2021	605.231	0,03 %
Berlin Hyp AG	600.000	0,13 %	05.05.2022	602.526	0,03 %
BMW Finance NV	600.000	0,13 %	15.04.2020	602.100	0,03 %
BASF Finance Europe NV	600.000	0,00 %	10.11.2020	600.514	0,03 %
Allianz Finance II BV	500.000	3,00 %	13.03.2028	599.861	0,03 %
Volkswagen International Finance NV	600.000	1,63 %	16.01.2030	585.630	0,03 %
BASF SE	550.000	1,88 %	04.02.2021	581.977	0,03 %
Bayerische Landesbank	560.000	1,00 %	09.07.2021	581.531	0,03 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	550.000	1,75 %	12.03.2021	580.367	0,03 %
Vier Gas Transport GmbH	500.000	2,88 %	12.06.2025	575.524	0,03 %
Volkswagen International Finance NV	500.000	3,30 %	22.03.2033	573.768	0,03 %
BMW Finance NV	500.000	2,63 %	17.01.2024	562.886	0,03 %
Merck KGaA^	500.000	3,38 %	12.12.2074	552.460	0,03 %
Commerzbank AG	500.000	4,00 %	16.09.2020	552.207	0,03 %
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	500.000	3,25 %	18.01.2021	551.156	0,03 %
Volkswagen Leasing GmbH	500.000	2,38 %	06.09.2022	540.440	0,03 %
Deutsche Kreditbank AG	500.000	1,63 %	18.06.2024	539.866	0,03 %
Deutsche Bank AG	500.000	1,75 %	08.06.2022	535.784	0,03 %
Eurogrid GmbH	500.000	1,63 %	03.11.2023	526.940	0,03 %
Merck Financial Services GmbH	500.000	1,38 %	01.09.2022	525.048	0,03 %
Vier Gas Transport GmbH	500.000	2,00 %	12.06.2020	523.722	0,03 %
Deutsche Hypothekbank AG	515.000	0,63 %	29.07.2019	522.941	0,03 %
Berlin Hyp AG	500.000	1,25 %	23.04.2021	522.487	0,03 %
BMW Finance NV	500.000	1,25 %	05.09.2022	521.112	0,03 %
Continental AG	518.000	0,00 %	05.02.2020	518.611	0,03 %
Daimler AG	500.000	1,75 %	21.01.2020	517.949	0,03 %
Volkswagen International Finance NV	500.000	3,25 %	21.01.2019	517.113	0,03 %
BMW US Capital LLC	500.000	1,13 %	18.09.2021	517.088	0,03 %
Daimler AG	500.000	2,63 %	02.04.2019	516.881	0,03 %
Sparkasse KoelnBonn	500.000	1,13 %	30.04.2020	515.779	0,03 %
Berlin Hyp AG	500.000	1,25 %	22.01.2025	513.871	0,03 %
Deutsche Bank SA Espanola	500.000	0,63 %	15.12.2021	509.585	0,02 %
HSH Nordbank AG	500.000	0,75 %	07.10.2021	509.559	0,02 %
Eurogrid GmbH	500.000	1,50 %	18.04.2028	509.192	0,02 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	500.000	1,00 %	25.03.2019	508.340	0,02 %
Berlin Hyp AG	500.000	0,63 %	24.06.2019	507.473	0,02 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg	500.000	0,25 %	21.07.2020	506.261	0,02 %
Commerzbank AG	500.000	0,25 %	23.07.2020	506.093	0,02 %
Volkswagen Leasing GmbH	500.000	1,38 %	20.01.2025	505.869	0,02 %
ATF Netherlands BV	500.000	1,50 %	15.07.2024	505.393	0,02 %
BMW Finance NV	500.000	0,75 %	15.04.2024	505.109	0,02 %
DVB Bank SE	500.000	1,25 %	22.04.2020	504.807	0,02 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Berlin Hyp AG	500.000	0,13 %	22.10.2020	504.502	0,02 %
Commerzbank AG	500.000	0,63 %	14.03.2019	504.201	0,02 %
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale	500.000	0,13 %	29.07.2019	503.922	0,02 %
Münchener Hypothekbank eG	500.000	0,50 %	14.03.2025	503.157	0,02 %
DVB Bank SE	500.000	1,25 %	15.09.2021	502.405	0,02 %
HSH Nordbank AG	500.000	0,10 %	20.07.2020	501.316	0,02 %
Daimler International Finance BV	500.000	0,20 %	13.09.2021	499.840	0,02 %
HSH Nordbank AG	500.000	0,13 %	24.02.2021	499.613	0,02 %
Allianz Finance II BV	500.000	1,38 %	21.04.2031	499.591	0,02 %
Deutsche Apotheker- und Aerztebank eG	500.000	0,15 %	07.03.2023	499.000	0,02 %
Münchener Hypothekbank eG	500.000	0,50 %	22.04.2026	498.983	0,02 %
Deutsche Kreditbank AG	500.000	0,75 %	26.09.2024	497.606	0,02 %
UniCredit Bank AG	500.000	0,50 %	04.05.2026	496.765	0,02 %
Deutsche Genossenschafts-Hypothekbank AG	500.000	0,50 %	30.09.2026	496.433	0,02 %
UniCredit Bank AG	500.000	0,13 %	26.10.2023	496.130	0,02 %
Deutsche Kreditbank AG	500.000	0,50 %	19.03.2027	491.019	0,02 %
Commerzbank AG	500.000	0,05 %	11.07.2024	490.227	0,02 %
Evonik Finance BV	500.000	0,38 %	07.09.2024	485.701	0,02 %
Commerzbank AG	450.000	1,50 %	21.09.2022	472.351	0,02 %
Allianz Finance II BV^	400.000	5,75 %	08.07.2041	468.877	0,02 %
Deutsche Telekom International Finance BV	270.000	7,50 %	24.01.2033	468.091	0,02 %
HeidelbergCement AG	454.000	1,50 %	07.02.2025	467.121	0,02 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	450.000	1,50 %	10.03.2020	465.721	0,02 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	400.000	2,38 %	29.05.2028	456.803	0,02 %
Deutsche Post AG	400.000	2,75 %	09.10.2023	452.147	0,02 %
Talanx AG	400.000	2,50 %	23.07.2026	451.570	0,02 %
Hannover Rueck SE^	400.000	3,38 %	26.06.2166	444.100	0,02 %
UniCredit Bank AG	400.000	1,88 %	09.04.2024	439.188	0,02 %
Continental AG	400.000	3,13 %	09.09.2020	432.594	0,02 %
Robert Bosch GmbH	400.000	1,75 %	08.07.2024	431.299	0,02 %
Volkswagen Leasing GmbH	400.000	2,13 %	04.04.2022	427.036	0,02 %
Eurogrid GmbH	400.000	1,88 %	10.06.2025	426.614	0,02 %
Covestro AG	400.000	1,75 %	25.09.2024	424.935	0,02 %
Bertelsmann SE & Co. KGaA^	400.000	3,50 %	23.04.2075	420.154	0,02 %
Vonovia Finance BV	400.000	3,13 %	25.07.2019	419.871	0,02 %
Vonovia Finance BV^	400.000	4,63 %	08.04.2074	418.527	0,02 %
SAP SE	400.000	2,13 %	13.11.2019	417.415	0,02 %
Evonik Industries AG	400.000	1,88 %	08.04.2020	416.907	0,02 %
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	400.000	1,50 %	05.12.2019	413.919	0,02 %
Volkswagen International Finance NV	400.000	1,88 %	30.03.2027	412.716	0,02 %
Deutsche Post AG	400.000	1,25 %	01.04.2026	412.263	0,02 %
Commerzbank AG	400.000	0,88 %	08.09.2025	412.164	0,02 %
UniCredit Bank AG	400.000	0,75 %	24.07.2023	411.903	0,02 %
Linde Finance BV	400.000	1,75 %	11.06.2019	410.973	0,02 %
Daimler AG	400.000	0,88 %	12.01.2021	408.579	0,02 %
Berlin Hyp AG	400.000	1,63 %	29.01.2019	407.308	0,02 %
HSH Nordbank AG	400.000	0,75 %	22.06.2022	407.186	0,02 %
Aareal Bank AG	400.000	1,13 %	21.01.2019	406.296	0,02 %
Deutsche Genossenschafts-Hypothekbank AG	400.000	0,25 %	21.01.2021	405.062	0,02 %
Münchener Hypothekbank eG	400.000	0,25 %	14.10.2020	404.994	0,02 %
Continental Rubber of America Corp.	400.000	0,50 %	19.02.2019	402.846	0,02 %
Berlin Hyp AG	400.000	0,25 %	22.02.2023	402.213	0,02 %
Landesbank Baden-Württemberg	400.000	0,13 %	21.02.2022	402.200	0,02 %
DVB Bank SE	400.000	0,88 %	09.04.2021	398.486	0,02 %
Commerzbank AG	400.000	0,50 %	09.06.2026	397.624	0,02 %
Talanx Finanz Luxembourg SA^	300.000	8,37 %	15.06.2042	395.551	0,02 %
WL BANK AG Westfälische Landschaft Bodenkreditbank	400.000	0,50 %	01.04.2027	395.202	0,02 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	400.000	1,25 %	20.04.2035	387.420	0,02 %
Daimler AG	350.000	2,38 %	08.03.2023	386.322	0,02 %
Bayerische Landesbank	350.000	1,75 %	08.04.2024	381.735	0,02 %
HSH Nordbank AG	370.000	0,63 %	17.07.2019	374.201	0,02 %
Evonik Finance BV	400.000	0,75 %	07.09.2028	373.689	0,02 %
Hannover Finance Luxembourg SA^	300.000	5,75 %	14.09.2040	342.103	0,02 %
Commerzbank AG	300.000	4,13 %	07.04.2021	341.563	0,02 %
Talanx AG	300.000	3,13 %	13.02.2023	341.301	0,02 %
Evonik Finance BV	340.000	0,00 %	08.03.2021	338.126	0,02 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
BASF SE	300.000	2,50 %	22.01.2024	335.869	0,02 %
Eurogrid GmbH	300.000	3,88 %	22.10.2020	331.872	0,02 %
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale	300.000	1,88 %	26.06.2023	327.620	0,02 %
BASF SE	300.000	2,00 %	05.12.2022	326.043	0,02 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	300.000	1,88 %	21.01.2022	322.410	0,02 %
Vonovia Finance BV	300.000	2,13 %	09.07.2022	320.919	0,02 %
BSH Hausgerate GmbH	300.000	1,88 %	13.11.2020	315.228	0,02 %
Sparkasse KoelnBonn	300.000	1,13 %	14.10.2024	314.583	0,02 %
Hella GmbH & Co. KGaA	300.000	2,38 %	24.01.2020	314.122	0,02 %
Deutsche Bank AG	300.000	1,38 %	07.09.2020	312.118	0,02 %
Deutsche Telekom International Finance BV	300.000	2,00 %	30.10.2019	311.817	0,02 %
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	300.000	1,38 %	29.01.2020	310.510	0,02 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	300.000	1,13 %	29.05.2020	309.917	0,02 %
Deutsche Bank AG	300.000	2,13 %	01.03.2019	308.531	0,02 %
BMW Finance NV	300.000	1,63 %	17.07.2019	308.268	0,02 %
Vonovia Finance BV	300.000	1,50 %	31.03.2025	308.191	0,02 %
Evonik Industries AG^	300.000	2,13 %	07.07.2077	307.311	0,02 %
Commerzbank AG	300.000	1,00 %	05.02.2019	304.535	0,01 %
Volkswagen International Finance NV	300.000	0,88 %	16.01.2023	304.107	0,01 %
Berlin Hyp AG	300.000	0,38 %	03.05.2024	301.907	0,01 %
Linde Finance BV	300.000	1,00 %	20.04.2028	301.556	0,01 %
BASF Finance Europe NV	300.000	0,75 %	10.11.2026	298.596	0,01 %
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	300.000	0,38 %	31.03.2026	295.869	0,01 %
BASF SE	300.000	0,88 %	15.11.2027	295.821	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	250.000	3,25 %	17.01.2028	295.727	0,01 %
Muenchener Hypothekenbank eG	250.000	2,50 %	04.07.2028	291.189	0,01 %
Deutsche Post AG	250.000	2,88 %	11.12.2024	287.210	0,01 %
Bayerische Landesbank	250.000	2,00 %	11.07.2022	271.929	0,01 %
Daimler AG	250.000	2,00 %	07.04.2020	261.072	0,01 %
Hannover Finance Luxembourg SA^	200.000	5,00 %	30.06.2043	240.827	0,01 %
Vier Gas Transport GmbH	200.000	3,13 %	10.07.2023	227.977	0,01 %
Linde AG	200.000	2,00 %	18.04.2023	218.097	0,01 %
Linde Finance BV	200.000	1,88 %	22.05.2024	217.935	0,01 %
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale	200.000	1,13 %	27.05.2021	208.450	0,01 %
Deutsche Hypothekenbank AG	200.000	1,38 %	10.06.2020	207.872	0,01 %
UniCredit Bank AG	200.000	1,25 %	22.04.2020	206.956	0,01 %
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	200.000	0,63 %	05.06.2024	203.880	0,01 %
Volkswagen Financial Services AG	200.000	0,75 %	14.10.2021	203.132	0,01 %
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	200.000	1,13 %	19.02.2019	202.795	0,01 %
BMW US Capital LLC	200.000	1,00 %	20.04.2027	200.109	0,01 %
Bayer Capital Corp. BV	190.000	1,25 %	13.11.2023	199.439	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	150.000	4,25 %	13.07.2022	176.473	0,01 %
Fresenius Finance Ireland plc	147.000	1,50 %	30.01.2024	151.862	0,01 %
Alstria office-AG REIT	100.000	2,13 %	12.04.2023	107.069	0,01 %
Bertelsmann SE & Co. KGaA^	100.000	3,00 %	23.04.2075	105.483	0,01 %
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	100.000	0,88 %	21.07.2021	103.380	0,01 %
Aareal Bank AG^	90.000	4,25 %	18.03.2026	99.070	0,01 %
				216.204.536	10,42 %
Hongkong 0,17 % (2016: 0,23 %)					
Hutchison Whampoa Finance 14 Ltd.	900.000	1,38 %	31.10.2021	932.031	0,05 %
CK Hutchison Finance 16 Ltd.	900.000	1,25 %	06.04.2023	920.587	0,04 %
CK Hutchison Finance 16 Ltd.	600.000	2,00 %	06.04.2028	623.219	0,03 %
Hutchison Whampoa Europe Finance 12 Ltd.	500.000	3,63 %	06.06.2022	566.750	0,03 %
Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd.	300.000	1,00 %	12.12.2024	296.628	0,01 %
CK Hutchison Finance 16 II Ltd.	200.000	0,88 %	03.10.2024	197.877	0,01 %
				3.537.092	0,17 %
Ungarn 0,17 % (2016: 0,09 %)					
Hungary Government International Bond	1.800.000	6,00 %	11.01.2019	1.913.321	0,09 %
Hungary Government International Bond	1.000.000	1,75 %	10.10.2027	1.035.000	0,05 %
Hungary Government International Bond	500.000	3,88 %	24.02.2020	542.500	0,03 %
				3.490.821	0,17 %
Indien 0,02 % (2016: 0,08 %)					
ONGC Videsh Ltd.	400.000	2,75 %	15.07.2021	426.489	0,02 %
				426.489	0,02 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Indonesien 0,17 % (2016: 0,15 %)					
Indonesia Government International Bond	1.900.000	3,75 %	14.06.2028	2.189.750	0,10 %
Indonesia Government International Bond	700.000	2,88 %	08.07.2021	761.138	0,04 %
Indonesia Government International Bond	600.000	3,38 %	30.07.2025	677.250	0,03 %
				3.628.138	0,17 %
Irland 0,48 % (2016: 0,47 %)					
AIB Mortgage Bank	1.000.000	0,88 %	04.02.2023	1.033.456	0,05 %
Bank of Ireland	700.000	1,25 %	09.04.2020	717.853	0,03 %
Bank of Ireland Mortgage Bank	700.000	0,50 %	20.01.2020	710.846	0,03 %
CRH Finance DAC	600.000	3,13 %	03.04.2023	676.315	0,03 %
Ryanair DAC	625.000	1,88 %	17.06.2021	657.306	0,03 %
Bank of Ireland Mortgage Bank	600.000	1,75 %	19.03.2019	615.178	0,03 %
Bank of Ireland Mortgage Bank	500.000	3,63 %	02.10.2020	551.698	0,03 %
Kerry Group Financial Services	500.000	2,38 %	10.09.2025	549.222	0,03 %
CRH Finland Services OYJ	512.000	2,75 %	15.10.2020	545.638	0,03 %
Bank of Ireland Mortgage Bank	500.000	0,63 %	19.02.2021	510.957	0,03 %
AIB Mortgage Bank	500.000	0,63 %	27.07.2020	510.456	0,02 %
Ryanair DAC	500.000	1,13 %	10.03.2023	507.167	0,02 %
Johnson Controls International plc	410.000	1,38 %	25.02.2025	418.029	0,02 %
Ryanair DAC	400.000	1,13 %	15.08.2023	404.822	0,02 %
AIB Mortgage Bank	300.000	2,25 %	26.03.2021	322.478	0,02 %
Bank of Ireland Mortgage Bank	300.000	0,38 %	07.05.2022	303.361	0,02 %
Roadster Finance Designated Activity Co.	300.000	2,38 %	08.12.2027	297.529	0,01 %
CRH Finance DAC	300.000	1,38 %	18.10.2028	294.551	0,01 %
CRH Funding BV	200.000	1,88 %	09.01.2024	211.968	0,01 %
CRH Finance BV	200.000	5,00 %	25.01.2019	210.579	0,01 %
				10.049.409	0,48 %
Israel 0,31 % (2016: 0,30 %)					
Teva Pharmaceutical Finance IV BV	1.500.000	2,88 %	15.04.2019	1.518.750	0,07 %
Israel Government International Bond	1.000.000	4,63 %	18.03.2020	1.103.058	0,05 %
Israel Government International Bond	890.000	1,50 %	18.01.2027	916.700	0,04 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	800.000	1,25 %	31.03.2023	728.292	0,04 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	700.000	1,13 %	15.10.2024	605.206	0,03 %
Israel Government International Bond	500.000	2,88 %	29.01.2024	567.500	0,03 %
Israel Government International Bond	500.000	2,38 %	18.01.2037	528.510	0,03 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	333.000	1,63 %	15.10.2028	275.218	0,01 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	300.000	1,88 %	31.03.2027	259.182	0,01 %
				6.502.416	0,31 %
Italien 4,51 % (2016: 4,23 %)					
Enel Finance International NV	3.517.000	1,38 %	01.06.2026	3.589.183	0,17 %
Snam SpA	3.000.000	0,00 %	25.10.2020	2.993.916	0,14 %
Enel Finance International NV	1.867.000	1,97 %	27.01.2025	2.003.396	0,10 %
Unione di Banche Italiane SpA	1.800.000	3,13 %	14.10.2020	1.959.073	0,09 %
Unione di Banche Italiane SpA	1.700.000	1,13 %	04.10.2027	1.717.435	0,08 %
Intesa Sanpaolo SpA	1.600.000	1,13 %	04.03.2022	1.634.698	0,08 %
Intesa Sanpaolo SpA	1.500.000	1,38 %	18.12.2025	1.575.174	0,08 %
Intesa Sanpaolo SpA	1.300.000	3,25 %	10.02.2026	1.553.197	0,08 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	1.500.000	1,38 %	26.07.2027	1.504.515	0,07 %
Mediobanca SpA	1.500.000	1,25 %	24.11.2029	1.490.421	0,07 %
Assicurazioni Generali SpA	1.100.000	5,13 %	16.09.2024	1.407.526	0,07 %
UniCredit SpA	1.300.000	1,88 %	31.01.2019	1.329.901	0,06 %
Italgas SpA	1.200.000	1,13 %	14.03.2024	1.222.235	0,06 %
Enel Finance International NV	1.000.000	5,00 %	14.09.2022	1.220.240	0,06 %
Unione di Banche Italiane SpA	1.000.000	3,13 %	05.02.2024	1.159.562	0,06 %
UniCredit SpA	900.000	5,25 %	30.04.2023	1.133.038	0,05 %
UniCredit SpA	1.000.000	3,25 %	14.01.2021	1.090.000	0,05 %
Intesa Sanpaolo SpA	1.000.000	2,00 %	18.06.2021	1.055.895	0,05 %
Intesa Sanpaolo SpA	900.000	3,63 %	05.12.2022	1.048.495	0,05 %
Credit Agricole Cariparma SpA	1.000.000	1,63 %	21.03.2029	1.046.787	0,05 %
Banco di Desio e della Brianza SpA	1.000.000	0,88 %	12.09.2024	1.020.860	0,05 %
Intesa Sanpaolo SpA	1.000.000	0,63 %	20.01.2022	1.020.100	0,05 %
ENI SpA	950.000	4,13 %	16.09.2019	1.017.598	0,05 %
2i Rete Gas SpA	1.000.000	1,61 %	31.10.2027	998.691	0,05 %
Unione di Banche Italiane SpA	1.000.000	0,75 %	17.10.2022	995.737	0,05 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Credit Agricole Cariparma SpA	1.000.000	0,63 %	13.01.2026	979.216	0,05 %
Assicurazioni Generali SpA^	800.000	5,50 %	27.10.2047	959.211	0,05 %
ENI SpA	800.000	3,63 %	29.01.2029	956.870	0,05 %
UniCredit SpA	900.000	2,75 %	31.01.2020	954.952	0,05 %
Assicurazioni Generali SpA	900.000	2,88 %	14.01.2020	951.980	0,05 %
Autostrade per l'Italia SpA	900.000	1,75 %	01.02.2027	931.720	0,05 %
FCA Bank SpA	900.000	2,63 %	17.04.2019	930.341	0,05 %
Unione di Banche Italiane SpA	900.000	1,00 %	27.01.2023	926.662	0,04 %
Snam SpA	900.000	1,25 %	25.01.2025	919.400	0,04 %
Mediobanca SpA	900.000	1,13 %	17.06.2019	917.346	0,04 %
Assicurazioni Generali SpA^	700.000	7,75 %	12.12.2042	902.125	0,04 %
Iren SpA	900.000	0,88 %	04.11.2024	885.931	0,04 %
UniCredit SpA	800.000	2,00 %	04.03.2023	848.603	0,04 %
Enel SpA	600.000	5,63 %	21.06.2027	828.317	0,04 %
Banca Popolare di Milano Scarl	800.000	1,50 %	02.12.2025	827.060	0,04 %
ENI SpA	800.000	1,50 %	02.02.2026	819.598	0,04 %
UniCredit SpA	800.000	1,50 %	19.06.2019	817.483	0,04 %
FCA Bank SpA	800.000	1,00 %	15.11.2021	816.905	0,04 %
Intesa Sanpaolo SpA	800.000	1,13 %	14.01.2020	816.637	0,04 %
Unione di Banche Italiane SpA	700.000	5,25 %	28.01.2021	813.045	0,04 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	700.000	4,75 %	15.03.2021	802.634	0,04 %
Autostrade per l'Italia SpA	700.000	2,88 %	26.02.2021	759.401	0,04 %
Intesa Sanpaolo SpA	700.000	4,38 %	15.10.2019	754.579	0,04 %
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	700.000	2,13 %	26.11.2025	749.176	0,04 %
Autostrade per l'Italia SpA	700.000	4,50 %	08.02.2019	735.080	0,04 %
UniCredit SpA	700.000	3,63 %	24.01.2019	726.828	0,04 %
Mediobanca SpA	700.000	1,38 %	10.11.2025	725.212	0,04 %
ENI SpA	600.000	3,75 %	12.09.2025	718.970	0,03 %
ENI SpA	660.000	4,25 %	03.02.2020	717.871	0,03 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	700.000	0,88 %	02.02.2022	716.479	0,03 %
ENI SpA	700.000	1,50 %	17.01.2027	708.684	0,03 %
Intesa Sanpaolo SpA	600.000	4,00 %	30.10.2023	707.694	0,03 %
ENI SpA	700.000	1,63 %	17.05.2028	707.577	0,03 %
UniCredit SpA	700.000	0,75 %	30.04.2025	703.442	0,03 %
Assicurazioni Generali SpA	600.000	4,13 %	04.05.2026	697.337	0,03 %
Assicurazioni Generali SpA^	600.000	5,00 %	08.06.2048	692.034	0,03 %
UniCredit SpA	600.000	3,00 %	31.01.2024	691.477	0,03 %
Assicurazioni Generali SpA^	500.000	10,13 %	10.07.2042	690.059	0,03 %
Eni SpA	600.000	3,25 %	10.07.2023	686.994	0,03 %
Aeroporti di Roma SpA	600.000	3,25 %	20.02.2021	657.220	0,03 %
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	600.000	2,88 %	16.04.2021	650.186	0,03 %
Intesa Sanpaolo SpA	600.000	3,75 %	25.09.2019	641.188	0,03 %
ENI SpA	600.000	1,75 %	18.01.2024	635.936	0,03 %
Mediobanca SpA	600.000	2,25 %	18.03.2019	615.781	0,03 %
ENI SpA	600.000	0,75 %	17.05.2022	612.029	0,03 %
Banca Popolare di Milano Scarl	600.000	0,88 %	14.09.2022	608.928	0,03 %
Mediobanca SpA	600.000	0,75 %	17.02.2020	607.597	0,03 %
Intesa Sanpaolo SpA	600.000	0,88 %	27.06.2022	606.902	0,03 %
Banca Popolare di Sondrio SCPA	600.000	0,75 %	04.04.2023	603.492	0,03 %
Mediobanca SpA	600.000	0,63 %	27.09.2022	594.607	0,03 %
UniCredit SpA	500.000	5,00 %	31.10.2021	593.933	0,03 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	450.000	4,90 %	28.10.2024	578.950	0,03 %
Intesa Sanpaolo SpA	500.000	5,00 %	27.01.2021	577.050	0,03 %
ENI SpA	500.000	4,00 %	29.06.2020	548.770	0,03 %
UniCredit SpA	500.000	4,38 %	29.01.2020	544.722	0,03 %
EXOR NV	500.000	2,13 %	02.12.2022	533.122	0,03 %
ENI SpA	500.000	3,75 %	27.06.2019	527.707	0,03 %
Autostrade per l'Italia SpA	500.000	1,88 %	04.11.2025	527.066	0,03 %
FCA Bank SpA	500.000	2,00 %	23.10.2019	517.087	0,03 %
Autostrade per l'Italia SpA	500.000	1,13 %	04.11.2021	516.714	0,03 %
Unione di Banche Italiane SpA	500.000	2,88 %	18.02.2019	515.822	0,03 %
Credit Agricole Cariparma SpA	500.000	0,88 %	31.01.2022	512.487	0,02 %
Credito Emiliano SpA	500.000	1,88 %	27.02.2019	512.398	0,02 %
Credit Agricole Cariparma SpA	500.000	0,88 %	16.06.2023	511.058	0,02 %
BPER Banca	500.000	0,88 %	22.01.2022	510.609	0,02 %
Autostrade per l'Italia SpA	500.000	1,88 %	26.09.2029	510.345	0,02 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
FCA Bank SpA	500.000	0,25 %	12.10.2020	500.070	0,02 %
Intesa Sanpaolo SpA	450.000	4,13 %	14.04.2020	490.748	0,02 %
Luxottica Group SpA	400.000	2,63 %	10.02.2024	447.893	0,02 %
Intesa Sanpaolo SpA	400.000	3,50 %	17.01.2022	447.294	0,02 %
Autostrade per l'Italia SpA	350.000	4,38 %	16.09.2025	435.008	0,02 %
UniCredit SpA	400.000	2,63 %	31.10.2020	430.216	0,02 %
UniCredit SpA	400.000	2,13 %	24.10.2026	422.084	0,02 %
Luxottica Group SpA	400.000	3,63 %	19.03.2019	417.672	0,02 %
Intesa Sanpaolo SpA	400.000	3,00 %	28.01.2019	413.108	0,02 %
FCA Bank SpA	400.000	1,25 %	23.09.2020	411.309	0,02 %
Credito Emiliano SpA	400.000	0,88 %	05.11.2021	409.148	0,02 %
Esselunga SpA	400.000	1,88 %	25.10.2027	407.180	0,02 %
Intesa Sanpaolo SpA	400.000	0,63 %	23.03.2023	406.490	0,02 %
Societa Iniziative Autostradali e Servizi SpA	350.000	4,50 %	26.10.2020	393.187	0,02 %
Credit Agricole Cariparma SpA	400.000	0,25 %	30.09.2024	389.096	0,02 %
Zi Rete Gas SpA	300.000	3,00 %	16.07.2024	341.388	0,02 %
Credito Emiliano SpA	300.000	3,25 %	09.07.2020	324.812	0,02 %
Unione di Banche Italiane SpA	300.000	4,00 %	16.12.2019	324.573	0,02 %
Autostrade per l'Italia SpA	300.000	1,75 %	26.06.2026	310.523	0,02 %
Aeroporti di Roma SpA	300.000	1,63 %	08.06.2027	306.121	0,01 %
BPER Banca	300.000	0,50 %	22.07.2020	303.884	0,01 %
Esselunga SpA	300.000	0,88 %	25.10.2023	300.426	0,01 %
ENI SpA	300.000	1,13 %	19.09.2028	286.258	0,01 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	250.000	4,88 %	03.10.2019	271.602	0,01 %
UniCredit SpA	200.000	4,38 %	31.01.2022	234.470	0,01 %
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	160.000	2,88 %	16.07.2024	179.509	0,01 %
Enel SpA	100.000	5,25 %	20.05.2024	128.285	0,01 %
Atlantia SpA	100.000	1,88 %	13.07.2027	101.921	0,01 %
				93.488.584	4,51 %
Japan 0,61 % (2016: 0,49 %)					
Toyota Motor Credit Corp.	1.150.000	1,80 %	23.07.2020	1.201.230	0,06 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	1.000.000	2,25 %	16.12.2020	1.062.909	0,05 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	800.000	1,55 %	15.06.2026	823.152	0,04 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	740.000	0,93 %	11.10.2024	738.775	0,04 %
Toyota Motor Credit Corp.	700.000	1,00 %	10.09.2021	720.538	0,03 %
Mizuho Financial Group Inc	700.000	0,96 %	16.10.2024	699.475	0,03 %
Development Bank of Japan, Inc.	500.000	4,75 %	26.11.2027	666.735	0,03 %
Asahi Group Holdings Ltd	657.000	0,32 %	19.09.2021	655.840	0,03 %
Nomura Europe Finance NV	600.000	1,13 %	03.06.2020	613.825	0,03 %
Toyota Motor Credit Corp.	600.000	0,75 %	21.07.2022	612.070	0,03 %
Toyota Motor Credit Corp.	550.000	2,38 %	01.02.2023	603.888	0,03 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	500.000	2,75 %	24.07.2023	557.481	0,03 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	500.000	4,00 %	09.11.2020	551.847	0,03 %
American Honda Finance Corp.	500.000	1,88 %	04.09.2019	516.723	0,03 %
Japan Finance Organization for Municipalities	500.000	0,88 %	22.09.2021	508.471	0,02 %
Asahi Group Holdings Ltd.	488.000	1,15 %	19.09.2025	488.400	0,02 %
American Honda Finance Corp.	400.000	1,38 %	10.11.2022	417.816	0,02 %
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.	400.000	0,88 %	11.03.2022	407.534	0,02 %
American Honda Finance Corp.	400.000	0,75 %	17.01.2024	400.314	0,02 %
Development Bank of Japan, Inc.	300.000	0,38 %	21.10.2019	301.125	0,01 %
Nomura Europe Finance NV	200.000	1,50 %	12.05.2021	207.643	0,01 %
				12.755.791	0,61 %
Jersey 0,01 % (2016: 0,01 %)					
Atrium European Real Estate Ltd.	200.000	3,63 %	17.10.2022	221.300	0,01 %
				221.300	0,01 %
Luxemburg 0,13 % (2016: 0,15 %)					
Aroundtown SA	1.000.000	1,00 %	07.01.2025	973.036	0,05 %
NORD/LB Luxembourg SA Covered Bond Bank	600.000	0,38 %	15.06.2023	596.788	0,03 %
NORD/LB Luxembourg SA Covered Bond Bank	500.000	0,25 %	10.03.2020	503.714	0,02 %
SES SA	400.000	4,75 %	11.03.2021	457.012	0,02 %
SES SA	200.000	4,63 %	09.03.2020	219.610	0,01 %
				2.750.160	0,13 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Mexiko 1,03 % (2016: 0,89 %)					
Mexico Government International Bond	1.700.000	1,63 %	06.03.2024	1.773.270	0,08 %
Petroleos Mexicanos	1.500.000	3,75 %	21.02.2024	1.626.018	0,08 %
Mexico Government International Bond	1.200.000	3,38 %	23.02.2031	1.360.620	0,07 %
Petroleos Mexicanos	1.200.000	2,50 %	21.08.2021	1.259.288	0,06 %
Petroleos Mexicanos	1.000.000	3,13 %	27.11.2020	1.072.470	0,05 %
Petroleos Mexicanos	1.000.000	3,75 %	15.03.2019	1.041.288	0,05 %
Mexico Government International Bond	933.000	2,38 %	09.04.2021	996.926	0,05 %
Mexico Government International Bond	900.000	2,75 %	22.04.2023	991.467	0,05 %
Petroleos Mexicanos	1.000.000	2,75 %	21.04.2027	958.760	0,05 %
America Movil SAB de CV	790.000	4,13 %	25.10.2019	848.549	0,04 %
Mexico Government International Bond	800.000	4,00 %	15.03.2115	767.600	0,04 %
Petroleos Mexicanos	650.000	5,50 %	24.02.2025	767.052	0,04 %
Mexico Government International Bond	730.000	1,38 %	15.01.2025	740.050	0,04 %
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	700.000	1,75 %	20.03.2023	731.822	0,03 %
Petroleos Mexicanos	700.000	1,88 %	21.04.2022	718.760	0,03 %
Mexico Government International Bond	600.000	3,63 %	09.04.2029	706.808	0,03 %
Mexico Government International Bond	700.000	3,00 %	06.03.2045	679.875	0,03 %
America Movil SAB de CV	600.000	3,00 %	12.07.2021	655.582	0,03 %
Petroleos Mexicanos	500.000	5,13 %	15.03.2023	581.825	0,03 %
America Movil SAB de CV	500.000	3,26 %	22.07.2023	565.765	0,03 %
America Movil SAB de CV	400.000	4,75 %	28.06.2022	475.697	0,02 %
America Movil SAB de CV	400.000	2,13 %	10.03.2028	422.004	0,02 %
America Movil SAB de CV	400.000	1,50 %	10.03.2024	413.464	0,02 %
America Movil SAB de CV^	300.000	6,38 %	06.09.2073	367.200	0,02 %
Petroleos Mexicanos	300.000	4,88 %	21.02.2028	332.893	0,02 %
Mexico Government International Bond	200.000	5,50 %	17.02.2020	222.900	0,01 %
Petroleos Mexicanos	200.000	3,75 %	16.04.2026	208.722	0,01 %
				21.286.675	1,03 %
Marokko 0,07 % (2016: 0,07 %)					
Internationale Staatsanleihe von Marokko	700.000	4,50 %	05.10.2020	777.384	0,04 %
Internationale Staatsanleihe von Marokko	600.000	3,50 %	19.06.2024	670.524	0,03 %
				1.447.908	0,07 %
Niederlande 4,59 % (2016: 4,77 %)					
ABN AMRO Bank NV	2.000.000	3,50 %	18.01.2022	2.282.748	0,11 %
Cooperatieve Rabobank UA	1.950.000	4,13 %	14.01.2020	2.115.485	0,10 %
Shell International Finance BV	1.950.000	1,63 %	24.03.2021	2.049.598	0,10 %
ING Bank NV	1.800.000	4,75 %	27.05.2019	1.929.942	0,09 %
ING Groep NV	1.900.000	0,75 %	09.03.2022	1.925.177	0,09 %
ING Bank NV	1.800.000	2,00 %	28.08.2020	1.906.929	0,09 %
Cooperatieve Rabobank UA	1.650.000	1,25 %	23.03.2026	1.700.127	0,08 %
Cooperatieve Rabobank UA	1.400.000	4,75 %	06.06.2022	1.677.180	0,08 %
ING Bank NV	1.600.000	0,75 %	24.11.2020	1.631.387	0,08 %
Cooperatieve Rabobank UA	1.300.000	4,13 %	14.07.2025	1.619.229	0,08 %
ABN AMRO Bank NV	1.400.000	2,38 %	23.01.2024	1.575.757	0,08 %
NIBC Bank NV	1.500.000	1,50 %	31.01.2022	1.542.840	0,07 %
Cooperatieve Rabobank UA	1.500.000	1,75 %	22.01.2019	1.531.122	0,07 %
Cooperatieve Rabobank UA^	1.400.000	2,50 %	26.05.2026	1.481.771	0,07 %
Cooperatieve Rabobank UA	1.250.000	4,00 %	11.01.2022	1.440.427	0,07 %
ABN AMRO Bank NV	1.400.000	1,13 %	12.01.2032	1.391.579	0,07 %
ABN AMRO Bank NV	1.300.000	1,00 %	13.04.2031	1.280.032	0,06 %
ABN AMRO Bank NV	1.200.000	1,50 %	30.09.2030	1.262.004	0,06 %
Cooperatieve Rabobank UA	1.200.000	1,38 %	03.02.2027	1.241.244	0,06 %
ABN AMRO Bank NV	1.050.000	3,50 %	21.09.2022	1.217.870	0,06 %
Aegon Bank NV	1.200.000	0,38 %	21.11.2024	1.190.770	0,06 %
ABN AMRO Bank NV	1.000.000	4,13 %	28.03.2022	1.160.599	0,06 %
Shell International Finance BV	1.100.000	1,25 %	15.03.2022	1.150.497	0,06 %
ABN AMRO Bank NV	1.000.000	2,50 %	05.09.2023	1.128.078	0,05 %
Cooperatieve Rabobank UA	1.000.000	4,13 %	12.01.2021	1.122.120	0,05 %
ABN AMRO Bank NV	1.000.000	2,50 %	29.11.2023	1.116.193	0,05 %
ING Groep NV^	1.000.000	2,50 %	15.02.2029	1.062.976	0,05 %
ING Bank NV	900.000	4,50 %	21.02.2022	1.054.997	0,05 %
Cooperatieve Rabobank UA	900.000	3,88 %	25.07.2023	1.047.674	0,05 %
Heineken NV	1.000.000	1,25 %	10.09.2021	1.036.526	0,05 %
NN Group NV	1.000.000	1,63 %	01.06.2027	1.023.572	0,05 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
ING Bank NV	900.000	3,63 %	31.08.2021	1.021.723	0,05 %
ABN AMRO Bank NV	1.000.000	0,63 %	31.05.2022	1.015.382	0,05 %
Shell International Finance BV	1.000.000	0,75 %	12.05.2024	1.012.851	0,05 %
Nationale-Nederlanden Bank NV	1.000.000	0,50 %	10.10.2024	1.001.304	0,05 %
PostNL NV	1.000.000	1,00 %	21.11.2024	999.606	0,05 %
NIBC Bank NV	960.000	0,25 %	22.04.2022	964.681	0,05 %
Koninklijke KPN NV	800.000	4,25 %	01.03.2022	926.397	0,04 %
Cooperatieve Rabobank UA	900.000	1,25 %	31.05.2032	908.139	0,04 %
LeasePlan Corp.NV	889.000	0,75 %	03.10.2022	889.645	0,04 %
ASML Holding NV	850.000	1,63 %	28.05.2027	880.056	0,04 %
ING Bank NV	800.000	1,88 %	22.05.2023	872.202	0,04 %
Cooperatieve Rabobank UA	750.000	4,38 %	07.06.2021	859.675	0,04 %
ABN AMRO Bank NV^	800.000	2,88 %	30.06.2025	846.714	0,04 %
ABN AMRO Bank NV	700.000	6,38 %	27.04.2021	833.447	0,04 %
ING Bank NV	750.000	4,00 %	17.01.2020	816.412	0,04 %
ING Bank NV	800.000	0,70 %	16.04.2020	813.062	0,04 %
Koninklijke KPN NV	750.000	7,50 %	04.02.2019	811.485	0,04 %
ABN AMRO Bank NV	800.000	1,38 %	12.01.2037	802.672	0,04 %
Stedin Holding NV	800.000	0,88 %	24.10.2025	801.206	0,04 %
ABN AMRO Bank NV	700.000	4,25 %	06.04.2021	799.991	0,04 %
Shell International Finance BV	800.000	0,75 %	15.08.2028	772.129	0,04 %
Cooperatieve Rabobank UA	700.000	3,75 %	09.11.2020	769.507	0,04 %
ABN AMRO Bank NV	600.000	7,13 %	06.07.2022	766.640	0,04 %
Cooperatieve Rabobank UA	700.000	5,88 %	20.05.2019	756.288	0,04 %
JAB Holdings BV	700.000	1,75 %	25.05.2023	735.708	0,04 %
Unilever NV	700.000	1,38 %	31.07.2029	713.919	0,03 %
Aegon NV	700.000	1,00 %	08.12.2023	711.865	0,03 %
Heineken NV	700.000	1,50 %	03.10.2029	701.182	0,03 %
Koninklijke KPN NV	700.000	0,63 %	09.04.2025	681.995	0,03 %
Cooperatieve Rabobank UA	600.000	2,38 %	22.05.2023	661.962	0,03 %
Cooperatieve Rabobank UA	600.000	3,75 %	09.11.2020	659.578	0,03 %
ABN AMRO Bank NV^	600.000	2,88 %	18.01.2028	652.890	0,03 %
Shell International Finance BV	600.000	1,88 %	15.09.2025	652.279	0,03 %
ABN AMRO Bank NV	600.000	0,88 %	14.01.2026	617.268	0,03 %
Heineken NV	600.000	1,38 %	29.01.2027	614.506	0,03 %
Akzo Nobel NV	600.000	1,13 %	08.04.2026	601.458	0,03 %
ING Groep NV^	600.000	1,63 %	26.09.2029	601.322	0,03 %
ASML Holding NV	500.000	3,38 %	19.09.2023	579.381	0,03 %
Wolters Kluwer NV	500.000	2,50 %	13.05.2024	549.540	0,03 %
Akzo Nobel Sweden Finance AB	500.000	2,63 %	27.07.2022	549.075	0,03 %
Stedin Holding NV^	500.000	3,25 %	01.12.2166	538.750	0,03 %
Achmea BV	500.000	2,50 %	19.11.2020	532.914	0,03 %
Shell International Finance BV	500.000	1,63 %	20.01.2027	530.054	0,03 %
Heineken NV	500.000	2,13 %	04.08.2020	526.320	0,03 %
ABN AMRO Bank NV	500.000	4,75 %	11.01.2019	525.291	0,03 %
LeasePlan Corp.NV	500.000	2,38 %	23.04.2019	515.270	0,02 %
ING-DiBa AG	500.000	2,00 %	13.03.2019	514.275	0,02 %
NIBC Bank NV	500.000	1,25 %	08.04.2019	509.985	0,02 %
NN Group NV	500.000	0,88 %	13.01.2023	508.399	0,02 %
Aegon Bank NV	500.000	0,25 %	01.12.2020	505.702	0,02 %
F van Lanschot Bankiers NV	500.000	0,28 %	28.04.2022	502.790	0,02 %
Koninklijke DSM NV	500.000	0,75 %	28.09.2026	491.786	0,02 %
ING Bank NV	454.000	1,25 %	13.12.2019	466.123	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	400.000	4,13 %	14.09.2022	464.286	0,02 %
ING Bank NV	400.000	4,88 %	18.01.2021	457.628	0,02 %
Shell International Finance BV	400.000	2,50 %	24.03.2026	453.685	0,02 %
NN Group NV^	400.000	4,50 %	15.07.2166	450.728	0,02 %
Aegon NV^	400.000	4,00 %	25.04.2044	449.159	0,02 %
Wolters Kluwer NV	400.000	2,88 %	21.03.2023	446.776	0,02 %
ING Bank NV^	400.000	3,63 %	25.02.2026	437.079	0,02 %
Achmea BV^	400.000	4,25 %	04.02.2166	435.311	0,02 %
Heineken NV	400.000	2,00 %	06.04.2021	423.952	0,02 %
Heineken NV	400.000	1,50 %	07.12.2024	418.523	0,02 %
ABN AMRO Bank NV	400.000	1,88 %	31.07.2019	414.284	0,02 %
Heineken NV	400.000	2,50 %	19.03.2019	412.140	0,02 %
Shell International Finance BV	400.000	1,25 %	12.05.2028	408.536	0,02 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
ING Bank NV	400.000	0,75 %	22.02.2021	407.980	0,02 %
LeasePlan Corp.NV	400.000	1,00 %	08.04.2020	407.735	0,02 %
Schlumberger Finance BV	400.000	1,50 %	04.03.2019	407.307	0,02 %
F van Lanschot Bankiers NV	400.000	0,38 %	31.03.2023	402.120	0,02 %
ASR Nederland NV^	300.000	5,13 %	29.09.2045	364.140	0,02 %
Achmea BV^	300.000	6,00 %	04.04.2043	355.499	0,02 %
NN Group NV^	300.000	4,63 %	08.04.2044	347.659	0,02 %
Robert Bosch Investment Nederland BV	300.000	2,63 %	24.05.2028	345.287	0,02 %
Delta Lloyd Levensverzekering NV^	250.000	9,00 %	29.08.2042	339.375	0,02 %
Koninklijke DSM NV	300.000	2,38 %	03.04.2024	331.816	0,02 %
ING Groep NV^	300.000	3,00 %	11.04.2028	328.264	0,02 %
JAB Holdings BV	300.000	2,13 %	16.09.2022	321.680	0,02 %
Akzo Nobel NV	300.000	1,75 %	07.11.2024	316.692	0,02 %
Unilever NV	300.000	1,13 %	29.04.2028	303.128	0,01 %
ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG^	233.000	3,38 %	29.09.2047	249.347	0,01 %
ABN AMRO Bank NV	200.000	3,63 %	22.06.2020	219.193	0,01 %
Achmea Bank NV	200.000	2,75 %	18.02.2021	215.312	0,01 %
Robert Bosch Investment Nederland BV	200.000	1,63 %	24.05.2021	210.151	0,01 %
JAB Holdings BV	200.000	1,63 %	30.04.2025	207.104	0,01 %
Koninklijke DSM NV	200.000	1,00 %	09.04.2025	203.349	0,01 %
F van Lanschot Bankiers NV	200.000	0,88 %	15.02.2027	200.285	0,01 %
NIBC Bank NV	200.000	0,63 %	01.06.2026	198.127	0,01 %
Shell International Finance BV	100.000	1,00 %	06.04.2022	103.557	0,01 %
				95.246.445	4,59 %
Neuseeland 0,34 % (2016: 0,30 %)					
ASB Finance Ltd.	1.000.000	0,50 %	17.06.2020	1.009.369	0,05 %
Westpac Securities NZ Ltd.	1.000.000	0,13 %	16.06.2021	1.001.888	0,05 %
Westpac Securities NZ Ltd.	800.000	0,88 %	24.06.2019	813.711	0,04 %
ASB Finance Ltd.	700.000	0,63 %	18.10.2024	701.489	0,03 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	600.000	0,63 %	27.01.2022	611.106	0,03 %
BNZ International Funding Ltd.	600.000	0,50 %	03.07.2024	598.322	0,03 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	500.000	0,13 %	22.09.2023	491.475	0,02 %
BNZ International Funding Ltd.	450.000	0,50 %	13.05.2023	446.130	0,02 %
Westpac Securities NZ Ltd.	400.000	0,25 %	06.04.2022	400.885	0,02 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	300.000	0,63 %	01.06.2021	304.183	0,02 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	300.000	0,40 %	01.03.2022	300.118	0,02 %
Fonterra Co-operative Group Ltd.	280.000	0,75 %	08.11.2024	274.655	0,01 %
				6.953.331	0,34 %
Norwegen 1,95 % (2016: 2,21 %)					
DNB Boligkreditt A.S.	2.850.000	3,88 %	16.06.2021	3.234.904	0,16 %
DNB Boligkreditt A.S.	2.100.000	2,75 %	21.03.2022	2.335.271	0,11 %
DNB Bank A.S.A	1.600.000	4,38 %	24.02.2021	1.814.608	0,09 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	1.550.000	2,75 %	01.02.2019	1.602.240	0,08 %
Statoil A.S.A	1.500.000	0,88 %	17.02.2023	1.533.207	0,07 %
SpareBank 1 SMN	1.500.000	0,50 %	09.03.2022	1.501.095	0,07 %
DNB Boligkreditt A.S.	1.400.000	0,38 %	07.10.2019	1.417.049	0,07 %
Kommunalbanken A.S.	1.400.000	0,63 %	20.04.2026	1.395.848	0,07 %
DNB Boligkreditt A.S.	1.300.000	0,38 %	14.01.2021	1.318.694	0,06 %
Eika Boligkreditt A.S.	1.100.000	2,13 %	30.01.2023	1.203.789	0,06 %
SpareBank 1 SR-Bank A.S.A	1.095.000	0,38 %	10.02.2022	1.090.029	0,05 %
SR-Boligkreditt A.S.	1.000.000	0,75 %	18.01.2023	1.024.462	0,05 %
DNB Boligkreditt A.S.	1.000.000	0,25 %	18.04.2023	1.000.420	0,05 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	1.000.000	0,38 %	26.06.2024	997.770	0,05 %
SR-Boligkreditt A.S.	1.000.000	0,38 %	03.10.2024	993.050	0,05 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	1.000.000	0,25 %	30.08.2026	964.130	0,05 %
DNB Bank A.S.A	780.000	4,25 %	18.01.2022	908.106	0,04 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	800.000	0,75 %	05.09.2022	821.707	0,04 %
DNB Boligkreditt A.S.	750.000	1,88 %	18.06.2019	774.445	0,04 %
Eika Boligkreditt A.S.	700.000	0,38 %	20.04.2023	703.738	0,03 %
Statoil A.S.A	700.000	1,63 %	09.11.2036	682.762	0,03 %
Telenor A.S.A	600.000	4,13 %	26.03.2020	654.836	0,03 %
Eika Boligkreditt A.S.	600.000	1,50 %	12.03.2021	629.420	0,03 %
Telenor A.S.A	500.000	2,50 %	22.05.2025	557.960	0,03 %
SpareBank 1 SR-Bank A.S.A.	500.000	2,13 %	14.04.2021	530.301	0,03 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Statoil A.S.A	500.000	2,00 %	10.09.2020	526.570	0,03 %
Statoil A.S.A	446.000	2,88 %	10.09.2025	514.084	0,03 %
Statoil A.S.A	500.000	1,25 %	17.02.2027	508.341	0,02 %
Kommunalbanken A.S.	500.000	0,88 %	08.04.2019	508.069	0,02 %
Santander Consumer Bank A.S.	500.000	0,38 %	17.02.2020	502.762	0,02 %
Sparebanken Vest Boligkreditt A.S.	500.000	0,13 %	02.03.2021	502.696	0,02 %
Sparebanken Vest Boligkreditt A.S.	500.000	0,25 %	29.04.2022	502.392	0,02 %
Telenor A.S.A	450.000	2,75 %	27.06.2022	497.798	0,02 %
Statoil A.S.A	500.000	1,63 %	17.02.2035	496.115	0,02 %
Telenor A.S.A	400.000	2,63 %	06.12.2024	450.628	0,02 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	400.000	4,00 %	03.02.2021	450.397	0,02 %
Statkraft A.S.	400.000	6,63 %	02.04.2019	433.109	0,02 %
DNB Boligkreditt A.S.	400.000	1,88 %	21.11.2022	432.976	0,02 %
Eika Boligkreditt A.S.	400.000	2,00 %	19.06.2019	413.577	0,02 %
SpareBank 1 SMN	400.000	1,50 %	20.05.2019	408.556	0,02 %
DNB Boligkreditt A.S.	400.000	0,38 %	20.10.2020	405.881	0,02 %
Statkraft A.S.	400.000	1,50 %	26.03.2030	400.392	0,02 %
Statoil A.S.A	400.000	0,75 %	09.11.2026	394.710	0,02 %
Statoil A.S.A	300.000	5,63 %	11.03.2021	352.537	0,02 %
DNB Bank A.S.A.	300.000	3,88 %	29.06.2020	328.969	0,02 %
Statkraft A.S.	300.000	1,50 %	21.09.2023	313.983	0,02 %
SpareBank 1 SMN	300.000	0,75 %	08.06.2021	304.571	0,01 %
Sparebanken Soer Boligkreditt A.S.	300.000	0,25 %	22.03.2021	302.490	0,01 %
SpareBank 1 SR-Bank A.S.A	250.000	2,13 %	03.02.2020	260.638	0,01 %
Sparebanken Vest Boligkreditt A.S.	200.000	1,25 %	16.01.2019	203.326	0,01 %
Storebrand Livsforsikring A.S.^	100.000	6,88 %	04.04.2043	123.811	0,01 %
SpareBank 1 SR-Bank A.S.A	100.000	2,13 %	27.02.2019	102.521	0,01 %
Avinor A.S.	100.000	1,00 %	29.04.2025	101.070	0,01 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	50.000	0,38 %	09.03.2023	50.328	0,00 %
				40.483.138	1,95 %
Peru 0,06 % (2016: 0,05 %)					
Peruanischen Regierung International Bond	600.000	2,75 %	30.01.2026	667.980	0,03 %
Peruanischen Regierung International Bond	500.000	3,75 %	01.03.2030	608.750	0,03 %
				1.276.730	0,06 %
Polen 1,08 % (2016: 1,10 %)					
Republic of Poland Government International Bond	3.450.000	4,20 %	15.04.2020	3.783.684	0,18 %
Republic of Poland Government International Bond	1.950.000	5,25 %	20.01.2025	2.554.500	0,12 %
Republic of Poland Government International Bond	1.600.000	3,38 %	09.07.2024	1.884.648	0,09 %
Republic of Poland Government International Bond	1.500.000	3,00 %	15.01.2024	1.727.250	0,08 %
Republic of Poland Government International Bond	1.300.000	4,00 %	23.03.2021	1.468.350	0,07 %
Republic of Poland Government International Bond	1.300.000	0,88 %	14.10.2021	1.342.146	0,07 %
Republic of Poland Government International Bond	1.050.000	3,75 %	19.01.2023	1.234.216	0,06 %
Republic of Poland Government International Bond	1.100.000	0,50 %	20.12.2021	1.119.250	0,05 %
Republic of Poland Government International Bond	1.000.000	2,38 %	18.01.2036	1.080.000	0,05 %
Republic of Poland Government International Bond	1.000.000	1,63 %	15.01.2019	1.018.552	0,05 %
Republic of Poland Government International Bond	900.000	1,00 %	25.10.2028	879.300	0,04 %
Republic of Poland Government International Bond	700.000	1,50 %	19.01.2026	740.075	0,04 %
Republic of Poland Government International Bond	600.000	4,50 %	18.01.2022	708.600	0,03 %
Republic of Poland Government International Bond	500.000	1,38 %	22.10.2027	516.418	0,03 %
Republic of Poland Government International Bond	500.000	0,88 %	10.05.2027	494.390	0,02 %
PZU Finance AB	340.000	1,38 %	03.07.2019	345.984	0,02 %
Energa Finance AB	300.000	3,25 %	19.03.2020	319.845	0,02 %
mFinance France SA	300.000	2,00 %	26.11.2021	317.922	0,02 %
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA Via PKO Finance AB	300.000	2,32 %	23.01.2019	307.134	0,02 %
Republic of Poland Government International Bond	250.000	2,00 %	25.10.2046	254.300	0,01 %
ORLEN Capital AB	200.000	2,50 %	30.06.2021	214.076	0,01 %
				22.310.640	1,08 %
Portugal 0,57 % (2016: 0,41 %)					
EDP Finance BV	1.400.000	2,63 %	18.01.2022	1.526.686	0,07 %
EDP Finance BV	1.100.000	1,13 %	12.02.2024	1.111.482	0,05 %
EDP Finance BV	1.000.000	2,63 %	15.04.2019	1.033.896	0,05 %
Banco Santander Totta SA	800.000	0,88 %	27.10.2020	818.226	0,04 %
EDP Finance BV	700.000	4,13 %	29.06.2020	770.812	0,04 %
Banco Santander Totta SA	700.000	0,88 %	25.04.2024	709.842	0,03 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Banco Comercial Portugues SA	700.000	0,75 %	31.05.2022	708.065	0,03 %
EDP Finance BV	600.000	4,88 %	14.09.2020	676.709	0,03 %
Caixa Geral de Depositos SA	600.000	1,00 %	27.01.2022	611.154	0,03 %
Banco Santander Totta SA	600.000	1,25 %	26.09.2027	607.590	0,03 %
EDP Finance BV	500.000	2,38 %	23.03.2023	543.413	0,03 %
Brisa Concessao Rodoviaria SA	500.000	2,00 %	22.03.2023	531.269	0,03 %
EDP Finance BV	500.000	2,00 %	22.04.2025	528.165	0,03 %
Brisa Concessao Rodoviaria SA	500.000	1,88 %	30.04.2025	519.104	0,03 %
Caixa Geral de Depositos SA	500.000	3,00 %	15.01.2019	516.059	0,02 %
Caixa Economica Montepio Geral	300.000	0,88 %	17.10.2022	301.443	0,01 %
Brisa Concessao Rodoviaria SA	200.000	2,38 %	10.05.2027	212.181	0,01 %
Banco Santander Totta SA	200.000	1,63 %	11.06.2019	205.051	0,01 %
				11.931.147	0,57 %
Rumänien 0,48 % (2016: 0,45 %)					
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	3.500.000	2,38 %	19.04.2027	3.586.005	0,17 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	1.500.000	2,88 %	26.05.2028	1.588.050	0,08 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	1.400.000	4,63 %	18.09.2020	1.575.392	0,08 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	900.000	4,88 %	07.11.2019	983.475	0,05 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	600.000	3,63 %	24.04.2024	692.520	0,03 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	600.000	2,88 %	28.10.2024	663.450	0,03 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	520.000	2,75 %	29.10.2025	564.252	0,03 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	300.000	3,88 %	29.10.2035	329.076	0,01 %
				9.982.220	0,48 %
Saudi-Arabien 0,04 % (2016: 0,03 %)					
SABIC Capital I BV	700.000	2,75 %	20.11.2020	748.664	0,04 %
				748.664	0,04 %
Singapur 0,10 % (2016: 0,02 %)					
DBS Bank Ltd.	800.000	0,38 %	23.01.2024	796.243	0,04 %
United Overseas Bank Ltd.	700.000	0,13 %	02.03.2022	699.290	0,03 %
Temasek Financial I Ltd.	500.000	1,50 %	01.03.2028	524.989	0,03 %
				2.020.522	0,10 %
Slowakei 0,04 % (2016: 0,05 %)					
Granvia A.S.	707.840	4,78 %	30.09.2039	904.846	0,04 %
				904.846	0,04 %
Südkorea 0,08 % (2016: 0,12 %)					
Export-Import Bank von Korea	1.000.000	2,00 %	30.04.2020	1.040.428	0,05 %
Korea International Bond	600.000	2,13 %	10.06.2024	643.692	0,03 %
				1.684.120	0,08 %
Spanien 6,02 % (2016: 6,11 %)					
Gas Natural Capital Markets SA	2.800.000	5,38 %	24.05.2019	3.009.384	0,15 %
Programa Cedula TDA Fondo de Titulizacion de Activos	2.000.000	4,25 %	10.04.2031	2.580.828	0,12 %
Cedula TDA 6 Fondo de Titulizacion de Activos	2.100.000	3,88 %	23.05.2025	2.568.586	0,12 %
Programa Cedula TDA Fondo de Titulizacion de Activos	2.100.000	4,13 %	10.04.2021	2.377.582	0,11 %
Iberdrola International BV	2.000.000	3,50 %	01.02.2021	2.206.400	0,11 %
AyT Cedula Cajas IX FTA	2.000.000	4,00 %	31.03.2020	2.182.022	0,11 %
Banco Santander SA	2.000.000	1,38 %	09.02.2022	2.061.192	0,10 %
CaixaBank SA	1.600.000	3,88 %	17.02.2025	1.954.246	0,09 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	1.500.000	4,00 %	25.02.2025	1.864.041	0,09 %
Bankia SA	1.800.000	1,00 %	14.03.2023	1.855.777	0,09 %
NorteGas Energia Distribucion SAU	1.800.000	0,92 %	28.09.2022	1.809.711	0,09 %
Bankinter SA	1.700.000	1,00 %	05.02.2025	1.727.365	0,08 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	1.600.000	0,63 %	17.05.2021	1.634.451	0,08 %
Banco Popular Espanol SA	1.600.000	1,00 %	07.04.2025	1.629.221	0,08 %
CaixaBank SA	1.500.000	4,63 %	04.06.2019	1.602.459	0,08 %
Gas Natural Fenosa Finance BV	1.500.000	1,38 %	19.01.2027	1.501.780	0,07 %
Bankia SA	1.150.000	4,13 %	24.03.2036	1.482.517	0,07 %
Telefonica Emisiones SAU	1.400.000	2,74 %	29.05.2019	1.454.373	0,07 %
Programa Cedula TDA Fondo de Titulizacion de Activos	1.100.000	4,25 %	28.03.2027	1.394.539	0,07 %
Banco Santander SA	1.300.000	1,50 %	25.01.2026	1.388.201	0,07 %
Banco Santander SA	1.000.000	4,63 %	04.05.2027	1.338.890	0,06 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	1.300.000	0,63 %	18.03.2023	1.324.350	0,06 %
Telefonica Emisiones SAU	1.300.000	1,46 %	13.04.2026	1.319.105	0,06 %
AyT Cedula Cajas Global	1.000.000	4,75 %	25.05.2027	1.311.590	0,06 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Santander Issuances SAU	1.200.000	2,50 %	18.03.2025	1.258.613	0,06 %
Santander International Debt SA	1.200.000	1,38 %	14.12.2022	1.251.430	0,06 %
Telefonica Emisiones SAU	1.150.000	4,69 %	11.11.2019	1.251.131	0,06 %
Bankia SA	1.200.000	1,00 %	25.09.2025	1.216.242	0,06 %
AyT Cedulas Cajas X Fondo de Titulizacion de Activos	1.000.000	3,75 %	30.06.2025	1.215.270	0,06 %
Telefonica Emisiones SAU	1.200.000	0,32 %	17.10.2020	1.206.067	0,06 %
Iberdrola International BV	1.200.000	1,13 %	21.04.2026	1.202.369	0,06 %
Bankia SA	1.000.000	4,50 %	26.04.2022	1.181.228	0,06 %
Telefonica Emisiones SAU	1.000.000	3,99 %	23.01.2023	1.167.630	0,06 %
IM Cedulas 7 Fondo de Titulacion de Activos	1.000.000	4,00 %	31.03.2021	1.127.022	0,05 %
CaixaBank SA	1.100.000	1,25 %	11.01.2027	1.126.762	0,05 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	1.100.000	1,00 %	20.01.2021	1.126.589	0,05 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	1.000.000	3,50 %	10.02.2027	1.124.954	0,05 %
Banco Santander SA	1.000.000	4,00 %	07.04.2020	1.095.758	0,05 %
AyT Cedulas Cajas VIII FTA	1.000.000	4,25 %	18.11.2019	1.082.505	0,05 %
Cedulas TDA 5 Fondo de Titulizacion de Activos	1.000.000	4,13 %	29.11.2019	1.081.571	0,05 %
Prosegur Cash SA	1.100.000	1,38 %	04.02.2026	1.078.381	0,05 %
Kutxabank SA	1.000.000	1,75 %	27.05.2021	1.056.122	0,05 %
CaixaBank SA	950.000	3,63 %	18.01.2021	1.053.716	0,05 %
Banco Santander SA	1.000.000	1,13 %	27.11.2024	1.043.976	0,05 %
Criteria Caixa SAU	1.000.000	1,63 %	21.04.2022	1.026.207	0,05 %
Enagas Financiaciones SAU	1.000.000	1,25 %	06.02.2025	1.026.200	0,05 %
Ayt Cedulas Cajas Global	900.000	4,00 %	24.03.2021	1.013.085	0,05 %
Santander Consumer Finance SA	1.000.000	0,75 %	03.04.2019	1.009.353	0,05 %
Iberdrola Finanzas SA	1.000.000	1,00 %	07.03.2025	1.004.644	0,05 %
Caja Rural de Navarra SCC	1.000.000	0,63 %	01.12.2023	999.682	0,05 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	900.000	3,50 %	24.01.2021	998.335	0,05 %
CaixaBank SA	1.000.000	0,63 %	27.03.2025	991.420	0,05 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	900.000	3,50 %	07.10.2020	990.225	0,05 %
Telefonica Emisiones SAU	900.000	4,71 %	20.01.2020	986.038	0,05 %
Santander Issuances SAU	900.000	3,13 %	19.01.2027	981.265	0,05 %
Bankia SA	900.000	5,00 %	28.06.2019	969.387	0,05 %
Banco Santander SA	900.000	2,00 %	27.11.2034	969.380	0,05 %
Iberdrola International BV	1.000.000	0,38 %	15.09.2025	953.052	0,05 %
Bankia SA	900.000	1,13 %	05.08.2022	932.886	0,05 %
Santander Consumer Finance SA	900.000	0,90 %	18.02.2020	914.982	0,04 %
Santander Consumer Finance SA	900.000	0,88 %	24.01.2022	912.336	0,04 %
Abertis Infraestructuras SA	900.000	1,00 %	27.02.2027	859.411	0,04 %
Telefonica Emisiones SAU	800.000	2,32 %	17.10.2028	846.854	0,04 %
Merlin Properties Socimi SA	800.000	2,23 %	25.04.2023	842.898	0,04 %
Santander International Debt SA	800.000	1,38 %	03.03.2021	829.574	0,04 %
Santander Consumer Finance SA	800.000	1,50 %	12.11.2020	829.569	0,04 %
Ayt Cedulas Cajas Global	700.000	3,75 %	14.12.2022	814.205	0,04 %
Banco de Sabadell SA	800.000	0,38 %	10.06.2020	808.825	0,04 %
Inmobiliaria Colonial Socimi SA	800.000	1,63 %	28.11.2025	791.747	0,04 %
Telefonica Emisiones SAU	800.000	1,93 %	17.10.2031	789.322	0,04 %
CaixaBank SA	650.000	4,50 %	26.01.2022	763.443	0,04 %
Ayt Cedulas Cajas Global	600.000	4,25 %	25.10.2023	727.170	0,04 %
Telefonica Emisiones SAU	700.000	1,53 %	17.01.2025	723.153	0,04 %
Banco de Sabadell SA	700.000	0,88 %	12.11.2021	718.425	0,03 %
Banco Popular Espanol SA	700.000	0,88 %	28.09.2021	718.371	0,03 %
Bankia SA	700.000	0,88 %	21.01.2021	717.065	0,03 %
Banco Popular Espanol SA	700.000	0,75 %	29.09.2020	714.739	0,03 %
Banco de Sabadell SA	700.000	0,63 %	03.11.2020	712.426	0,03 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	600.000	3,88 %	30.01.2023	710.980	0,03 %
Repsol International Finance BV	700.000	0,50 %	23.05.2022	702.726	0,03 %
Banco de Sabadell SA	700.000	0,13 %	20.10.2023	686.631	0,03 %
Repsol International Finance BV	600.000	2,25 %	10.12.2026	651.300	0,03 %
Repsol International Finance BV	600.000	4,88 %	19.02.2019	632.720	0,03 %
Amadeus Capital Markets SAU	600.000	1,63 %	17.11.2021	628.826	0,03 %
BBVA Subordinated Capital SAU^	600.000	3,50 %	11.04.2024	624.343	0,03 %
Criteria Caixa SAU	600.000	2,38 %	09.05.2019	617.258	0,03 %
BBVA Senior Finance SAU	600.000	2,38 %	22.01.2019	615.650	0,03 %
Caja Rural de Castilla-La Mancha SCC	600.000	0,88 %	01.10.2021	615.026	0,03 %
Red Electrica Financiaciones SAU	600.000	1,13 %	24.04.2025	611.913	0,03 %
Bankia SA	500.000	4,00 %	03.02.2025	610.083	0,03 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
PITCH ¹	500.000	5,13 %	20.07.2022	606.135	0,03 %
Red Electrica Financiaciones SAU	600.000	1,00 %	21.04.2026	599.702	0,03 %
IM Cedula 10 Fondo de Titulacion de Activos	500.000	4,50 %	21.02.2022	587.052	0,03 %
Abertis Infraestructuras SA	500.000	3,75 %	20.06.2023	579.541	0,03 %
Repsol International Finance BV	500.000	3,63 %	07.10.2021	562.664	0,03 %
Santander Issuances SAU	500.000	3,25 %	04.04.2026	549.721	0,03 %
Abertis Infraestructuras SA	500.000	2,50 %	27.02.2025	544.100	0,03 %
Telefonica Emisiones SAU	500.000	2,24 %	27.05.2022	539.167	0,03 %
Iberdrola International BV	500.000	1,88 %	08.10.2024	533.835	0,03 %
Cajamar Caja Rural SCC	500.000	1,25 %	26.01.2022	513.481	0,03 %
Enagas Financiaciones SAU	500.000	1,00 %	25.03.2023	511.948	0,02 %
Mapfre SA	500.000	1,63 %	19.05.2026	511.109	0,02 %
Santander Consumer Finance SA	500.000	1,00 %	26.05.2021	510.996	0,02 %
CaixaBank SA	500.000	0,63 %	12.11.2020	509.239	0,02 %
Bankinter SA	500.000	0,63 %	09.10.2020	508.851	0,02 %
Enagas Financiaciones SAU	500.000	1,38 %	05.05.2028	501.393	0,02 %
CaixaBank SA	500.000	1,13 %	17.05.2024	501.336	0,02 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	500.000	0,75 %	11.09.2022	500.482	0,02 %
Merlin Properties Socimi SA	500.000	1,88 %	02.11.2026	499.191	0,02 %
Gas Natural Fenosa Finance BV	400.000	3,88 %	17.01.2023	465.712	0,02 %
CaixaBank SA	400.000	2,63 %	21.03.2024	452.938	0,02 %
Gas Natural Fenosa Finance BV	400.000	2,88 %	11.03.2024	448.109	0,02 %
Telefonica Emisiones SAU	400.000	2,93 %	17.10.2029	444.046	0,02 %
Gas Natural Fenosa Finance BV	400.000	3,50 %	15.04.2021	443.114	0,02 %
Merlin Properties Socimi SA	400.000	2,38 %	23.05.2022	424.567	0,02 %
Repsol International Finance BV	400.000	2,63 %	28.05.2020	423.821	0,02 %
Banco Mare Nostrum SA	400.000	3,13 %	21.01.2019	413.972	0,02 %
Kutxabank SA	400.000	1,25 %	22.09.2025	413.942	0,02 %
Cajamar Caja Rural SCC	400.000	1,00 %	22.10.2020	408.777	0,02 %
Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	400.000	1,00 %	28.04.2021	407.828	0,02 %
Gas Natural Fenosa Finance BV	400.000	1,25 %	19.04.2026	400.823	0,02 %
Iberdrola International BV [^]	400.000	1,88 %	22.05.2166	400.756	0,02 %
Red Electrica Financiaciones SAU	300.000	3,88 %	25.01.2022	344.314	0,02 %
Telefonica Emisiones SAU	300.000	3,96 %	26.03.2021	336.346	0,02 %
Ferrovial Emisiones SA	300.000	3,38 %	07.06.2021	331.792	0,02 %
Enagas Financiaciones SAU	300.000	2,50 %	11.04.2022	328.592	0,02 %
Ferrovial Emisiones SA	300.000	2,50 %	15.07.2024	327.266	0,02 %
Red Electrica Financiaciones SAU	300.000	2,13 %	01.07.2023	325.699	0,02 %
Iberdrola International BV	300.000	1,75 %	17.09.2023	318.658	0,02 %
Banco Popular Espanol SA	300.000	3,75 %	22.01.2019	312.513	0,02 %
Banco Popular Espanol SA	300.000	1,00 %	03.03.2022	309.078	0,02 %
Inmobiliaria Colonial Socimi SA	300.000	1,86 %	05.06.2019	307.445	0,02 %
Telefonica Emisiones SAU	300.000	0,75 %	13.04.2022	303.952	0,01 %
Caja Rural de Navarra SCC	300.000	0,50 %	16.03.2022	301.845	0,01 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	200.000	2,25 %	12.06.2024	223.402	0,01 %
Iberdrola International BV	200.000	3,00 %	31.01.2022	221.802	0,01 %
Ayt Cedula Cajas Global	200.000	4,50 %	02.12.2019	217.867	0,01 %
Gas Natural Fenosa Finance BV	200.000	1,38 %	21.01.2025	204.363	0,01 %
Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	200.000	0,88 %	06.04.2023	199.720	0,01 %
Iberdrola Finanzas SA	200.000	1,62 %	29.11.2029	199.604	0,01 %
				124.951.682	6,02 %
Supranational 15,08 % (2016: 15,27 %)					
Europäische Investitionsbank	10.500.000	0,25 %	15.10.2020	10.692.707	0,52 %
Europäische Investitionsbank	9.000.000	0,00 %	15.03.2024	8.901.378	0,43 %
Europäische Investitionsbank	6.300.000	2,25 %	14.10.2022	7.026.781	0,34 %
European Financial Stability Facility	5.050.000	3,38 %	03.04.2037	6.947.366	0,33 %
European Financial Stability Facility	6.900.000	0,40 %	31.05.2026	6.841.874	0,33 %
Europäische Investitionsbank	5.100.000	4,50 %	15.10.2025	6.764.762	0,33 %
European Financial Stability Facility	5.940.000	1,50 %	22.01.2020	6.176.406	0,30 %
European Financial Stability Facility	5.550.000	1,88 %	23.05.2023	6.094.666	0,29 %
Europäische Investitionsbank	4.100.000	4,00 %	15.04.2030	5.670.628	0,27 %
European Stability Mechanism	5.600.000	0,50 %	02.03.2026	5.628.185	0,27 %
European Stability Mechanism	4.600.000	0,13 %	22.04.2024	4.580.298	0,22 %
Europäische Investitionsbank	4.300.000	0,88 %	13.09.2024	4.490.241	0,22 %
European Financial Stability Facility	4.050.000	1,63 %	17.07.2020	4.254.962	0,21 %
European Financial Stability Facility	4.200.000	0,00 %	29.03.2021	4.238.186	0,20 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Europäische Union	3.400.000	3,00 %	04.09.2026	4.160.638	0,20 %
Europäische Investitionsbank	3.950.000	1,50 %	15.07.2020	4.144.423	0,20 %
Europäische Union	3.650.000	2,75 %	21.09.2021	4.057.194	0,20 %
European Stability Mechanism	3.950.000	0,88 %	15.10.2019	4.047.917	0,20 %
Europäische Investitionsbank	3.100.000	3,00 %	14.10.2033	4.020.787	0,19 %
European Financial Stability Facility	3.800.000	1,38 %	07.06.2021	4.014.092	0,19 %
European Financial Stability Facility	3.250.000	2,35 %	29.07.2044	3.919.032	0,19 %
European Stability Mechanism	3.700.000	1,38 %	04.03.2021	3.904.773	0,19 %
European Financial Stability Facility	3.800.000	0,50 %	20.01.2023	3.899.355	0,19 %
Europäische Investitionsbank	3.400.000	2,75 %	15.09.2021	3.785.886	0,18 %
Europäische Investitionsbank	3.800.000	1,13 %	15.09.2036	3.781.878	0,18 %
European Financial Stability Facility	3.600.000	2,63 %	02.05.2019	3.750.847	0,18 %
European Financial Stability Facility	3.950.000	1,20 %	17.02.2045	3.715.627	0,18 %
Europäische Investitionsbank	3.400.000	1,63 %	15.03.2023	3.684.811	0,18 %
Europäische Investitionsbank	3.150.000	3,00 %	28.09.2022	3.618.317	0,17 %
Europäische Investitionsbank	3.600.000	1,00 %	14.04.2032	3.602.056	0,17 %
Europäische Investitionsbank	3.200.000	3,63 %	15.01.2021	3.590.342	0,17 %
Europäische Investitionsbank	3.600.000	0,38 %	14.04.2026	3.577.921	0,17 %
Europäische Union	3.400.000	0,63 %	04.11.2023	3.503.346	0,17 %
European Financial Stability Facility	3.300.000	1,75 %	29.10.2020	3.494.525	0,17 %
Europäische Union	3.500.000	0,75 %	04.04.2031	3.455.302	0,17 %
European Financial Stability Facility	3.000.000	2,13 %	19.02.2024	3.358.341	0,16 %
Europäische Investitionsbank	3.300.000	1,00 %	14.03.2031	3.345.184	0,16 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	3.110.000	3,88 %	20.05.2019	3.299.107	0,16 %
European Stability Mechanism	3.620.000	0,88 %	18.07.2042	3.291.880	0,16 %
Europäische Union	2.900.000	3,50 %	04.06.2021	3.275.820	0,16 %
European Stability Mechanism	2.900.000	2,13 %	20.11.2023	3.251.799	0,16 %
Europäische Investitionsbank	3.049.000	4,25 %	15.04.2019	3.236.690	0,16 %
Europäische Investitionsbank	2.700.000	2,75 %	15.09.2025	3.196.349	0,15 %
Europäische Investitionsbank	3.200.000	0,13 %	15.04.2025	3.164.026	0,15 %
European Financial Stability Facility	3.100.000	1,25 %	24.05.2033	3.159.322	0,15 %
Europäische Investitionsbank	3.100.000	0,13 %	15.06.2020	3.143.651	0,15 %
European Financial Stability Facility	2.400.000	3,00 %	04.09.2034	3.085.123	0,15 %
Europäische Investitionsbank	2.900.000	1,38 %	15.09.2021	3.075.372	0,15 %
European Financial Stability Facility	3.000.000	0,13 %	17.10.2023	3.000.894	0,14 %
European Financial Stability Facility	2.700.000	1,75 %	27.06.2024	2.972.970	0,14 %
European Financial Stability Facility	2.900.000	1,25 %	22.01.2019	2.954.001	0,14 %
European Stability Mechanism	2.900.000	0,10 %	03.11.2020	2.940.994	0,14 %
European Financial Stability Facility	2.900.000	0,10 %	19.01.2021	2.935.322	0,14 %
European Financial Stability Facility	2.600.000	3,38 %	05.07.2021	2.932.636	0,14 %
Europäische Investitionsbank	2.600.000	4,63 %	15.04.2020	2.903.183	0,14 %
European Stability Mechanism	2.450.000	1,80 %	02.11.2046	2.678.722	0,13 %
Europäische Investitionsbank	2.450.000	1,75 %	15.09.2045	2.653.316	0,13 %
Europäische Investitionsbank	2.400.000	2,63 %	16.03.2020	2.564.309	0,12 %
Europäische Union	2.050.000	2,50 %	04.11.2027	2.434.127	0,12 %
Europäische Union	2.150.000	2,75 %	04.04.2022	2.418.221	0,12 %
Europäische Investitionsbank	1.850.000	2,75 %	15.03.2040	2.417.983	0,12 %
European Financial Stability Facility	2.200.000	1,38 %	31.05.2047	2.138.968	0,10 %
Europäische Investitionsbank	2.000.000	1,50 %	15.04.2021	2.121.416	0,10 %
European Financial Stability Facility	1.900.000	2,25 %	05.09.2022	2.107.628	0,10 %
Europäische Investitionsbank	2.100.000	0,05 %	15.12.2023	2.101.050	0,10 %
Europäische Investitionsbank	2.100.000	0,50 %	15.01.2027	2.094.330	0,10 %
European Financial Stability Facility	1.900.000	2,00 %	28.02.2056	2.080.156	0,10 %
Europäische Investitionsbank	2.000.000	1,38 %	15.11.2019	2.069.748	0,10 %
Europäische Investitionsbank	1.800.000	2,13 %	15.01.2024	2.016.029	0,10 %
European Stability Mechanism	2.000.000	0,00 %	18.10.2022	2.005.546	0,10 %
Europäische Investitionsbank	2.000.000	0,00 %	16.10.2023	1.988.676	0,10 %
European Stability Mechanism	1.750.000	1,85 %	01.12.2055	1.909.821	0,09 %
European Financial Stability Facility	1.600.000	3,50 %	04.02.2022	1.842.638	0,09 %
Europäische Investitionsbank	1.800.000	0,00 %	15.01.2019	1.810.060	0,09 %
African Development Bank	1.900.000	0,13 %	07.10.2026	1.806.330	0,09 %
Europäische Investitionsbank	1.350.000	3,50 %	15.04.2027	1.729.581	0,08 %
European Stability Mechanism	1.700.000	1,13 %	03.05.2032	1.728.013	0,08 %
European Financial Stability Facility	1.700.000	0,13 %	04.11.2019	1.718.183	0,08 %
Europäische Union	1.150.000	3,38 %	04.04.2038	1.622.550	0,08 %
European Stability Mechanism	1.500.000	1,00 %	23.09.2025	1.568.997	0,08 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Europäische Union	1.459.000	1,38 %	04.10.2029	1.565.632	0,08 %
Europäische Investitionsbank	1.450.000	2,50 %	15.03.2019	1.502.729	0,07 %
Nordic Investment Bank	1.500.000	0,13 %	10.06.2024	1.493.346	0,07 %
Europäische Union	1.350.000	1,50 %	04.10.2035	1.447.216	0,07 %
Europäische Investitionsbank	1.150.000	2,63 %	15.03.2035	1.444.724	0,07 %
EUROFIMA	1.300.000	4,38 %	21.10.2019	1.408.959	0,07 %
Europäische Investitionsbank	1.300.000	1,25 %	13.11.2026	1.391.945	0,07 %
Europäische Investitionsbank	1.500.000	0,50 %	13.11.2037	1.332.753	0,06 %
European Financial Stability Facility	1.200.000	1,70 %	13.02.2043	1.266.438	0,06 %
Council Of Europe Development Bank	1.150.000	1,75 %	24.04.2024	1.258.731	0,06 %
Europäische Union	1.000.000	2,88 %	04.04.2028	1.232.675	0,06 %
European Financial Stability Facility	1.000.000	1,80 %	10.07.2048	1.056.792	0,05 %
European Financial Stability Facility	1.000.000	0,88 %	26.07.2027	1.021.703	0,05 %
European Financial Stability Facility	1.000.000	1,45 %	05.09.2040	1.017.390	0,05 %
European Financial Stability Facility	1.000.000	0,75 %	03.05.2027	1.012.018	0,05 %
Europäische Union	1.000.000	1,13 %	04.04.2036	1.009.668	0,05 %
Europäische Investitionsbank	1.000.000	0,00 %	13.03.2026	964.659	0,05 %
Europäische Investitionsbank	600.000	3,63 %	14.03.2042	902.292	0,04 %
Council Of Europe Development Bank	900.000	0,38 %	08.06.2026	886.548	0,04 %
Corp.Andina de Fomento	800.000	1,88 %	29.05.2021	843.383	0,04 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	900.000	0,63 %	12.01.2033	835.417	0,04 %
European Financial Stability Facility	600.000	2,75 %	03.12.2029	729.236	0,04 %
Corp.Andina de Fomento	600.000	1,00 %	10.11.2020	615.416	0,03 %
EUROFIMA	500.000	4,00 %	27.10.2021	573.789	0,03 %
Council Of Europe Development Bank	500.000	2,88 %	31.08.2021	555.663	0,03 %
European Financial Stability Facility	400.000	3,88 %	30.03.2032	554.327	0,03 %
Council Of Europe Development Bank	500.000	3,00 %	13.07.2020	542.169	0,03 %
Council Of Europe Development Bank	500.000	0,75 %	09.06.2025	512.751	0,02 %
Europäische Union	483.000	3,38 %	10.05.2019	508.526	0,02 %
Europäische Investitionsbank	400.000	2,50 %	16.09.2019	420.544	0,02 %
African Development Bank	400.000	0,25 %	21.11.2024	396.048	0,02 %
EUROFIMA	300.000	0,25 %	25.04.2023	298.895	0,01 %
Europäische Union	100.000	0,25 %	04.07.2020	101.642	0,00 %
				312.890.595	15,08 %
Schweden 2,83 % (2016: 2,72 %)					
Swedbank Hypotek AB	2.500.000	0,15 %	10.02.2021	2.519.313	0,12 %
Stadshypotek AB	2.000.000	1,00 %	01.04.2019	2.034.134	0,10 %
Stadshypotek AB	2.000.000	0,38 %	22.02.2023	2.014.996	0,10 %
Sveriges Sakerställda Obligationer AB	1.800.000	0,25 %	20.01.2021	1.819.091	0,09 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	1.700.000	1,88 %	14.11.2019	1.764.493	0,09 %
Nordea Bank AB	1.600.000	2,00 %	17.02.2021	1.695.134	0,08 %
Svenska Handelsbanken AB	1.500.000	1,13 %	14.12.2022	1.554.474	0,07 %
Sweden Government International Bond	1.500.000	0,75 %	02.05.2019	1.524.572	0,07 %
Swedbank AB	1.400.000	0,63 %	04.01.2021	1.424.550	0,07 %
Svenska Handelsbanken AB^	1.200.000	2,66 %	15.01.2024	1.230.235	0,06 %
Swedbank Hypotek AB	1.200.000	0,38 %	11.03.2022	1.215.674	0,06 %
Volvo Treasury AB^	1.000.000	4,20 %	10.06.2075	1.074.620	0,05 %
Vattenfall AB	1.000.000	6,75 %	31.01.2019	1.073.302	0,05 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB^	1.056.000	1,38 %	31.10.2028	1.062.330	0,05 %
Akelius Residential Property AB	1.000.000	1,75 %	07.02.2025	1.012.861	0,05 %
Nordea Bank AB	950.000	4,00 %	11.07.2019	1.010.649	0,05 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	1.000.000	0,15 %	11.02.2021	1.007.793	0,05 %
Stadshypotek AB	1.000.000	0,38 %	21.02.2024	1.000.603	0,05 %
Svenska Handelsbanken AB	1.000.000	0,25 %	28.02.2022	999.576	0,05 %
Telia Co. AB	900.000	4,25 %	18.02.2020	980.156	0,05 %
Svenska Handelsbanken AB	800.000	2,63 %	23.08.2022	884.137	0,04 %
Svenska Handelsbanken AB	800.000	2,25 %	27.08.2020	847.586	0,04 %
Telia Co. AB^	800.000	3,00 %	04.04.2078	845.200	0,04 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	800.000	0,63 %	30.01.2023	817.178	0,04 %
Fastighets AB Balder	800.000	1,88 %	14.03.2025	814.130	0,04 %
Vattenfall AB^	800.000	3,00 %	19.03.2077	812.004	0,04 %
Sveriges Sakerställda Obligationer AB	800.000	0,88 %	29.03.2027	808.974	0,04 %
Fastighets AB Balder	800.000	1,13 %	14.03.2022	807.458	0,04 %
Nordea Bank AB	800.000	1,13 %	27.09.2027	806.459	0,04 %
Nordea Bank AB	700.000	3,25 %	05.07.2022	792.903	0,04 %
Vattenfall AB	650.000	6,25 %	17.03.2021	775.752	0,04 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Lansforsakringar Hypotek AB	750.000	0,25 %	12.04.2023	748.461	0,04 %
SKF AB	700.000	1,63 %	02.12.2022	728.991	0,04 %
Nordea Bank AB	650.000	4,00 %	29.06.2020	714.738	0,03 %
Telia Co. AB	600.000	3,63 %	14.02.2024	701.195	0,03 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	686.000	0,30 %	17.02.2022	688.070	0,03 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	600.000	1,63 %	04.11.2020	630.158	0,03 %
Lansforsakringar Hypotek AB	600.000	1,13 %	07.05.2020	618.445	0,03 %
Svenska Handelsbanken AB	533.000	4,38 %	20.10.2021	618.052	0,03 %
Investor AB	500.000	4,88 %	18.11.2021	591.488	0,03 %
Telia Co. AB	500.000	3,00 %	07.09.2027	576.222	0,03 %
Nordea Bank AB	500.000	4,00 %	29.03.2021	559.269	0,03 %
Akelius Residential Property AB	557.000	1,13 %	14.03.2024	549.877	0,03 %
SBAB Bank AB	500.000	2,38 %	04.09.2020	530.272	0,03 %
Telia Co. AB	450.000	4,75 %	16.11.2021	529.744	0,03 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	500.000	2,00 %	19.02.2021	529.503	0,03 %
Nordea Bank AB^	500.000	1,88 %	10.11.2025	519.200	0,03 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	500.000	0,75 %	24.08.2021	510.769	0,02 %
SBAB Bank AB	500.000	0,50 %	11.05.2021	504.050	0,02 %
Securitas AB	500.000	1,13 %	20.02.2024	502.269	0,02 %
Stadshypotek AB	480.000	0,05 %	20.06.2022	478.652	0,02 %
Stadshypotek AB	500.000	0,13 %	05.10.2026	475.648	0,02 %
Stadshypotek AB	400.000	1,63 %	30.10.2020	420.079	0,02 %
Atlas Copco AB	430.000	0,63 %	30.08.2026	416.328	0,02 %
Molnlycke Holding AB	400.000	1,75 %	28.02.2024	413.250	0,02 %
Swedbank AB	400.000	1,00 %	01.06.2022	412.573	0,02 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	400.000	0,75 %	16.06.2022	411.462	0,02 %
Essity AB	400.000	1,63 %	30.03.2027	410.834	0,02 %
Swedbank AB	400.000	1,50 %	18.03.2019	408.134	0,02 %
Stockholms Lans Landsting	400.000	0,75 %	26.02.2025	404.099	0,02 %
Essity AB	400.000	0,50 %	05.03.2020	403.363	0,02 %
Lansforsakringar Hypotek AB	400.000	0,25 %	22.04.2022	401.982	0,02 %
Nordea Bank AB	350.000	4,50 %	26.03.2020	383.796	0,02 %
Atlas Copco AB	300.000	2,50 %	28.02.2023	331.083	0,02 %
Securitas AB	300.000	2,63 %	22.02.2021	321.077	0,02 %
SKF AB	300.000	2,38 %	29.10.2020	317.783	0,02 %
Swedbank Hypotek AB	300.000	1,13 %	21.05.2021	311.872	0,02 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	300.000	1,50 %	25.02.2020	311.227	0,01 %
Molnlycke Holding AB	300.000	1,50 %	28.02.2022	311.136	0,01 %
Alfa Laval Treasury International AB	300.000	1,38 %	12.09.2022	310.740	0,01 %
Nordea Bank AB	300.000	1,13 %	12.02.2025	309.245	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	300.000	2,00 %	18.03.2019	307.732	0,01 %
Telia Co. AB	250.000	3,88 %	01.10.2025	302.516	0,01 %
Stockholms Lans Landsting	250.000	2,13 %	12.09.2022	271.175	0,01 %
Vattenfall AB	200.000	5,38 %	29.04.2024	257.714	0,01 %
Investor AB	200.000	4,50 %	12.05.2023	242.510	0,01 %
Essity AB	200.000	2,50 %	09.06.2023	218.971	0,01 %
Essity AB	200.000	1,13 %	27.03.2024	202.948	0,01 %
Sweden Government International Bond	200.000	0,05 %	12.02.2020	201.889	0,01 %
Telia Co. AB	200.000	1,63 %	23.02.2035	183.941	0,01 %
Essity AB	100.000	1,13 %	05.03.2025	100.656	0,00 %
				58.635.525	2,83 %
Schweiz 2,09 % (2016: 2,28 %)					
UBS Group Funding Switzerland AG	3.095.000	1,50 %	30.11.2024	3.214.662	0,16 %
Roche Holdings, Inc.	1.600.000	6,50 %	04.03.2021	1.928.013	0,09 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	1.800.000	1,25 %	14.04.2022	1.856.772	0,09 %
Credit Suisse AG	1.800.000	1,38 %	29.11.2019	1.849.862	0,09 %
Novartis Finance SA	1.500.000	1,13 %	30.09.2027	1.528.825	0,07 %
ELM BV for Swiss Reinsurance Co., Ltd.^	1.400.000	2,60 %	01.09.2166	1.466.336	0,07 %
Credit Suisse AG	1.300.000	0,75 %	17.09.2021	1.332.058	0,06 %
ELM BV for Swiss Life Insurance & Pension Group^	1.000.000	4,50 %	19.05.2166	1.150.642	0,06 %
Credit Suisse AG	1.020.000	4,75 %	05.08.2019	1.098.672	0,05 %
Holcim Finance Luxembourg SA	1.100.000	1,75 %	29.08.2029	1.091.240	0,05 %
Glencore Finance Europe Ltd.	1.000.000	1,25 %	17.03.2021	1.023.400	0,05 %
Credit Suisse AG	900.000	1,50 %	10.04.2026	939.935	0,05 %
Credit Suisse AG	900.000	1,38 %	31.01.2022	938.232	0,05 %
Credit Suisse AG	900.000	0,38 %	11.04.2019	905.574	0,04 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
UBS AG	850.000	1,38 %	16.04.2021	888.826	0,04 %
Glencore Finance Europe Ltd.	800.000	2,75 %	01.04.2021	854.218	0,04 %
Credit Suisse AG	800.000	1,75 %	15.01.2021	843.230	0,04 %
UBS AG	800.000	1,25 %	03.09.2021	830.380	0,04 %
ABB Finance BV	800.000	2,63 %	26.03.2019	826.062	0,04 %
Credit Suisse AG	800.000	1,13 %	15.09.2020	822.492	0,04 %
Nestle Finance International Ltd.	800.000	0,75 %	16.05.2023	818.146	0,04 %
UBS Group Funding Switzerland AG	800.000	1,25 %	01.09.2026	807.468	0,04 %
Credit Suisse Group AG^	800.000	1,25 %	17.07.2025	807.213	0,04 %
Coca-Cola HBC Finance BV	700.000	2,38 %	18.06.2020	735.385	0,04 %
UBS AG	700.000	1,13 %	30.06.2020	718.936	0,04 %
Nestle Finance International Ltd.	700.000	1,75 %	02.11.2037	714.902	0,03 %
UBS AG	650.000	3,88 %	02.12.2019	701.782	0,03 %
Aquarius & Investments PLC for Zurich Insurance Co., Ltd.^	600.000	4,25 %	02.10.2043	699.120	0,03 %
Novartis Finance SA	700.000	0,00 %	31.03.2021	697.947	0,03 %
Nestle Finance International Ltd.	600.000	1,75 %	12.09.2022	643.907	0,03 %
Holcim Finance Luxembourg SA	600.000	1,38 %	26.05.2023	621.937	0,03 %
Glencore Finance Europe Ltd.	600.000	1,63 %	18.01.2022	620.635	0,03 %
Credit Suisse AG	600.000	1,00 %	07.06.2023	613.655	0,03 %
Demeter Investments BV for Zurich Insurance Co., Ltd.^	500.000	3,50 %	01.10.2046	562.249	0,03 %
Glencore Finance Europe SA	500.000	3,38 %	30.09.2020	542.295	0,03 %
Holcim US Finance Sarl & Cie SCS	500.000	2,63 %	07.09.2020	532.917	0,03 %
Lunar Funding V for Swisscom AG	500.000	1,88 %	08.09.2021	530.075	0,03 %
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co., Ltd.	500.000	1,75 %	16.09.2024	529.761	0,03 %
Geberit International BV	500.000	0,69 %	30.03.2021	507.735	0,02 %
Glencore Finance Europe Ltd.	500.000	1,75 %	17.03.2025	505.603	0,02 %
ABB Finance BV	500.000	0,75 %	16.05.2024	503.946	0,02 %
UBS AG	400.000	4,00 %	08.04.2022	465.556	0,02 %
Coca-Cola HBC Finance BV	400.000	1,88 %	11.11.2024	428.326	0,02 %
Syngenta Finance NV	400.000	1,88 %	02.11.2021	408.548	0,02 %
Credit Suisse AG	400.000	1,00 %	12.03.2019	406.295	0,02 %
Cloverie plc for Swiss Reinsurance Co., Ltd.^	300.000	6,63 %	01.09.2042	379.567	0,02 %
Nestle Finance International Ltd.	350.000	1,25 %	04.05.2020	361.087	0,02 %
Nestle Finance International Ltd.	300.000	2,13 %	10.09.2021	322.936	0,02 %
Adecco International Financial Services BV	300.000	1,50 %	22.11.2022	314.744	0,02 %
Holcim Finance Luxembourg SA	250.000	3,00 %	22.01.2024	282.096	0,01 %
Cloverie plc for Zurich Insurance Co., Ltd.^	250.000	7,50 %	24.07.2039	277.893	0,01 %
Novartis Finance SA	200.000	1,63 %	09.11.2026	213.180	0,01 %
Lunar Funding V for Swisscom AG	200.000	2,00 %	30.09.2020	210.336	0,01 %
Novartis Finance SA	200.000	0,75 %	09.11.2021	204.480	0,01 %
Adecco International Financial Services BV	100.000	1,00 %	02.12.2024	101.384	0,01 %
Novartis Finance SA	100.000	0,63 %	20.09.2028	95.734	0,00 %
				43.277.207	2,09 %
VAE 0,08 % (2016: 0,08 %)					
Emirates Telecommunications Group Co. PJSC	1.400.000	2,75 %	18.06.2026	1.550.119	0,07 %
Emirates Telecommunications Group Co. PJSC	100.000	1,75 %	18.06.2021	104.675	0,01 %
				1.654.794	0,08 %
Vereinigtes Königreich 7,24 % (2016: 7,13 %)					
Santander UK plc	2.500.000	0,25 %	09.08.2021	2.518.875	0,12 %
GlaxoSmithKline Capital plc	2.200.000	0,63 %	02.12.2019	2.229.036	0,11 %
Anglo American Capital plc	2.000.000	3,50 %	28.03.2022	2.219.242	0,11 %
Urenco Finance NV	1.900.000	2,25 %	05.08.2022	2.041.814	0,10 %
Lloyds Bank plc	1.800.000	4,00 %	29.09.2020	2.002.615	0,10 %
Vodafone Group plc	1.900.000	1,25 %	25.08.2021	1.963.836	0,09 %
Nationwide Building Society	1.500.000	4,38 %	28.02.2022	1.764.405	0,09 %
British Telecommunications plc	1.700.000	0,63 %	10.03.2021	1.718.207	0,08 %
Nationwide Building Society	1.700.000	0,63 %	25.03.2027	1.666.129	0,08 %
Santander UK plc	1.450.000	4,25 %	12.04.2021	1.652.548	0,08 %
Royal Bank of Scotland plc	1.400.000	3,88 %	19.10.2020	1.554.216	0,07 %
Lloyds Bank plc	1.400.000	0,38 %	18.01.2021	1.417.940	0,07 %
HSBC Holdings plc	1.300.000	6,00 %	10.06.2019	1.409.880	0,07 %
Cadent Finance plc	1.400.000	0,63 %	22.09.2024	1.368.984	0,07 %
HSBC Holdings plc	1.300.000	1,50 %	15.03.2022	1.361.758	0,07 %
BG Energy Capital plc	1.300.000	1,25 %	21.11.2022	1.353.318	0,07 %
Barclays Bank plc	1.250.000	4,00 %	07.10.2019	1.344.912	0,06 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
HSBC Holdings plc	1.200.000	3,13 %	07.06.2028	1.335.283	0,06 %
Lloyds Banking Group plc	1.280.000	1,00 %	09.11.2023	1.291.121	0,06 %
Barclays Bank plc	1.100.000	4,25 %	02.03.2022	1.288.375	0,06 %
BAT International Finance plc	1.200.000	2,25 %	16.01.2030	1.240.240	0,06 %
FCE Bank plc	1.200.000	0,87 %	13.09.2021	1.218.869	0,06 %
Compass Group International BV	1.200.000	0,63 %	03.07.2024	1.189.916	0,06 %
Vodafone Group plc	1.100.000	2,20 %	25.08.2026	1.177.660	0,06 %
Santander UK Group Holdings plc	1.161.000	1,13 %	08.09.2023	1.176.018	0,06 %
HSBC Bank plc	1.050.000	4,00 %	15.01.2021	1.174.821	0,06 %
Bank of Scotland plc	950.000	4,50 %	13.07.2021	1.099.102	0,05 %
Barclays Bank plc	950.000	6,00 %	14.01.2021	1.096.941	0,05 %
Standard Chartered plc^	1.000.000	4,00 %	21.10.2025	1.090.074	0,05 %
Lloyds Bank plc	950.000	6,50 %	24.03.2020	1.082.615	0,05 %
Imperial Brands Finance plc	1.000.000	2,25 %	26.02.2021	1.058.062	0,05 %
Barclays plc	1.000.000	1,88 %	08.12.2023	1.050.694	0,05 %
Sky plc	1.000.000	1,50 %	15.09.2021	1.043.830	0,05 %
ITV plc	1.000.000	2,00 %	01.12.2023	1.037.040	0,05 %
BP Capital Markets plc	1.000.000	2,99 %	18.02.2019	1.035.133	0,05 %
Smiths Group plc	1.000.000	2,00 %	23.02.2027	1.034.979	0,05 %
Standard Chartered plc^	1.023.000	1,63 %	03.10.2027	1.034.415	0,05 %
Coca-Cola European Partners plc	1.000.000	1,13 %	26.05.2024	1.017.429	0,05 %
Santander UK plc	1.000.000	0,88 %	13.01.2020	1.016.850	0,05 %
Lloyds Bank plc	1.000.000	0,50 %	22.07.2020	1.016.686	0,05 %
Nationwide Building Society^	1.000.000	2,00 %	25.07.2029	1.012.240	0,05 %
Royal Bank of Scotland plc	900.000	5,50 %	23.03.2020	1.007.338	0,05 %
DS Smith plc	1.000.000	1,38 %	26.07.2024	1.003.470	0,05 %
Royal Bank of Scotland plc	1.000.000	0,50 %	15.05.2024	1.000.717	0,05 %
Vodafone Group plc	1.000.000	1,13 %	20.11.2025	993.525	0,05 %
Imperial Brands Finance plc	900.000	5,00 %	02.12.2019	985.871	0,05 %
BP Capital Markets plc	900.000	2,21 %	25.09.2026	983.378	0,05 %
NGG Finance plc^	900.000	4,25 %	18.06.2076	976.826	0,05 %
Aviva plc^	900.000	3,38 %	04.12.2045	975.685	0,05 %
BG Energy Capital plc	900.000	3,63 %	16.07.2019	951.795	0,05 %
Barclays plc	900.000	1,88 %	23.03.2021	942.339	0,05 %
BP Capital Markets plc	900.000	1,37 %	03.03.2022	941.824	0,05 %
Barclays plc^	900.000	2,63 %	11.11.2025	935.710	0,05 %
Barclays plc	900.000	1,50 %	01.04.2022	933.777	0,05 %
Lloyds Bank plc	900.000	1,25 %	13.01.2025	930.438	0,04 %
Royal Bank of Scotland plc	850.000	5,38 %	30.09.2019	930.033	0,04 %
HSBC Holdings plc^	900.000	3,38 %	10.01.2024	929.221	0,04 %
Nationwide Building Society	900.000	1,25 %	03.03.2025	920.009	0,04 %
Santander UK plc	900.000	2,00 %	14.01.2019	919.571	0,04 %
BP Capital Markets plc	900.000	1,08 %	26.06.2025	910.679	0,04 %
AstraZeneca plc	900.000	1,25 %	12.05.2028	907.650	0,04 %
British Telecommunications plc	880.000	1,75 %	10.03.2026	905.518	0,04 %
Leeds Building Society	900.000	0,13 %	21.04.2020	904.997	0,04 %
AstraZeneca plc	900.000	0,25 %	12.05.2021	900.254	0,04 %
HSBC Holdings plc	800.000	2,50 %	15.03.2027	891.542	0,04 %
Bank of Scotland plc	800.000	3,88 %	07.02.2020	868.980	0,04 %
Lloyds Bank plc	700.000	4,88 %	13.01.2023	860.826	0,04 %
BP Capital Markets plc	850.000	0,83 %	19.09.2024	853.396	0,04 %
Sky plc	800.000	1,88 %	24.11.2023	851.853	0,04 %
BP Capital Markets plc	800.000	1,53 %	26.09.2022	843.122	0,04 %
Unilever NV	800.000	1,75 %	05.08.2020	837.821	0,04 %
BP Capital Markets plc	800.000	1,57 %	16.02.2027	831.251	0,04 %
BP Capital Markets plc	800.000	1,11 %	16.02.2023	825.343	0,04 %
Yorkshire Building Society	800.000	1,25 %	17.03.2022	823.142	0,04 %
Yorkshire Building Society	800.000	2,13 %	18.03.2019	820.940	0,04 %
Santander UK plc	800.000	0,88 %	25.11.2020	816.692	0,04 %
Lloyds Bank plc	800.000	0,63 %	14.09.2022	815.889	0,04 %
Lloyds Bank plc	800.000	0,50 %	11.04.2023	808.035	0,04 %
Nationwide Building Society	800.000	0,50 %	29.10.2019	807.280	0,04 %
BP Capital Markets plc	700.000	2,97 %	27.02.2026	805.031	0,04 %
Nationwide Building Society	800.000	0,13 %	25.01.2021	804.326	0,04 %
Vodafone Group plc	800.000	2,88 %	20.11.2037	803.675	0,04 %
Unilever NV	800.000	0,38 %	14.02.2023	798.440	0,04 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Barclays plc^	800.000	0,63 %	14.11.2023	792.288	0,04 %
HSBC Holdings plc	767.000	0,88 %	06.09.2024	769.021	0,04 %
Lloyds Banking Group plc	733.000	0,75 %	09.11.2021	744.685	0,04 %
Motability Operations Group plc	700.000	1,63 %	09.06.2023	741.178	0,04 %
Vodafone Group plc	700.000	1,75 %	25.08.2023	739.323	0,04 %
Barclays Bank plc	600.000	6,63 %	30.03.2022	736.186	0,04 %
Royal Bank of Scotland Group plc^	700.000	2,00 %	08.03.2023	735.329	0,04 %
Lloyds Bank plc	700.000	1,38 %	16.04.2021	731.508	0,04 %
FCE Bank plc	700.000	1,53 %	09.11.2020	727.055	0,04 %
Nationwide Building Society	700.000	1,13 %	03.06.2022	720.889	0,03 %
Annington Funding plc	700.000	1,65 %	12.07.2024	708.438	0,03 %
RELX Finance BV	700.000	0,38 %	22.03.2021	702.624	0,03 %
Vodafone Group plc	600.000	4,65 %	20.01.2022	702.300	0,03 %
British Telecommunications plc	700.000	1,50 %	23.06.2027	696.304	0,03 %
British Telecommunications plc	700.000	1,00 %	21.11.2024	694.585	0,03 %
Vodafone Group plc	700.000	0,50 %	30.01.2024	685.307	0,03 %
GlaxoSmithKline Capital plc	550.000	4,00 %	16.06.2025	675.549	0,03 %
BAT International Finance plc	600.000	2,75 %	25.03.2025	666.572	0,03 %
Mondi Finance plc	600.000	3,38 %	28.09.2020	650.747	0,03 %
Vodafone Group plc	600.000	1,88 %	11.09.2025	632.654	0,03 %
Babcock International Group plc	600.000	1,75 %	06.10.2022	625.454	0,03 %
FCE Bank plc	600.000	1,62 %	11.05.2023	623.134	0,03 %
Vodafone Group plc	600.000	1,00 %	11.09.2020	612.876	0,03 %
Nationwide Building Society	600.000	0,75 %	25.06.2019	609.675	0,03 %
Nationwide Building Society	600.000	0,38 %	30.07.2020	608.119	0,03 %
Experian Finance plc	600.000	1,38 %	25.06.2026	601.461	0,03 %
Heathrow Funding Ltd.	600.000	1,50 %	11.02.2030	598.988	0,03 %
Standard Chartered plc^	600.000	0,75 %	03.10.2023	598.385	0,03 %
WPP Finance Deutschland GmbH	600.000	1,63 %	23.03.2030	587.724	0,03 %
HBOS plc^	500.000	4,50 %	18.03.2030	586.894	0,03 %
Nationwide Building Society	500.000	6,75 %	22.07.2020	580.472	0,03 %
Nationwide Building Society	500.000	2,25 %	25.06.2029	563.386	0,03 %
BAT International Finance plc	500.000	3,63 %	09.11.2021	561.686	0,03 %
Diageo Finance plc	500.000	2,38 %	20.05.2026	556.171	0,03 %
Sky plc	500.000	2,50 %	15.09.2026	549.621	0,03 %
Royal Bank of Scotland Group plc	500.000	2,50 %	22.03.2023	539.378	0,03 %
WPP Finance SA	500.000	2,25 %	22.09.2026	537.551	0,03 %
Bank of Scotland plc	500.000	4,88 %	04.06.2019	537.029	0,03 %
Leeds Building Society	500.000	2,63 %	01.04.2021	533.918	0,03 %
Rolls-Royce plc	500.000	2,13 %	18.06.2021	532.313	0,03 %
Standard Chartered plc	470.000	3,63 %	23.11.2022	526.782	0,03 %
Hammerson plc	500.000	2,75 %	26.09.2019	523.378	0,03 %
Centrica plc^	500.000	3,00 %	10.04.2076	517.500	0,03 %
Global Switch Holdings Ltd.	500.000	2,25 %	31.05.2027	517.350	0,03 %
Leeds Building Society	500.000	1,38 %	05.05.2022	514.086	0,02 %
CNH Industrial Finance Europe SA	500.000	1,75 %	12.09.2025	513.550	0,02 %
Nationwide Building Society	500.000	0,75 %	26.10.2022	512.348	0,02 %
RELX Capital, Inc.	500.000	1,30 %	12.05.2025	510.841	0,02 %
Vodafone Group plc	500.000	0,88 %	17.11.2020	510.171	0,02 %
Coventry Building Society	500.000	0,63 %	03.11.2021	509.527	0,02 %
Channel Link Enterprises Finance plc^	500.000	1,76 %	30.06.2050	508.296	0,02 %
Yorkshire Building Society	500.000	0,50 %	19.06.2020	507.580	0,02 %
easyJet plc	500.000	1,13 %	18.10.2023	505.560	0,02 %
Anglo American Capital plc	500.000	1,63 %	18.09.2025	501.356	0,02 %
GlaxoSmithKline Capital plc	500.000	1,00 %	12.09.2026	501.046	0,02 %
Yorkshire Building Society	500.000	0,38 %	11.04.2023	500.389	0,02 %
Aptiv plc	500.000	1,60 %	15.09.2028	499.960	0,02 %
Leeds Building Society	500.000	0,50 %	03.07.2024	497.366	0,02 %
United Utilities Water Ltd.	450.000	4,25 %	24.01.2020	488.572	0,02 %
Vodafone Group plc	500.000	1,60 %	29.07.2031	470.982	0,02 %
Nationwide Building Society	400.000	4,63 %	08.02.2021	457.953	0,02 %
Aviva plc	445.000	0,63 %	27.10.2023	444.417	0,02 %
BAT International Finance plc	500.000	2,00 %	13.03.2045	442.439	0,02 %
BAT International Finance plc	400.000	4,00 %	07.07.2020	438.984	0,02 %
Aviva plc^	350.000	6,13 %	05.07.2043	434.678	0,02 %
Sky plc	400.000	2,25 %	17.11.2025	434.540	0,02 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
BP Capital Markets plc	400.000	2,52 %	17.02.2021	430.636	0,02 %
Coventry Building Society	400.000	2,50 %	18.11.2020	426.243	0,02 %
DS Smith plc	400.000	2,25 %	16.09.2022	425.332	0,02 %
Rentokil Initial plc	400.000	3,38 %	24.09.2019	422.960	0,02 %
Yorkshire Building Society	400.000	1,25 %	11.06.2021	416.332	0,02 %
Emirates NBD PJSC	400.000	1,75 %	23.03.2022	412.960	0,02 %
G4S International Finance plc	400.000	1,50 %	09.01.2023	409.680	0,02 %
FCE Bank plc	400.000	1,11 %	13.05.2020	409.424	0,02 %
RELX Capital, Inc.	400.000	1,30 %	12.05.2025	408.673	0,02 %
Nationwide Building Society	400.000	1,63 %	03.04.2019	408.615	0,02 %
BP Capital Markets plc	397.000	1,12 %	25.01.2024	408.088	0,02 %
G4S International Finance plc	400.000	1,50 %	02.06.2024	404.141	0,02 %
BAT International Finance plc	400.000	0,88 %	13.10.2023	401.856	0,02 %
British Telecommunications plc	400.000	1,00 %	23.06.2024	399.876	0,02 %
Diageo Finance plc	398.000	0,50 %	19.06.2024	392.388	0,02 %
SELP Finance Sarl	387.000	1,50 %	20.11.2025	385.442	0,02 %
London Stock Exchange Group plc	350.000	1,75 %	19.09.2029	357.314	0,02 %
Barclays Bank plc	300.000	4,00 %	12.01.2021	336.818	0,02 %
WPP Finance 2013	300.000	3,00 %	20.11.2023	336.562	0,02 %
HSBC Holdings plc	300.000	3,00 %	30.06.2025	333.418	0,02 %
BG Energy Capital plc	300.000	2,25 %	21.11.2029	330.053	0,02 %
Wellcome Trust Ltd.	325.000	1,13 %	21.01.2027	329.283	0,02 %
Standard Chartered plc	300.000	3,13 %	19.11.2024	329.197	0,02 %
National Grid plc	300.000	4,38 %	10.03.2020	328.657	0,02 %
Brambles Finance Ltd.	300.000	2,38 %	12.06.2024	327.995	0,02 %
Royal Mail plc	300.000	2,38 %	29.07.2024	325.068	0,02 %
Diageo Finance plc	300.000	1,75 %	23.09.2024	320.382	0,02 %
ELM BV for RELX Finance	300.000	2,50 %	24.09.2020	319.484	0,02 %
Nex Group Holdings plc	300.000	3,13 %	06.03.2019	309.840	0,02 %
BP Capital Markets plc	300.000	1,64 %	26.06.2029	309.506	0,01 %
Santander UK plc	300.000	1,13 %	14.01.2022	309.063	0,01 %
Heathrow Funding Ltd.	300.000	1,88 %	12.07.2032	307.585	0,01 %
FCE Bank plc	300.000	1,88 %	18.04.2019	307.324	0,01 %
FCE Bank plc	300.000	1,13 %	10.02.2022	306.595	0,01 %
British Telecommunications plc	300.000	1,13 %	10.03.2023	306.309	0,01 %
Imperial Brands Finance plc	300.000	1,38 %	27.01.2025	303.687	0,01 %
Unilever NV	300.000	0,50 %	03.02.2022	303.486	0,01 %
Unilever NV	300.000	0,00 %	29.04.2020	300.420	0,01 %
GlaxoSmithKline Capital plc	300.000	0,00 %	12.09.2020	299.472	0,01 %
Diageo Finance plc	300.000	0,00 %	17.11.2020	299.230	0,01 %
Unilever NV	300.000	0,50 %	29.04.2024	298.414	0,01 %
BAT International Finance plc	250.000	3,13 %	06.03.2029	283.247	0,01 %
Experian Finance plc	200.000	4,75 %	04.02.2020	219.431	0,01 %
BAT International Finance plc	200.000	2,38 %	19.01.2023	216.966	0,01 %
SSE plc	200.000	2,38 %	10.02.2022	216.534	0,01 %
BP Capital Markets plc	200.000	1,95 %	03.03.2025	215.325	0,01 %
ITV plc	200.000	2,13 %	21.09.2022	209.837	0,01 %
Standard Chartered plc	200.000	1,63 %	13.06.2021	208.701	0,01 %
Unilever NV	200.000	1,00 %	03.06.2023	206.110	0,01 %
BAT International Finance plc	200.000	1,00 %	23.05.2022	204.264	0,01 %
BAT Capital Corp.	200.000	1,13 %	16.11.2023	203.021	0,01 %
Unilever NV	200.000	1,00 %	14.02.2027	200.910	0,01 %
BAT International Finance plc	200.000	0,38 %	13.03.2019	200.796	0,01 %
Aptiv plc	178.000	1,50 %	10.03.2025	182.587	0,01 %
Rentokil Initial plc	150.000	3,25 %	07.10.2021	164.962	0,01 %
Hammerson plc	100.000	2,00 %	01.07.2022	105.481	0,01 %
AstraZeneca plc	100.000	0,88 %	24.11.2021	102.321	0,00 %
Mondi Finance plc	100.000	1,50 %	15.04.2024	101.988	0,00 %
Standard Chartered plc	12.000	4,13 %	18.01.2019	12.526	0,00 %
				150.303.560	7,24 %
USA 10,15 % (2016: 9,55 %)					
Wells Fargo & Co.	2.300.000	1,00 %	02.02.2027	2.259.635	0,11 %
AT&T, Inc.	2.171.000	1,45 %	01.06.2022	2.256.342	0,11 %
Berkshire Hathaway, Inc.	2.000.000	1,30 %	15.03.2024	2.068.402	0,10 %
Citigroup, Inc.	1.900.000	1,75 %	28.01.2025	1.995.638	0,10 %
Bank of America Corp.	1.900.000	1,38 %	10.09.2021	1.981.377	0,10 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Southern Power Co.	1.900.000	1,00 %	20.06.2022	1.932.044	0,09 %
Goldman Sachs Group, Inc.	1.900.000	1,25 %	01.05.2025	1.914.102	0,09 %
Apple, Inc.	1.800.000	1,00 %	10.11.2022	1.864.989	0,09 %
JPMorgan Chase & Co.	1.600.000	1,38 %	16.09.2021	1.666.872	0,08 %
Verizon Communications, Inc.	1.500.000	2,38 %	17.02.2022	1.621.800	0,08 %
JPMorgan Chase & Co.	1.500.000	1,50 %	29.10.2026	1.550.738	0,07 %
Goldman Sachs Group, Inc.	1.500.000	1,38 %	15.05.2024	1.531.191	0,07 %
Citigroup, Inc.	1.500.000	0,75 %	26.10.2023	1.502.426	0,07 %
General Electric Co.	1.500.000	1,50 %	17.05.2029	1.500.705	0,07 %
Goldman Sachs Group, Inc.	1.400.000	2,13 %	30.09.2024	1.496.410	0,07 %
Goldman Sachs Group, Inc.	1.437.000	1,63 %	27.07.2026	1.459.695	0,07 %
Coca-Cola Co.	1.344.000	1,88 %	22.09.2026	1.442.345	0,07 %
JPMorgan Chase & Co.^	1.400.000	1,64 %	18.05.2028	1.436.922	0,07 %
National Grid North America, Inc.	1.400.000	0,75 %	11.02.2022	1.421.041	0,07 %
Microsoft Corp.	1.300.000	2,13 %	06.12.2021	1.396.629	0,07 %
Microsoft Corp.	1.130.000	3,13 %	06.12.2028	1.370.298	0,07 %
AT&T, Inc.	1.300.000	3,15 %	04.09.2036	1.333.410	0,06 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	1.300.000	0,80 %	21.01.2022	1.322.980	0,06 %
International Business Machines Corp.	1.300.000	0,50 %	07.09.2021	1.315.246	0,06 %
Johnson & Johnson	1.300.000	0,65 %	20.05.2024	1.308.204	0,06 %
General Electric Co.	1.300.000	0,38 %	17.05.2022	1.298.181	0,06 %
AT&T, Inc.	1.255.000	1,30 %	05.09.2023	1.286.337	0,06 %
Amgen, Inc.	1.220.000	1,25 %	25.02.2022	1.261.451	0,06 %
Philip Morris International, Inc.	1.200.000	1,75 %	19.03.2020	1.242.948	0,06 %
Wells Fargo & Co.	1.125.000	2,13 %	04.06.2024	1.216.947	0,06 %
Verizon Communications, Inc.	1.200.000	2,88 %	15.01.2038	1.215.209	0,06 %
Bunge Finance Europe BV	1.160.000	1,85 %	16.06.2023	1.198.829	0,06 %
JPMorgan Chase & Co.	1.147.000	1,88 %	21.11.2019	1.190.299	0,06 %
General Electric Co.	1.200.000	2,13 %	17.05.2037	1.190.251	0,06 %
AT&T, Inc.	1.136.000	2,60 %	17.12.2029	1.185.461	0,06 %
Coca-Cola Co.	1.100.000	1,13 %	22.09.2022	1.143.324	0,06 %
Goldman Sachs Group, Inc.	1.100.000	1,38 %	26.07.2022	1.140.869	0,06 %
Morgan Stanley	1.000.000	5,38 %	10.08.2020	1.136.806	0,05 %
Coca-Cola Co.	1.100.000	0,75 %	09.03.2023	1.116.422	0,05 %
Procter & Gamble Co.	1.030.000	2,00 %	16.08.2022	1.110.249	0,05 %
JPMorgan Chase & Co.	1.000.000	2,75 %	24.08.2022	1.107.330	0,05 %
AT&T, Inc.	1.000.000	3,38 %	15.03.2034	1.091.660	0,05 %
AT&T, Inc.	1.000.000	2,65 %	17.12.2021	1.083.512	0,05 %
Honeywell International, Inc.	980.000	2,25 %	22.02.2028	1.082.239	0,05 %
AT&T, Inc.	1.000.000	2,40 %	15.03.2024	1.079.370	0,05 %
Procter & Gamble Co.	1.000.000	2,00 %	05.11.2021	1.071.680	0,05 %
Wells Fargo & Co.	970.000	2,63 %	16.08.2022	1.066.820	0,05 %
Goldman Sachs Group, Inc.	1.000.000	2,00 %	27.07.2023	1.061.992	0,05 %
JPMorgan Chase & Co.	952.000	2,75 %	01.02.2023	1.058.314	0,05 %
Wells Fargo & Co.	1.000.000	2,25 %	03.09.2020	1.057.738	0,05 %
JPMorgan Chase & Co.	1.000.000	1,50 %	26.10.2022	1.049.873	0,05 %
Wells Fargo & Co.	1.000.000	1,50 %	12.09.2022	1.047.096	0,05 %
Morgan Stanley	1.000.000	1,75 %	30.01.2025	1.044.516	0,05 %
Goldman Sachs Group, Inc.	950.000	5,13 %	23.10.2019	1.038.278	0,05 %
Bank of America Corp.	1.000.000	1,88 %	10.01.2019	1.020.490	0,05 %
Kraft Heinz Foods Co.	1.000.000	1,50 %	24.05.2024	1.018.473	0,05 %
Wells Fargo & Co.	1.000.000	1,38 %	26.10.2026	1.018.372	0,05 %
Procter & Gamble Co.	750.000	4,88 %	11.05.2027	1.012.405	0,05 %
Citigroup, Inc.	900.000	7,38 %	04.09.2019	1.012.228	0,05 %
AT&T, Inc.	1.000.000	2,35 %	04.09.2029	1.005.680	0,05 %
Celanese US Holdings LLC	1.000.000	1,13 %	26.09.2023	1.004.720	0,05 %
Morgan Stanley^	1.000.000	1,34 %	23.10.2026	998.720	0,05 %
US Bancorp	994.000	0,85 %	07.06.2024	998.593	0,05 %
John Deere Cash Management SA	1.000.000	0,50 %	15.09.2023	997.740	0,05 %
Morgan Stanley	962.000	1,00 %	02.12.2022	981.699	0,05 %
Morgan Stanley	974.000	1,38 %	27.10.2026	974.890	0,05 %
Mondelez International, Inc.	900.000	2,38 %	26.01.2021	958.291	0,05 %
DH Europe Finance SA	900.000	1,70 %	04.01.2022	950.839	0,05 %
Mohawk Industries, Inc.	900.000	2,00 %	14.01.2022	950.045	0,05 %
General Electric Co.	900.000	1,25 %	26.05.2023	929.637	0,05 %
Cargill, Inc.	900.000	1,88 %	04.09.2019	928.537	0,04 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Wells Fargo & Co.	900.000	1,13 %	29.10.2021	928.454	0,04 %
Priceline Group, Inc.	850.000	2,38 %	23.09.2024	918.591	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	800.000	3,25 %	17.02.2026	917.971	0,04 %
Berkshire Hathaway, Inc.	900.000	0,75 %	16.03.2023	910.400	0,04 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	700.000	4,63 %	22.02.2027	907.354	0,04 %
Molson Coors Brewing Co.	900.000	1,25 %	15.07.2024	906.711	0,04 %
Coca-Cola Co.	900.000	1,63 %	09.03.2035	905.841	0,04 %
Wal-Mart Stores, Inc.	650.000	4,88 %	21.09.2029	903.363	0,04 %
Pfizer, Inc.	900.000	0,25 %	06.03.2022	900.018	0,04 %
Ecolab, Inc.	890.000	1,00 %	15.01.2024	897.691	0,04 %
Morgan Stanley	850.000	1,75 %	11.03.2024	892.070	0,04 %
Bank of America Corp.	800.000	2,38 %	19.06.2024	876.913	0,04 %
Priceline Group, Inc.	858.000	1,80 %	03.03.2027	872.649	0,04 %
PepsiCo, Inc.	900.000	0,88 %	18.07.2028	871.298	0,04 %
Wal-Mart Stores, Inc.	800.000	1,90 %	08.04.2022	856.586	0,04 %
Morgan Stanley	800.000	2,38 %	31.03.2021	854.955	0,04 %
Bank of America Corp.^	800.000	1,78 %	04.05.2027	833.929	0,04 %
Citigroup, Inc.	800.000	1,38 %	27.10.2021	833.222	0,04 %
Eastman Chemical Co.	800.000	1,50 %	26.05.2023	832.400	0,04 %
Southern Power Co.	800.000	1,85 %	20.06.2026	831.546	0,04 %
AbbVie, Inc.	800.000	2,13 %	17.11.2028	829.214	0,04 %
Illinois Tool Works, Inc.	800.000	1,25 %	22.05.2023	829.155	0,04 %
Apple, Inc.	800.000	1,38 %	24.05.2029	817.795	0,04 %
International Business Machines Corp.	800.000	1,50 %	23.05.2029	817.594	0,04 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	500.000	6,03 %	01.03.2038	812.516	0,04 %
Apple, Inc.	800.000	0,88 %	24.05.2025	812.358	0,04 %
Morgan Stanley	773.000	1,88 %	27.04.2027	800.128	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.	750.000	2,63 %	19.08.2020	798.858	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	800.000	1,38 %	27.10.2026	794.928	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	800.000	0,88 %	02.04.2025	785.550	0,04 %
American Express Credit Corp.	745.000	0,63 %	22.11.2021	754.690	0,04 %
Eli Lilly & Co.	700.000	2,13 %	03.06.2030	751.077	0,04 %
General Motors Financial Co., Inc.	750.000	0,96 %	07.09.2023	748.140	0,04 %
Bank of America Corp.	700.000	2,50 %	27.07.2020	743.254	0,04 %
General Electric Co.	700.000	1,88 %	28.05.2027	739.182	0,04 %
Baxter International, Inc.	726.000	1,30 %	30.05.2025	734.494	0,04 %
Prologis LP	700.000	1,38 %	13.05.2021	724.912	0,04 %
American International Group, Inc.	700.000	1,50 %	08.06.2023	723.590	0,04 %
International Business Machines Corp.	700.000	1,38 %	19.11.2019	719.875	0,03 %
WPC Eurobond BV	687.000	2,25 %	19.07.2024	718.059	0,03 %
General Electric Co.	550.000	4,13 %	19.09.2035	717.160	0,03 %
3M Co.	700.000	1,50 %	02.06.2031	716.556	0,03 %
Kraft Heinz Foods Co.	700.000	2,25 %	25.05.2028	716.514	0,03 %
FedEx Corp.	700.000	1,63 %	11.01.2027	713.161	0,03 %
Nestle Holdings, Inc.	700.000	0,88 %	18.07.2025	707.641	0,03 %
International Business Machines Corp.	700.000	0,95 %	23.05.2025	705.933	0,03 %
3M Co.	700.000	0,38 %	15.02.2022	704.718	0,03 %
Johnson & Johnson	700.000	0,25 %	20.01.2022	703.424	0,03 %
Berkshire Hathaway, Inc.	650.000	2,15 %	15.03.2028	702.881	0,03 %
Wells Fargo & Co.	650.000	2,00 %	27.04.2026	695.421	0,03 %
United Parcel Service, Inc.	700.000	0,38 %	15.11.2023	691.761	0,03 %
Prologis LP	600.000	3,38 %	20.02.2024	685.193	0,03 %
Apple, Inc.	624.000	2,00 %	17.09.2027	682.718	0,03 %
Berkshire Hathaway, Inc.	670.000	1,13 %	16.03.2027	665.494	0,03 %
Fidelity International Ltd.	621.000	2,50 %	04.11.2026	653.803	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	600.000	2,63 %	23.04.2021	648.589	0,03 %
Blackstone Holdings Finance Co. LLC	655.000	1,00 %	05.10.2026	647.044	0,03 %
Digital Euro Finco LLC	600.000	2,63 %	15.04.2024	643.241	0,03 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	600.000	6,00 %	15.01.2019	638.239	0,03 %
Morgan Stanley	600.000	1,88 %	30.03.2023	636.197	0,03 %
International Business Machines Corp.	600.000	1,75 %	07.03.2028	633.726	0,03 %
Bank of America Corp.	600.000	1,63 %	14.09.2022	631.806	0,03 %
International Business Machines Corp.	600.000	1,88 %	06.11.2020	630.750	0,03 %
Wells Fargo & Co.	600.000	1,63 %	02.06.2025	627.865	0,03 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	651.000	1,38 %	12.09.2028	627.827	0,03 %
Carnival Corp.	600.000	1,63 %	22.02.2021	626.621	0,03 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Mastercard, Inc.	570.000	2,10 %	01.12.2027	620.369	0,03 %
United Technologies Corp.	600.000	1,13 %	15.12.2021	619.342	0,03 %
Merck & Co., Inc.	572.000	1,88 %	15.10.2026	617.481	0,03 %
American International Group, Inc.	600.000	1,88 %	21.06.2027	612.791	0,03 %
Metropolitan Life Global Funding I	600.000	0,88 %	20.01.2022	612.126	0,03 %
Carnival Corp.	600.000	1,13 %	06.11.2019	611.703	0,03 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	550.000	2,63 %	15.03.2023	609.290	0,03 %
McKesson Corp.	600.000	1,50 %	17.11.2025	609.226	0,03 %
McDonald's Corp.	600.000	1,00 %	15.11.2023	609.128	0,03 %
DH Europe Finance SA	600.000	1,00 %	08.07.2019	607.998	0,03 %
Johnson Controls International plc	600.000	1,00 %	15.09.2023	605.768	0,03 %
Pfizer, Inc.	600.000	1,00 %	06.03.2027	604.829	0,03 %
BlackRock, Inc.	585.000	1,25 %	06.05.2025	601.585	0,03 %
General Electric Co.	600.000	0,88 %	17.05.2025	597.796	0,03 %
Coca-Cola Co.	600.000	0,50 %	08.03.2024	595.320	0,03 %
Mylan NV	572.000	2,25 %	22.11.2024	594.885	0,03 %
Citigroup, Inc.	550.000	5,00 %	02.08.2019	594.329	0,03 %
Philip Morris International, Inc.	500.000	3,13 %	03.06.2033	593.468	0,03 %
McDonald's Corp.	600.000	1,50 %	28.11.2029	591.680	0,03 %
Becton Dickinson & Co.	583.000	1,00 %	15.12.2022	585.877	0,03 %
Trinity Acquisition plc	553.000	2,13 %	26.05.2022	585.795	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	500.000	2,88 %	24.05.2028	575.704	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	500.000	3,00 %	19.02.2026	574.987	0,03 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	555.000	2,13 %	20.11.2026	572.920	0,03 %
Philip Morris International, Inc.	500.000	2,88 %	30.05.2024	563.600	0,03 %
Philip Morris International, Inc.	500.000	2,75 %	19.03.2025	560.642	0,03 %
Nasdaq, Inc.	500.000	3,88 %	07.06.2021	559.049	0,03 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	500.000	5,38 %	23.01.2020	555.623	0,03 %
McDonald's Corp.	500.000	2,63 %	11.06.2029	553.695	0,03 %
Cargill, Inc.	500.000	2,50 %	15.02.2023	550.194	0,03 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	548.000	1,40 %	23.01.2026	548.985	0,03 %
Citigroup, Inc.	500.000	2,38 %	22.05.2024	547.657	0,03 %
Coca-Cola European Partners US LLC	500.000	2,38 %	07.05.2025	547.269	0,03 %
Wells Fargo & Co.	500.000	2,25 %	02.05.2023	543.438	0,03 %
Fluor Corp.	520.000	1,75 %	21.03.2023	537.658	0,03 %
Illinois Tool Works, Inc.	500.000	2,13 %	22.05.2030	535.684	0,03 %
Praxair, Inc.	500.000	1,63 %	01.12.2025	530.858	0,03 %
Verizon Communications, Inc.	500.000	2,63 %	01.12.2031	529.640	0,03 %
BorgWarner, Inc.	500.000	1,80 %	07.11.2022	529.228	0,03 %
Simon Property Group LP	500.000	2,38 %	02.10.2020	528.856	0,03 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	500.000	2,00 %	15.04.2025	528.191	0,03 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	500.000	2,25 %	20.07.2020	527.694	0,03 %
Apple, Inc.	500.000	1,38 %	17.01.2024	525.158	0,03 %
International Flavors & Fragrances, Inc.	500.000	1,75 %	14.03.2024	524.811	0,03 %
PepsiCo, Inc.	500.000	1,75 %	28.04.2021	524.745	0,03 %
LYB International Finance II BV	500.000	1,88 %	02.03.2022	524.398	0,03 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	500.000	2,88 %	18.06.2019	521.930	0,03 %
Simon International Finance SCA	500.000	1,38 %	18.11.2022	520.286	0,03 %
Johnson & Johnson	500.000	1,65 %	20.05.2035	516.904	0,03 %
McDonald's Corp.	500.000	1,13 %	26.05.2022	514.829	0,03 %
International Business Machines Corp.	500.000	1,13 %	06.09.2024	514.146	0,02 %
Bank of America Corp.^	500.000	1,38 %	07.02.2025	514.079	0,02 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	500.000	1,41 %	13.12.2022	511.530	0,02 %
AbbVie, Inc.	500.000	1,38 %	17.05.2024	510.483	0,02 %
Philip Morris International, Inc.	500.000	2,00 %	09.05.2036	507.585	0,02 %
Bank of America Corp.^	500.000	0,74 %	07.02.2022	507.578	0,02 %
Merck & Co., Inc.	440.000	2,50 %	15.10.2034	505.976	0,02 %
McDonald's Corp.	500.000	0,50 %	15.01.2021	504.008	0,02 %
AT&T, Inc.	500.000	1,05 %	04.09.2023	503.845	0,02 %
McKesson Corp.	500.000	0,63 %	17.08.2021	503.711	0,02 %
Kellogg Co.	500.000	1,25 %	10.03.2025	503.285	0,02 %
AbbVie, Inc.	500.000	0,38 %	18.11.2019	503.009	0,02 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	500.000	1,95 %	24.07.2029	502.035	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	500.000	0,50 %	02.06.2022	500.647	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	450.000	3,88 %	23.09.2020	496.837	0,02 %
Honeywell International, Inc.	490.000	0,65 %	21.02.2020	496.251	0,02 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
McDonald's Corp.	500.000	0,63 %	29.01.2024	496.136	0,02 %
PPG Industries, Inc.	500.000	0,88 %	03.11.2025	495.670	0,02 %
Metropolitan Life Global Funding I	450.000	2,38 %	11.01.2023	491.047	0,02 %
Mastercard, Inc.	470.000	1,10 %	01.12.2022	484.497	0,02 %
Carnival Corp.	450.000	1,88 %	07.11.2022	478.416	0,02 %
Microsoft Corp.	400.000	2,63 %	02.05.2033	469.345	0,02 %
Oracle Corp.	400.000	3,13 %	10.07.2025	467.258	0,02 %
International Business Machines Corp.	400.000	2,88 %	07.11.2025	459.738	0,02 %
Priceline Group, Inc.	451.000	0,80 %	10.03.2022	456.454	0,02 %
Merck & Co., Inc.	460.000	0,50 %	02.11.2024	455.476	0,02 %
Prologis LP	400.000	3,00 %	02.06.2026	451.477	0,02 %
AT&T, Inc.	400.000	3,55 %	17.12.2032	448.594	0,02 %
Mylan NV	435.000	1,25 %	23.11.2020	445.057	0,02 %
Mylan NV	421.000	3,13 %	22.11.2028	443.334	0,02 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	436.000	2,88 %	24.07.2037	442.260	0,02 %
Coca-Cola European Partners US LLC	400.000	2,63 %	06.11.2023	441.950	0,02 %
Fidelity National Information Services, Inc.	436.000	1,10 %	15.07.2024	432.808	0,02 %
Mondelez International, Inc.	420.000	1,00 %	07.03.2022	429.679	0,02 %
Oracle Corp.	400.000	2,25 %	10.01.2021	426.188	0,02 %
ManpowerGroup, Inc.	400.000	1,88 %	11.09.2022	424.588	0,02 %
Eli Lilly & Co.	400.000	1,63 %	02.06.2026	421.436	0,02 %
Metropolitan Life Global Funding I	400.000	1,25 %	17.09.2021	414.204	0,02 %
McDonald's Corp.	400.000	1,75 %	03.05.2028	413.736	0,02 %
Johnson & Johnson	400.000	1,15 %	20.11.2028	404.943	0,02 %
Parker-Hannifin Corp	400.000	1,13 %	01.03.2025	404.760	0,02 %
Tyco Electronics Group SA	396.000	1,10 %	01.03.2023	404.742	0,02 %
AT&T, Inc.	400.000	1,80 %	04.09.2026	403.956	0,02 %
FedEx Corp.	400.000	0,50 %	09.04.2020	403.274	0,02 %
Bank of America Corp.	400.000	0,75 %	26.07.2023	401.536	0,02 %
Allergan Funding SCS	400.000	2,13 %	01.06.2029	401.028	0,02 %
Allergan Funding SCS	400.000	0,50 %	01.06.2021	400.282	0,02 %
VF Corp.	400.000	0,63 %	20.09.2023	400.175	0,02 %
Bristol-Myers Squibb Co.	400.000	1,75 %	15.05.2035	399.961	0,02 %
American Tower Corp.	400.000	1,38 %	04.04.2025	399.582	0,02 %
Coca-Cola Co.	400.000	0,00 %	09.03.2021	398.948	0,02 %
Dover Corp.	400.000	1,25 %	09.11.2026	397.250	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	350.000	3,25 %	01.02.2023	393.089	0,02 %
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl	400.000	1,10 %	09.11.2027	390.894	0,02 %
Philip Morris International, Inc.	400.000	1,88 %	06.11.2037	387.806	0,02 %
Berkshire Hathaway, Inc.	400.000	1,63 %	16.03.2035	386.600	0,02 %
Bristol-Myers Squibb Co.	375.000	1,00 %	15.05.2025	379.102	0,02 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	379.000	1,45 %	16.03.2027	376.532	0,02 %
Prologis LP	347.000	1,38 %	07.10.2020	357.696	0,02 %
Merck & Co., Inc.	340.000	1,13 %	15.10.2021	351.636	0,02 %
AT&T, Inc.	300.000	3,50 %	17.12.2025	346.970	0,02 %
Apple, Inc.	308.000	1,63 %	10.11.2026	326.997	0,02 %
Xylem, Inc.	300.000	2,25 %	11.03.2023	320.293	0,02 %
Discovery Communications LLC	300.000	2,38 %	07.03.2022	320.160	0,02 %
United Parcel Service, Inc.	300.000	1,63 %	15.11.2025	317.567	0,02 %
Kraft Heinz Foods Co.	300.000	2,00 %	30.06.2023	316.702	0,02 %
Harman Finance International SCA	300.000	2,00 %	27.05.2022	316.576	0,02 %
Philip Morris International, Inc.	300.000	1,88 %	03.03.2021	315.337	0,02 %
McDonald's Corp.	300.000	1,88 %	26.05.2027	314.831	0,02 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	300.000	2,43 %	13.12.2026	313.621	0,02 %
Amgen, Inc.	300.000	2,13 %	13.09.2019	311.139	0,02 %
United Technologies Corp.	300.000	1,25 %	22.05.2023	310.940	0,02 %
Liberty Mutual Finance Europe DAC	300.000	1,75 %	27.03.2024	310.151	0,02 %
Praxair, Inc.	300.000	1,50 %	11.03.2020	309.318	0,02 %
Caterpillar International Finance DAC	300.000	0,75 %	13.10.2020	306.043	0,01 %
PerkinElmer, Inc.	300.000	1,88 %	19.07.2026	305.630	0,01 %
PPG Industries, Inc.	300.000	0,88 %	13.03.2022	305.560	0,01 %
General Mills, Inc.	300.000	1,00 %	27.04.2023	305.476	0,01 %
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl	300.000	1,25 %	02.11.2026	304.400	0,01 %
Whirlpool Corp.	300.000	0,63 %	12.03.2020	303.375	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	300.000	0,75 %	10.05.2019	303.258	0,01 %
National Grid North America, Inc.	300.000	1,00 %	12.07.2024	302.111	0,01 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Procter & Gamble Co.	300.000	0,50 %	25.10.2024	297.705	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	300.000	1,38 %	02.11.2028	289.455	0,01 %
Merck & Co., Inc.	300.000	1,38 %	02.11.2036	289.277	0,01 %
Prologis International Funding II SA	275.000	1,88 %	17.04.2025	286.685	0,01 %
Becton Dickinson & Co.	282.000	1,90 %	15.12.2026	284.283	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	250.000	2,50 %	18.10.2021	269.968	0,01 %
Eaton Capital Unlimited Co.	259.000	0,75 %	20.09.2024	254.984	0,01 %
United Technologies Corp.	230.000	1,88 %	22.02.2026	243.923	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	200.000	2,55 %	08.04.2026	227.792	0,01 %
Aon plc	200.000	2,88 %	14.05.2026	222.100	0,01 %
Brown-Forman Corp.	220.000	1,20 %	07.07.2026	221.263	0,01 %
McDonald's Corp.	200.000	2,38 %	27.11.2024	219.352	0,01 %
Prologis International Funding II SA	200.000	2,88 %	04.04.2022	219.000	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	220.000	0,75 %	12.09.2024	214.951	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	200.000	2,15 %	21.07.2022	213.786	0,01 %
Dover Corp.	200.000	2,13 %	01.12.2020	210.989	0,01 %
3M Co.	200.000	1,50 %	09.11.2026	209.300	0,01 %
Honeywell International, Inc.	200.000	1,30 %	22.02.2023	207.686	0,01 %
Coca-Cola European Partners US LLC	200.000	1,88 %	18.03.2030	207.102	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	200.000	1,50 %	01.12.2020	207.011	0,01 %
Eli Lilly & Co.	200.000	1,00 %	02.06.2022	205.951	0,01 %
General Motors Financial International BV	200.000	1,17 %	18.05.2020	204.700	0,01 %
Coca-Cola Co.	200.000	1,13 %	09.03.2027	201.917	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	200.000	1,88 %	26.10.2029	199.090	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	200.000	1,50 %	15.11.2032	197.027	0,01 %
Albemarle Corp.	164.000	1,88 %	08.12.2021	172.298	0,01 %
Air Products & Chemicals, Inc.	167.000	1,00 %	12.02.2025	169.764	0,01 %
Johnson & Johnson	150.000	4,75 %	06.11.2019	163.681	0,01 %
Amgen, Inc.	150.000	2,00 %	25.02.2026	160.908	0,01 %
Merck & Co., Inc.	150.000	1,13 %	15.10.2021	155.134	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	130.000	2,38 %	30.09.2019	135.683	0,01 %
Time Warner, Inc.	100.000	1,95 %	15.09.2023	105.476	0,01 %
General Mills, Inc.	100.000	2,10 %	16.11.2020	105.153	0,01 %
AT&T, Inc.	100.000	1,88 %	04.12.2020	104.677	0,01 %
FedEx Corp.	100.000	1,00 %	11.01.2023	101.739	0,01 %
Kellogg Co.	100.000	1,00 %	17.05.2024	100.006	0,01 %
Discovery Communications LLC	100.000	1,90 %	19.03.2027	99.346	0,00 %
Mondelez International, Inc.	100.000	2,38 %	06.03.2035	97.952	0,00 %
Coca-Cola Co.	70.000	1,10 %	02.09.2036	63.405	0,00 %
Mondelez International, Inc.	30.000	1,63 %	08.03.2027	30.386	0,00 %
				210.677.339	10,15 %
Summe Anleihen				2.030.164.196	97,85 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				2.030.164.196	97,85 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures (0,00 %) (2016: (0,01 %))				
Euro-Bund Futures März 2018	71	11.480.940	(1.660)	(0,00 %)
			(1.660)	(0,00 %)

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf- betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte zu Absicherungszwecken auf Ebene der Anteilsklasse (0,06 %) (2016: (0,02 %))							
EUR	1.210.000	GBP	(1.066.790)	BNP Paribas	03.01.2018	8.217	0,00 %
GBP	2.194.126	EUR	(2.470.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	1.772	0,00 %
EUR	168.090.018	GBP	(149.208.467)	JPMorgan Chase Bank	03.01.2018	568	0,00 %
GBP	124.513	EUR	(140.000)	UBS	02.02.2018	151	0,00 %
GBP	630.278	EUR	(710.000)	BNP Paribas	03.01.2018	34	0,00 %
GBP	1.023.202	EUR	(1.152.678)	Brown Brothers Harriman	03.01.2018	—	0,00 %
EUR	1.670.000	GBP	(1.483.686)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(28)	(0,00 %)
GBP	88.033	EUR	(100.000)	JPMorgan Chase Bank	03.01.2018	(827)	(0,00 %)
GBP	132.255	EUR	(150.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(1.010)	(0,00 %)
GBP	307.978	EUR	(350.000)	JPMorgan Chase Bank	03.01.2018	(3.050)	(0,00 %)
GBP	485.067	EUR	(550.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(3.552)	(0,00 %)
GBP	800.170	EUR	(910.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(8.575)	(0,00 %)
GBP	149.287.301	EUR	(168.090.018)	JPMorgan Chase Bank	02.02.2018	(53.166)	(0,00 %)
GBP	144.614.149	EUR	(164.060.018)	JPMorgan Chase Bank	03.01.2018	(1.146.256)	(0,06 %)
						(1.205.722)	(0,06 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente						(1.207.382)	(0,06 %)
						Marktwert	% des Gesamt-
						Euro (€)	nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva						45.764.020	2,21 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)						2.074.720.834	100,00 %
Analyse des Gesamtvermögens							% des Gesamt-
						Euro (€)	nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind						1.770.694.890	85,34 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						259.469.306	12,51 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente						(1.207.382)	(0,06 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva						45.764.020	2,21 %
Gesamt Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)						2.074.720.834	100,00 %

^ Zinsvariable Anleihe (FRN). Der Effektivzins zum 31. Dezember 2017.

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Kapital Euro (€)	Kosten Euro (€)		Kapital Euro (€)	Erlöse Euro (€)
Käufe			Verkäufe		
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,50 % 15.8.2046	19.500.000	25.719.950	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,00 % 15.8.2026	24.869.947	24.241.815
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,00 % 15.8.2026	15.300.000	14.787.457	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,50 % 15.8.2046	17.770.000	23.375.993
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,50 % 15.8.2027	11.000.000	11.140.940	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,75 % 4.7.2034	8.000.000	13.180.905
Bundesobligation 0,00 % 8.10.2021	9.000.000	9.191.520	Bundesobligation 0,00 % 8.10.2021	11.000.000	11.276.618
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,75 % 4.7.2034	4.200.000	6.961.902	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,50 % 15.8.2027	11.000.000	11.150.090
European Investment Bank 0,00 % 15.03.2024	5.000.000	4.879.250	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,00 % 15.8.2023	8.250.000	9.473.966
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,00 % 29.3.2021	4.200.000	4.234.114	European Investment Bank 4,13 % 15.04.2024	5.250.000	6.683.495
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 3,38 % 3.4.2037	3.000.000	4.114.500	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,88 % 16.4.2018	5.600.000	5.673.080
Romanian Government International Bond 2,38 % 19.4.2027	3.500.000	3.539.743	Europäischer Stabilitätsmechanismus 0,05 % 17.12.2018	5.300.000	5.333.714
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,25 % 24.5.2033	3.100.000	3.074.242	Europäischer Stabilitätsmechanismus 1,25 % 15.10.2018	4.900.000	5.001.294
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,13 % 17.10.2023	3.000.000	3.003.870	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,25 % 31.7.2018	4.250.000	4.322.845
Europäischer Stabilitätsmechanismus 1,80 % 2.11.2046	2.700.000	2.795.008	European Investment Bank 0,13 % 15.06.2020	3.900.000	3.963.464
Hungary Government International Bond 6,00 % 11.1.2019	2.400.000	2.674.350	Europäische Union 3,25 % 04.04.2018	3.700.000	3.829.796
Bank of Montreal 0,20 % 26.1.2023	2.500.000	2.500.850	Bundesobligation 0,25 % 11.10.2019	3.700.000	3.804.266
Europäische Union 0,63 % 04.11.2023	2.400.000	2.487.912	European Investment Bank 1,00 % 13.07.2018	3.500.000	3.554.525
Credit Mutuel Arkea SA 3,50 % 9.2.2029	2.400.000	2.390.520	European Investment Bank 2,50 % 15.10.2018	3.389.000	3.500.739
European Investment Bank 0,50 % 15.01.2027	2.300.000	2.277.494	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,25 % 5.2.2018	3.000.000	3.049.590
Anglo American Capital plc 3,50 % 28.3.2022	2.000.000	2.246.000	OP Mortgage Bank 0,63 % 4.9.2022	2.700.000	2.770.464
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,70 % 13.2.2043	2.200.000	2.217.502	Deutsche Pfandbriefbank AG 4,50 % 15.1.2018	2.500.000	2.611.900
Daimler International Finance BV 0,00 % 15.3.2019	2.100.000	2.102.478	Credit Mutuel Arkea SA 3,50 % 9.2.2029	2.400.000	2.538.950

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	Euro (€) Zum 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.030.164.196	2.218.733.000
Derivative Finanzinstrumente	10.742	16.620
Barmittel und liquide Vermögenswerte	10.332.599	13.460.101
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	21.784.056	25.817.143
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	16.757.065	9.563.409
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	1.956.815	2.322.174
Bareinschüsse für Futures	—	126.136
Sonstige Forderungen	1.300	—
Summe Umlaufvermögen	2.081.006.773	2.270.038.583
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	1.218.124	651.405
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	166	3.049
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	4.098.303	83.765
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	513.597	4.742.392
An Broker zu zahlende Bareinschüsse	14.075	—
Zahlbare Verwaltungsgebühren	441.674	462.910
Summe kurzfristige Passiva	6.285.939	5.943.521
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken) („Nettovermögen“)	2.074.720.834	2.264.095.062

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Nettovermögen	1.751.905.570	2.012.890.675	1.555.804.324
Anzahl der umlaufenden Anteile	8.111.563	9.461.823	7.576.639
Nettoinventarwert je Anteil	215,98	212,74	205,34
EUR-Anlegeranteile (€)			
Nettovermögen	52.986.434	44.721.408	59.825.010
Anzahl der umlaufenden Anteile	262.273	224.620	311.146
Nettoinventarwert je Anteil	202,03	199,10	192,27
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Nettovermögen	103.447.267	104.287.813	136.030.531
Anzahl der umlaufenden Anteile	907.419	929.646	1.257.531
Nettoinventarwert je Anteil	114,00	112,18	108,17
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in Euro (€)	166.381.563	102.195.166	74.707.139
Nettovermögen	147.692.471	87.233.730	55.060.972
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.286.171	776.563	512.654
Nettoinventarwert je Anteil	114,83	112,33	107,40

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	33.661.437	36.689.371
Verschiedene Erträge	31.415	126.374
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	(1.165.257)	24.620.393
Summe Anlageerträge/(-verluste)	32.527.595	61.436.138
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5.365.001	5.010.633
Transaktionsgebühren und Provisionen	2.907	5.870
Sonstige Aufwendungen	14	499
Summe Aufwendungen	5.367.922	5.017.002
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	86.933	42.788
Summe Finanzierungskosten	86.933	42.788
Nettoanlageerträge/(-verluste)	27.072.740	56.376.348
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	27.072.740	56.376.348

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	27.072.740	56.376.348
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	452.183.072	699.710.306
Rücknahmen	(668.630.040)	(318.358.596)
Summe Kapitalgeschäfte	(216.446.968)	381.351.710
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	(189.374.228)	437.728.058
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	2.264.095.062	1.826.367.004
Zum Jahresende	2.074.720.834	2.264.095.062

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Asset Management, Limited.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds strebt eine Rendite an, die der Wertentwicklung des Bloomberg Barclays Global Inflation-Linked: Eurozone – Euro CPI Index entspricht, eines marktgewichteten Index für auf Euro lautende inflationsgeschützte Staatsanleihen der Eurozone mit Laufzeiten von mehr als einem Jahr, der als Absicherung gegen die Inflation im Euroraum dienen soll.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	31	29
Rendite auf Endfälligkeit	-0,6 % ³	-0,6 %
Durchschnittlicher Kupon	1,6 %	1,5 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	9,2 Jahre	9,2 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	A1	A1
Durchschnittliche Duration	8,4 Jahre	8,4 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,20 %	
Anlegeranteile	0,25 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %	
Kurzfristige Reserven	0,6 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
R ²	1,00	1,00
Beta	1,00	1,00

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Frankreich	37,0 %	37,0 %
Italien	35,9	35,9
Deutschland	16,5	16,5
Spanien	10,5	10,6
Sonstige	0,1	0,0

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

Treasury-Titel	100,0 %
----------------	---------

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	16,5 %
Aa	37,0
Baa	46,4
nicht eingestuft	0,1

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	33,3 %
5-10 Jahre	35,3
Mehr als 10 Jahre	31,4

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit Kurz Mittel Lang

Kreditqualität	Staat-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität				
Ohne Anlagequalität				

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays Global Inflation-Linked: Eurozone – Euro CPI Index.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

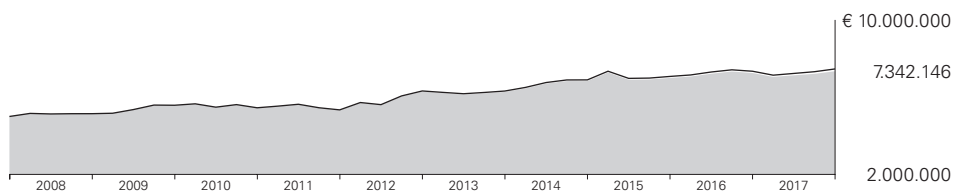
Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays Global Inflation-Linked: Eurozone – Euro CPI Index

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



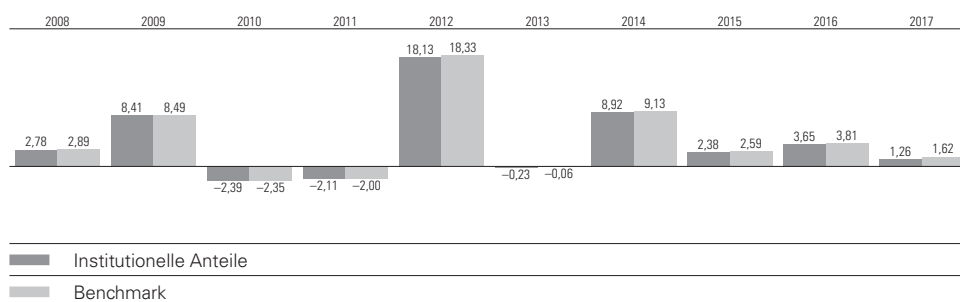
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Institutionelle Anteile	1,26 %	3,15 %	3,92 %	€ 7.342.146
Benchmark	1,62	3,37	4,08	7.461.596

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Anlegeranteile	1,21 %	3,09 %	4,00 %	€ 140.910
Benchmark	1,62	3,37	4,25	143.871

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile	1,36 %	3,68 %	4,00 %	€ 229.820.000
Benchmark	1,62	3,82	4,25	230.953.805

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,36 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,41 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,26 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



¹ Für Anlegeranteile, 7. April 2009; für Institutionelle Plus-Anteile, 27. Februar 2014.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 99,42 % (2016: 99,44 %)					
Frankreich 36,83 % (2016: 37,03 %)					
French Republic Government Bond OAT	99.700.906	2,25 %	25.07.2020	110.176.281	6,50 %
French Republic Government Bond OAT	74.029.166	1,85 %	25.07.2027	93.916.361	5,54 %
French Republic Government Bond OAT	78.763.060	1,10 %	25.07.2022	88.450.917	5,22 %
French Republic Government Bond OAT	52.735.978	3,15 %	25.07.2032	82.145.989	4,85 %
French Republic Government Bond OAT	53.139.673	1,80 %	25.07.2040	78.682.851	4,64 %
French Republic Government Bond OAT	59.502.356	0,25 %	25.07.2024	65.494.243	3,87 %
French Republic Government Bond OAT	41.323.220	0,70 %	25.07.2030	48.162.461	2,84 %
French Republic Government Bond OAT	27.480.307	0,10 %	25.07.2047	29.033.219	1,71 %
French Republic Government Bond OAT	26.717.974	0,10 %	01.03.2021	28.164.485	1,66 %
				624.226.807	36,83 %
Deutschland 16,38 % (2016: 19,13 %)					
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond	69.558.277	1,75 %	15.04.2020	74.661.490	4,40 %
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond	68.260.954	0,10 %	15.04.2023	73.489.880	4,34 %
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond	48.128.175	0,10 %	15.04.2026	53.073.778	3,13 %
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond	38.664.428	0,50 %	15.04.2030	44.842.810	2,65 %
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond	26.882.322	0,10 %	15.04.2046	31.596.837	1,86 %
				277.664.795	16,38 %
Italien 35,70 % (2016: 35,89 %)					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	79.707.637	2,60 %	15.09.2023	92.118.116	5,43 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	77.465.317	2,10 %	15.09.2021	85.858.684	5,07 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	76.235.818	2,35 %	15.09.2019	81.096.613	4,78 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	63.268.472	2,35 %	15.09.2035	75.137.637	4,43 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	54.097.663	3,10 %	15.09.2026	65.689.061	3,88 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	54.364.562	2,35 %	15.09.2024	62.159.244	3,67 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	38.021.693	2,55 %	15.09.2041	45.259.502	2,67 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	36.320.776	1,25 %	15.09.2032	36.981.088	2,18 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	31.296.662	0,10 %	15.05.2022	32.024.372	1,89 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	27.680.305	1,30 %	15.05.2028	28.848.968	1,70 %
				605.173.285	35,70 %
Spanien 10,51 % (2016: 7,39 %)					
Spain Government Inflation Linked Bond	53.868.144	1,80 %	30.11.2024	62.147.354	3,67 %
Spain Government Inflation Linked Bond	37.610.724	0,55 %	30.11.2019	39.082.732	2,30 %
Spain Government Inflation Linked Bond	27.144.219	1,00 %	30.11.2030	28.780.527	1,70 %
Spain Government Inflation Linked Bond	26.505.696	0,65 %	30.11.2027	27.666.699	1,63 %
Spain Government Inflation Linked Bond	19.338.042	0,30 %	30.11.2021	20.441.857	1,21 %
				178.119.169	10,51 %
Summe Anleihen				1.685.184.056	99,42 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				1.685.184.056	99,42 %
Sonstige Aktiva und Passiva				9.901.093	0,58 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)				1.695.085.149	100,00 %
Analyse des Gesamtvermögens					
				Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind				512.981.668	30,27 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere				1.172.202.388	69,15 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente				—	0,00 %
(e) Sonstige Aktiva und Passiva				9.901.093	0,58 %
Gesamtvermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)				1.695.085.149	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Kapital Euro (€)	Kosten Euro (€)		Kapital Euro (€)	Erlöse Euro (€)
Käufe			Verkäufe		
French Republic Government Bond OAT 1,85 % 25.7.2027	25.530.544	31.870.850	Bundesrepublik Deutschland Bundesobligation Inflation Linked Bond 0,75 % 15.4.2018	59.727.848	60.834.696
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,30 % 15.5.2028	28.768.070	29.172.842	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,70 % 15.9.2018	43.309.387	44.773.507
Spain Government Inflation Linked Bond 0,65 % 30.11.2027	26.845.308	27.185.923	French Republic Government Bond OAT 0,25 % 25.7.2018	42.632.273	43.429.076
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,10 % 15.4.2026	19.872.949	21.928.045	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,60 % 15.9.2023	11.989.466	13.895.203
French Republic Government Bond OAT 2,25 % 25.7.2020	18.229.591	20.460.486	French Republic Government Bond OAT 2,25 % 25.7.2020	11.088.570	12.530.232
French Republic Government Bond OAT 0,25 % 25.7.2024	17.919.881	19.563.900	French Republic Government Bond OAT 1,80 % 25.7.2040	6.461.500	9.352.450
French Republic Government Bond OAT 1,80 % 25.7.2040	13.310.530	19.094.138	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35 % 15.9.2035	7.552.027	9.151.875
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,60 % 15.9.2023	15.972.984	18.302.540	French Republic Government Bond OAT 0,25 % 25.7.2024	8.165.920	8.856.664
French Republic Government Bond OAT 0,70 % 25.7.2030	15.324.433	17.552.279	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 1,75 % 15.4.2020	6.608.960	7.317.159
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,10 % 15.9.2021	15.600.235	17.241.481	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,10 % 15.9.2021	6.537.360	7.276.082
Spain Government Inflation Linked Bond 1,80 % 30.11.2024	14.812.448	16.811.817	French Republic Government Bond OAT 1,85 % 25.7.2027	5.604.344	7.024.734
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35 % 15.9.2035	13.422.029	15.850.680	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35 % 15.9.2024	5.782.710	6.527.219
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,50 % 15.4.2030	12.605.390	14.592.544	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,10 % 15.4.2023	5.421.472	5.931.462
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,10 % 15.9.2026	11.889.267	14.182.252	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35 % 15.9.2019	5.031.060	5.425.557
French Republic Government Bond OAT 3,15 % 25.7.2032	9.070.671	14.004.570	French Republic Government Bond OAT 1,10 % 25.7.2022	4.363.680	4.946.537
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,25 % 15.9.2032	13.988.459	13.919.477	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,55 % 15.9.2041	3.501.610	4.299.118
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,10 % 15.4.2023	12.638.682	13.686.393	French Republic Government Bond OAT 0,10 % 1.3.2021	4.024.000	4.274.695
French Republic Government Bond OAT 0,10 % 1.3.2021	12.379.249	13.095.450	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,50 % 15.4.2030	3.583.085	4.218.173
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35 % 15.9.2019	12.106.682	12.962.749	Spain Government Inflation Linked Bond 0,55 % 30.11.2019	4.028.120	4.207.774
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,10 % 15.5.2022	12.889.597	12.922.233	French Republic Government Bond OAT 0,70 % 25.7.2030	3.447.530	4.024.782
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35 % 15.9.2024	11.452.959	12.912.635	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,10 % 15.9.2026	3.199.560	3.903.463
Spain Government Inflation Linked Bond 1,00 % 30.11.2030	11.926.050	12.323.932	French Republic Government Bond OAT 3,15 % 25.7.2032	2.486.760	3.877.356
French Republic Government Bond OAT 1,10 % 25.7.2022	10.837.074	12.213.310	French Republic Government Bond OAT 0,10 % 1.3.2028	3.521.140	3.706.458
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 1,75 % 15.4.2020	10.864.863	11.860.408	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,10 % 15.4.2026	3.247.138	3.599.248
French Republic Government Bond OAT 0,10 % 25.7.2047	11.444.174	11.660.166	Spain Government Inflation Linked Bond 1,00 % 30.11.2030	3.012.810	3.144.169
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0,10 % 15.4.2046	9.866.574	11.357.781			
Spain Government Inflation Linked Bond 0,30 % 30.11.2021	9.871.747	10.401.101			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,55 % 15.9.2041	8.731.534	10.284.195			
Spain Government Inflation Linked Bond 0,55 % 30.11.2019	7.083.060	7.385.257			

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	Euro (€) Zum 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.685.184.056	1.501.183.063
Barmittel und liquide Vermögenswerte	211.997	2.495.457
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	8.034.892	7.438.396
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	11.853.594	9.912.794
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	—	1.346.688
Sonstige Forderungen	—	191.564
Summe Umlaufvermögen	1.705.284.539	1.522.567.962
Kurzfristige Passiva		
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	8.842.931	8.916.570
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	1.185.075	3.925.570
Zahlbare Verwaltungsgebühren	171.384	150.414
Summe kurzfristige Passiva	10.199.390	12.992.554
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken) („Nettovermögen“)	1.695.085.149	1.509.575.408

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Nettovermögen	278.307.954	279.541.873	244.455.959
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.275.416	2.313.991	2.097.654
Nettoinventarwert je Anteil	122,31	120,81	116,54
EUR-Anlegeranteile (€)			
Nettovermögen	30.938.824	14.053.825	9.115.735
Anzahl der umlaufenden Anteile	219.565	100.929	67.829
Nettoinventarwert je Anteil	140,91	139,24	134,39
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Nettovermögen	1.385.838.371	1.215.979.710	823.720.454
Anzahl der umlaufenden Anteile	12.060.213	10.724.633	7.538.545
Nettoinventarwert je Anteil	114,91	113,38	109,27

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	19.873.907	21.913.805
Verschiedene Erträge	—	15
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	4.474.484	25.667.651
Summe Anlageerträge/(-verluste)	24.348.391	47.581.471
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	1.825.806	1.551.710
Sonstige Aufwendungen	—	97
Summe Aufwendungen	1.825.806	1.551.807
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	20.415	7.670
Summe Finanzierungskosten	20.415	7.670
Nettoanlageerträge/(-verluste)	22.502.170	46.021.994
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	22.502.170	46.021.994

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Euro (€) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	22.502.170	46.021.994
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	459.733.434	532.087.723
Rücknahmen	(296.725.863)	(145.826.457)
Summe Kapitalgeschäfte	163.007.571	386.261.266
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	185.509.741	432.283.260
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	1.509.575.408	1.077.292.148
Zum Jahresende	1.695.085.149	1.509.575.408

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Global Bond Index Fund

Verwaltet durch The Vanguard Group, Inc., und unterverwaltet durch Vanguard Investments Australia Ltd.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds strebt eine Rendite an, die der Wertentwicklung des Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Bond Index entspricht, eines marktgewichteten Index für globale Staatsanleihen, regierungsnahe Anleihen sowie Unternehmensanleihen und verbrieft festverzinsliche Anlagen mit Laufzeiten von mehr als einem Jahr.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	9.348	21.126
Rendite auf Endfälligkeit	1,7 % ³	1,7 %
Durchschnittlicher Kupon	2,6 %	2,8 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	8,6 Jahre	8,7 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	Aa3	Aa3
Durchschnittliche Duration	6,8 Jahre	6,8 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Anlegeranteile	0,20 %	
Institutionelle Anteile	0,15 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %	
Thesaurierende Anteile	0,15 %	
Ausschüttende Anteile	0,15 %	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,10 %	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,10 %	
Kurzfristige Reserven	1,3 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
R ²	1,00	1,00
Beta	1,03	1,00

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
USA	39,7 %	39,8 %
Japan	11,4	11,4
Frankreich	6,7	6,9
Deutschland	6,1	5,9
Vereinigtes Königreich	4,9	5,0
Italien	4,5	4,5
Kanada	3,7	3,7
Spanien	3,0	3,1
Supranationale Anleihen	2,4	2,5
Australien	1,9	1,9
Niederlande	1,9	2,0
Korea	1,6	1,6
Belgien	1,2	1,3
Schweiz	1,2	1,0
Sonstige	9,8	9,4

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

Treasury-Titel	52,0 %
Industriegüter	11,5
Mortgage-Backed Security Pass-Through	8,6
Finanzinstitute	7,8
Agency-Titel	6,2
Forderungsbesicherte Wertpapiere	3,6
Lokale Behörde	2,9
Supranationale Anleihen	2,4
Versorger	1,7
Staatlich	1,4
Sonstige	0,9
Commercial Mortgage-Backed Security	0,7
Municipals	0,3

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	39,5 %
Aa	15,8
A	21,8
Baa	19,3
nicht eingestuft	3,6

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	43,5 %
5-10 Jahre	33,4
Mehr als 10 Jahre	23,1

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit	Kurz	Mittel	Lang
Kreditqualität			
Staats-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Bond Index.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

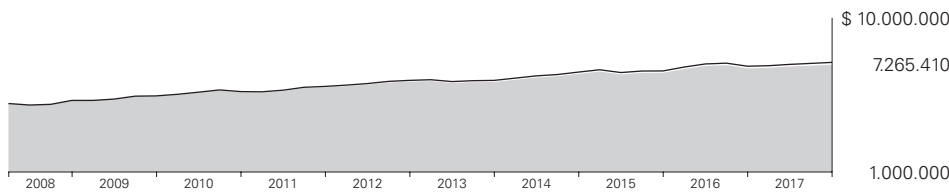
Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

Global Bond Index Fund
Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Bond Index USD-Hedged

Abgesichert in US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 31. März 2008–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
— Institutionelle Anteile, abgesichert in USD	3,03 %	2,97 %	3,91 %	\$ 7.265.410
— Benchmark ²	3,14	3,11	4,11	7.402.407

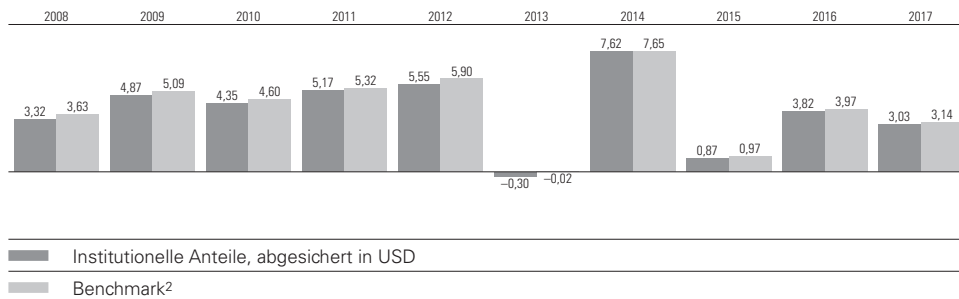
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von \$ 100.000
	Anlegeranteile, abgesichert in USD	2,97 %	2,31 %
Benchmark	3,14	2,47	107.112

	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von \$ 200.000.000
	Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in USD	3,08 %	2,41 %
Benchmark	3,14	2,47	214.224.954

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,11 Prozentpunkte für institutionelle in USD abgesicherte Anteile, 0,17 Prozentpunkte für in USD abgesicherte Anlegeranteile und 0,06 Prozentpunkte für institutionelle in USD abgesicherte Plus-Anteile.³

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,20 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 31. März 2008–31. Dezember 2017

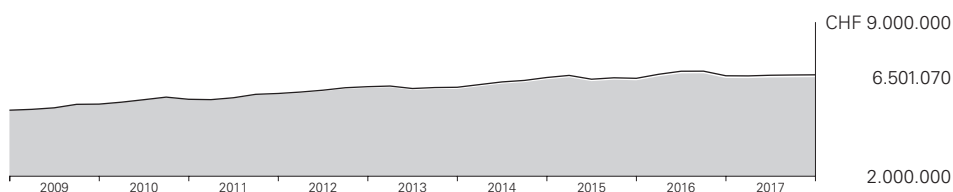


1 Für institutionelle in USD abgesicherte Anteile, 31. März 2008; für in Euro abgesicherte Anlegeranteile und institutionelle in USD abgesicherte Plus-Anteile, 10. März 2015.
 2 Bloomberg Barclays Global Aggregate Bond Index USD-Hedged bis 30. Juni 2010; danach Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Bond Index USD-Hedged.
 3 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Global Bond Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Bond Index CHF-Hedged

Abgesichert in Schweizer Franken

Kumulative Wertentwicklung: 30. Januar 2009–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. CHF 5.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von CHF 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
— Institutionelle Anteile, abgesichert in CHF	0,61 %	1,59 %	2,99 %	CHF 6.501.070
— Benchmark ²	0,66	1,72	3,17	6.606.466

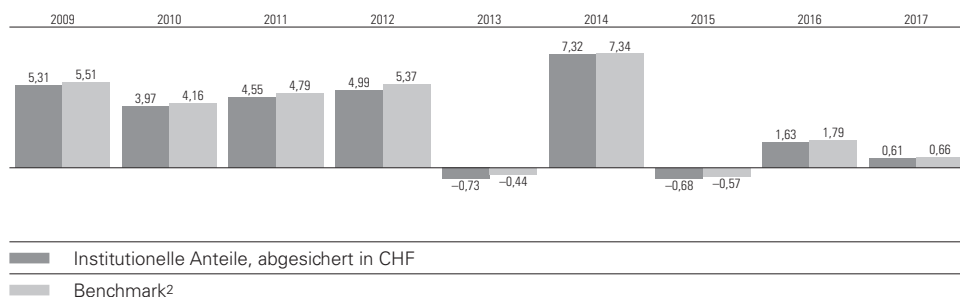
	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von CHF 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Anlegeranteile, abgesichert in CHF	0,56 %	0,28 %	CHF 100.802
Benchmark	0,66	0,43	101.213

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von CHF 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in CHF	0,68 %	1,09 %	CHF 207381.200
Benchmark	0,66	1,16	207847.548

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,05 Prozentpunkte für institutionelle in CHF abgesicherte Anteile, 0,10 Prozentpunkte für in CHF abgesicherte Anlegeranteile und 0,02 Prozentpunkte für institutionelle in CHF abgesicherte Plus-Anteile.³

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,20 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 30. Januar 2009–31. Dezember 2017

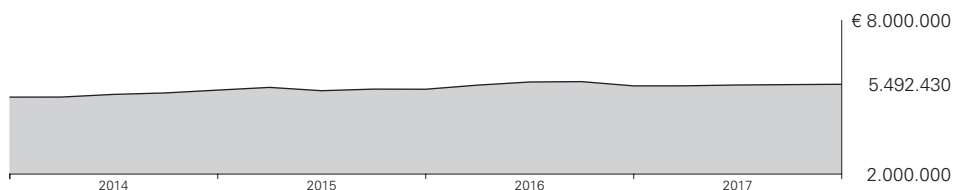


1 Für institutionelle in CHF abgesicherte Anteile, 30. Januar 2009; für in CHF abgesicherte Anlegeranteile, 10. März 2015; für institutionelle in CHF abgesicherte Plus-Anteile, 2. September 2014.
 2 Bloomberg Barclays Global Aggregate Bond Index CHF-Hedged bis 30. Juni 2010; danach Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Bond Index CHF-Hedged.
 3 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Global Bond Index Fund
Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Bond Index Euro-Hedged

Abgesichert in Euro

Kumulative Wertentwicklung: 27. Februar 2014–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
— Institutionelle Anteile, abgesichert in Euro	1,17 %	2,48 %	€ 5.492.430
— Benchmark	1,16	2,51	5.500.469

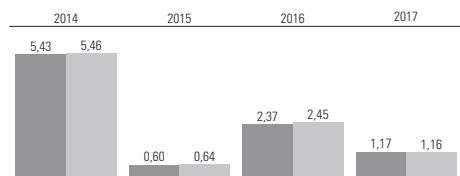
	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Anlegeranteile, abgesichert in Euro	1,12 %	0,99 %	€ 102.811
Benchmark	1,16	1,11	103.160

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in Euro	1,22 %	2,52 %	€ 220.026.600
Benchmark	1,16	2,51	220.018.775

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,01 Prozentpunkte für institutionelle in Euro abgesicherte Anteile, 0,04 Prozentpunkte für in Euro abgesicherte Anlegeranteile und 0,06 Prozentpunkte für institutionelle in Euro abgesicherte Plus-Anteile.²

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,20 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 27. Februar 2014–31. Dezember 2017



— Institutionelle Anteile, abgesichert in Euro
— Benchmark

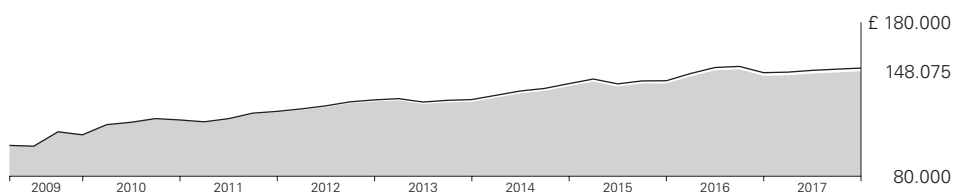
1 Für institutionelle in Euro abgesicherte Anteile und institutionelle in Euro abgesicherte Plus-Anteile, 27. Februar 2014; für in Euro abgesicherte Anlegeranteile, 10. März 2015.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Global Bond Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Bond Index GBP-Hedged

Abgesichert in GBP

Kumulative Wertentwicklung: 23. Juni 2009–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP	1,99 %	2,88 %	4,71 %	£ 148.075
Benchmark ²	2,04	3,00	4,89	150.190

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Ertragsanteile, abgesichert in GBP	1,99 %	2,88 %	4,71 %	£ 148.057
Benchmark ²	2,04	3,00	4,89	150.190

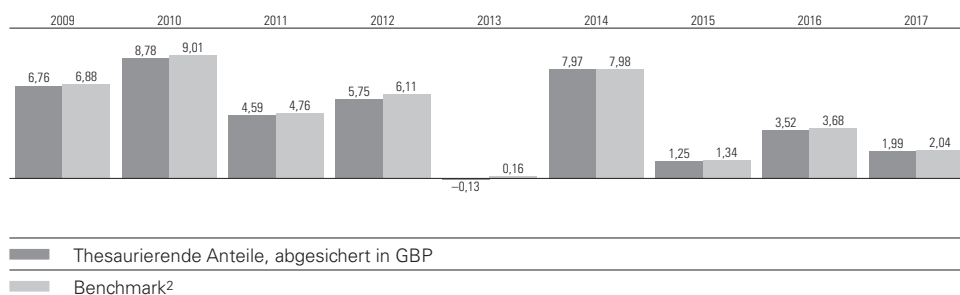
	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	2,05 %	2,76 %	4,71 %	£ 219.005.000
Benchmark	2,04	2,79	4,89	219.217.130

	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	2,05 %	2,77 %	4,71 %	£ 219.019.380
Benchmark	2,04	2,79	4,89	219.217.130

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,05 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte Thesaurierungsanteile und in GBP abgesicherte Ertragsanteile sowie 0,01 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile und in GBP abgesicherte institutionelle Plus-Ertragsanteile.³

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,20 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%) : 23. Juni 2009–31. Dezember 2017



1 Für in GBP abgesicherte Thesaurierungsanteile und in GBP abgesicherte Ertragsanteile, 23. Juni 2009; für institutionelle in GBP abgesicherte Plus-Thesaurierungsanteile und institutionelle in GBP abgesicherte Plus-Ertragsanteile, 2. September 2014.

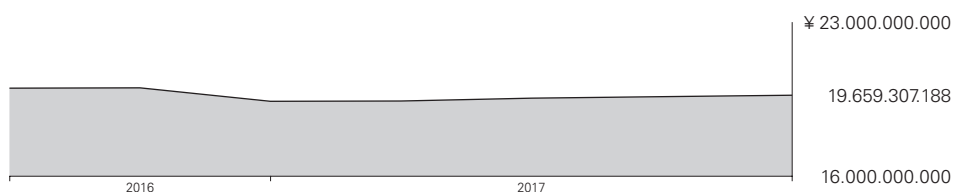
2 Bloomberg Barclays Global Aggregate Bond Index GBP-Hedged bis 30. Juni 2010; danach Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Bond Index GBP-Hedged.

3 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Global Bond Index Fund
Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Bond Index JPY-Hedged

Abgesichert in japanischen Yen

Kumulative Wertentwicklung: 8. September 2016–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. ¥ 20.000.000.000

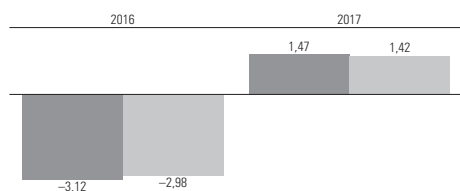


	Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von ¥ 20.000.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
■ Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in JPY	1,47 %	-1,30 %	¥ 19.659.307.188
— Benchmark	1,42	-1,22	19.679.362.212

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,05 Prozentpunkte für institutionelle in JPY abgesicherte Plus-Anteile.²

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,20 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 8. September 2016–31. Dezember 2017



■ Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in JPY
■ Benchmark

¹ 8. September 2016.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsergebnisse und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 98,39 % (2016: 98,26 %)					
Australien 1,85 % (2016: 1,75 %)					
Australia Government Bond	AUD 10.500.000	4,25 %	21.04.2026	9.228.947	0,10 %
Australia Government Bond	AUD 7.000.000	2,00 %	21.12.2021	5.421.465	0,06 %
Australia Government Bond	AUD 6.400.000	2,75 %	21.04.2024	5.087.354	0,05 %
Australia Government Bond	AUD 6.500.000	2,25 %	21.05.2028	4.888.720	0,05 %
Australia Government Bond	AUD 5.250.000	5,75 %	15.07.2022	4.711.805	0,05 %
Australia Government Bond	AUD 5.000.000	4,75 %	21.04.2027	4.594.850	0,05 %
Australia Government Bond	AUD 5.400.000	2,75 %	21.10.2019	4.280.434	0,05 %
Australia Government Bond	AUD 4.800.000	3,25 %	21.04.2025	3.932.425	0,04 %
Australia Government Bond	AUD 5.000.000	1,75 %	21.11.2020	3.868.612	0,04 %
Australia Government Bond	AUD 3.450.000	4,50 %	21.04.2033	3.225.146	0,03 %
Australia Government Bond	AUD 4.000.000	2,75 %	21.11.2027	3.158.469	0,03 %
Western Australian Treasury Corp.	AUD 4.000.000	2,75 %	20.10.2022	3.145.945	0,03 %
Commonwealth Bank of Australia	€ 2.200.000	1,13 %	22.12.2021	2.974.461	0,03 %
Queensland Treasury Corp.	AUD 3.500.000	3,25 %	21.07.2028	2.757.246	0,03 %
Australia Government Bond	AUD 3.000.000	5,50 %	21.04.2023	2.708.559	0,03 %
Australia Government Bond	AUD 3.000.000	2,75 %	21.11.2028	2.356.087	0,03 %
Australia Government Bond	AUD 2.700.000	3,75 %	21.04.2037	2.309.554	0,03 %
Queensland Treasury Corp.	AUD 2.750.000	2,75 %	20.08.2027	2.085.903	0,02 %
Queensland Treasury Corp.	AUD 2.300.000	5,50 %	21.06.2021	1.985.657	0,02 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 2.000.000	2,13 %	22.05.2020	1.985.050	0,02 %
Australia Government Bond	AUD 2.380.000	5,25 %	15.03.2019	1.935.784	0,02 %
Treasury Corp. of Victoria	AUD 2.000.000	6,00 %	17.10.2022	1.812.313	0,02 %
Commonwealth Bank of Australia	€ 1.500.000	0,50 %	11.07.2022	1.810.678	0,02 %
Queensland Treasury Corp.	AUD 2.000.000	6,00 %	21.07.2022	1.798.042	0,02 %
Treasury Corp. of Victoria	AUD 2.000.000	4,25 %	20.12.2032	1.729.376	0,02 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 1.700.000	3,90 %	12.07.2047	1.728.861	0,02 %
Australia Government Bond	AUD 2.100.000	3,25 %	21.04.2029	1.726.103	0,02 %
Australia Government Bond	AUD 2.050.000	4,50 %	15.04.2020	1.690.445	0,02 %
Queensland Treasury Corp.	AUD 1.900.000	6,25 %	21.02.2020	1.612.784	0,02 %
Queensland Treasury Corp.	AUD 1.700.000	5,75 %	22.07.2024	1.566.911	0,02 %
Macquarie Group Ltd.^	\$ 1.565.000	3,76 %	28.11.2028	1.558.959	0,02 %
New South Wales Treasury Corp.	AUD 1.800.000	4,00 %	20.04.2023	1.509.948	0,02 %
Macquarie Group Ltd.^	\$ 1.500.000	3,19 %	28.11.2023	1.489.490	0,02 %
Westpac Banking Corp.	\$ 1.500.000	2,50 %	28.06.2022	1.488.989	0,02 %
Westpac Banking Corp.	€ 1.000.000	1,00 %	30.06.2022	1.342.838	0,02 %
Westpac Banking Corp.	€ 1.100.000	0,50 %	17.05.2024	1.322.802	0,01 %
Macquarie Bank Ltd.	\$ 1.275.000	3,90 %	15.01.2026	1.320.886	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 1.250.000	2,13 %	22.07.2020	1.240.950	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia^	€ 1.000.000	1,94 %	03.10.2029	1.204.729	0,01 %
Westpac Banking Corp.	€ 1.000.000	0,25 %	17.01.2022	1.197.995	0,01 %
Scentre Group Trust 1/Scentre Group Trust 2	\$ 1.175.000	3,75 %	23.03.2027	1.186.750	0,01 %
Australia Government Bond	AUD 1.500.000	3,25 %	21.10.2018	1.186.579	0,01 %
Western Australian Treasury Corp.	AUD 1.500.000	2,50 %	22.07.2020	1.179.691	0,01 %
WEA Finance LLC/Westfield UK & Europe Finance plc	\$ 1.144.000	3,75 %	17.09.2024	1.173.697	0,01 %
Australia Government Bond	AUD 1.300.000	5,75 %	15.05.2021	1.133.728	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	€ 900.000	1,38 %	28.05.2021	1.130.924	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 1.000.000	4,50 %	09.12.2025	1.044.436	0,01 %
Westpac Banking Corp.	\$ 1.000.000	3,35 %	08.03.2027	1.008.291	0,01 %
Treasury Corp. of Victoria	AUD 1.000.000	5,50 %	17.12.2024	920.245	0,01 %
New South Wales Treasury Corp.	AUD 1.000.000	6,00 %	01.03.2022	893.537	0,01 %
Treasury Corp. of Victoria	AUD 1.000.000	6,00 %	15.06.2020	853.599	0,01 %
New South Wales Treasury Corp.	AUD 1.000.000	4,00 %	20.05.2026	849.855	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	€ 700.000	0,63 %	10.11.2023	842.070	0,01 %
Westpac Banking Corp.^	\$ 800.000	4,32 %	23.11.2031	821.644	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	€ 600.000	1,13 %	10.11.2021	812.009	0,01 %
Queensland Treasury Corp.	AUD 1.000.000	4,00 %	21.06.2019	804.904	0,01 %
Australia Government Bond	AUD 1.100.000	3,00 %	21.03.2047	802.774	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 800.000	2,63 %	19.05.2022	797.044	0,01 %
New South Wales Treasury Corp.	AUD 1.000.000	3,50 %	20.03.2019	796.987	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Western Australian Treasury Corp.	AUD 1.000.000	3,75 %	23.10.2018	793.485	0,01 %
Australia Government Bond	AUD 1.000.000	3,25 %	21.06.2039	789.166	0,01 %
New South Wales Treasury Corp.	AUD 1.000.000	3,00 %	20.05.2027	785.012	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	AUD 1.000.000	4,25 %	25.01.2018	783.528	0,01 %
New South Wales Treasury Corp.	AUD 1.000.000	3,00 %	20.03.2028	780.941	0,01 %
Westpac Banking Corp.	AUD 900.000	7,25 %	11.02.2020	772.279	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 800.000	2,63 %	06.09.2026	764.528	0,01 %
Australia Government Bond	AUD 1.000.000	2,75 %	21.06.2035	750.659	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 700.000	2,00 %	06.09.2021	685.247	0,01 %
Westfield America Management Ltd.	£ 500.000	2,13 %	30.03.2025	675.417	0,01 %
Asciano Finance Ltd.	AUD 800.000	5,25 %	19.05.2025	657.988	0,01 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.	\$ 600.000	3,85 %	30.09.2023	635.644	0,01 %
Macquarie Bank Ltd.	AUD 800.000	3,25 %	03.03.2020	634.102	0,01 %
Scentre Group Trust 1/Scentre Group Trust 2	€ 500.000	1,38 %	22.03.2023	620.571	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	€ 500.000	0,88 %	16.11.2022	618.997	0,01 %
Westpac Banking Corp.	€ 500.000	0,88 %	16.02.2021	614.713	0,01 %
Telstra Corp., Ltd.	€ 500.000	1,13 %	14.04.2026	604.925	0,01 %
Australian Capital Territory	AUD 700.000	4,25 %	11.04.2022	585.666	0,01 %
Macquarie Group Ltd.	\$ 550.000	6,00 %	14.01.2020	585.121	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 550.000	4,40 %	19.05.2026	571.688	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 550.000	2,25 %	10.03.2020	548.722	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	AUD 700.000	3,00 %	10.02.2023	543.559	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	CHF 500.000	1,00 %	17.04.2020	528.343	0,01 %
Suncorp-Metway Ltd.	\$ 525.000	2,38 %	09.11.2020	521.719	0,01 %
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd.	\$ 500.000	3,63 %	28.04.2026	503.940	0,01 %
Westpac Banking Corp.	\$ 500.000	2,60 %	23.11.2020	501.949	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 500.000	2,30 %	06.09.2019	500.132	0,01 %
Westpac Banking Corp.	\$ 500.000	2,30 %	26.05.2020	498.849	0,01 %
Barrick PD Australia Finance Pty Ltd.	\$ 400.000	5,95 %	15.10.2039	496.500	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 500.000	2,13 %	19.08.2020	495.645	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 500.000	2,50 %	22.05.2022	495.174	0,01 %
Westpac Banking Corp.	\$ 500.000	2,10 %	13.05.2021	493.192	0,01 %
Westpac Banking Corp.	€ 400.000	0,63 %	14.01.2022	490.067	0,01 %
Transurban Finance Co. Pty Ltd.	€ 400.000	1,75 %	29.03.2028	489.525	0,01 %
Wesfarmers Ltd.	AUD 600.000	3,66 %	18.11.2020	478.321	0,01 %
Telstra Corp., Ltd.	AUD 600.000	4,50 %	13.11.2018	478.100	0,01 %
Ausgrid Finance Pty Ltd.	AUD 600.000	3,75 %	30.10.2024	470.810	0,01 %
AusNet Services Holdings Pty Ltd.	AUD 550.000	4,40 %	16.08.2027	447.706	0,01 %
Woodside Finance Ltd.	\$ 450.000	3,70 %	15.03.2028	447.543	0,01 %
Queensland Treasury Corp.	AUD 500.000	4,75 %	21.07.2025	440.595	0,01 %
Westpac Banking Corp.	AUD 500.000	5,25 %	21.11.2023	436.813	0,01 %
South Australian Government Financing Authority	AUD 500.000	4,25 %	20.11.2023	423.866	0,01 %
SGSP Australia Assets Pty Ltd.	AUD 500.000	5,50 %	12.03.2021	418.680	0,01 %
South Australian Government Financing Authority	AUD 500.000	4,75 %	06.08.2019	407.937	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 400.000	2,75 %	10.03.2022	401.177	0,01 %
Toyota Finance Australia Ltd.	AUD 500.000	4,25 %	15.05.2019	400.830	0,01 %
Queensland Treasury Corp.	AUD 500.000	3,25 %	21.07.2026	398.692	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 400.000	2,55 %	23.11.2021	397.578	0,01 %
Westpac Banking Corp.^	AUD 500.000	4,50 %	11.03.2027	396.813	0,01 %
Northern Territory Treasury Corp.	AUD 500.000	3,50 %	21.04.2028	395.651	0,01 %
Westpac Banking Corp.	\$ 400.000	2,10 %	25.02.2021	395.078	0,01 %
Australia Government Bond	AUD 500.000	5,50 %	21.01.2018	391.993	0,01 %
South Australian Government Financing Authority	AUD 500.000	3,00 %	20.07.2026	390.168	0,00 %
Northern Territory Treasury Corp.	AUD 500.000	2,75 %	21.10.2024	384.293	0,00 %
SGSP Australia Assets Pty Ltd.	€ 300.000	2,00 %	30.06.2022	383.743	0,00 %
National Australia Bank Ltd.	€ 300.000	2,00 %	12.11.2020	379.887	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	€ 300.000	1,63 %	10.02.2031	379.315	0,00 %
Wesfarmers Ltd.	€ 300.000	1,25 %	07.10.2021	374.584	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia^	€ 300.000	2,00 %	22.04.2027	372.116	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	€ 300.000	0,75 %	04.11.2021	369.666	0,00 %
GALF Bond Issuer Pty Ltd.	\$ 375.000	3,40 %	30.09.2026	367.863	0,00 %
Rio Tinto Finance USA Ltd.	\$ 350.000	3,75 %	15.06.2025	366.583	0,00 %
Macquarie Bank Ltd.	€ 300.000	1,00 %	16.09.2019	366.468	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	€ 300.000	0,38 %	10.02.2021	364.938	0,00 %
Macquarie Bank Ltd.	€ 300.000	0,38 %	03.03.2021	364.056	0,00 %
Macquarie Group Ltd.	AUD 450.000	3,25 %	15.12.2022	349.478	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 350.000	2,85 %	18.05.2026	341.195	0,00 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 325.000	2,63 %	23.07.2020	326.647	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Macquarie Bank Ltd.	\$ 325.000	2,85 %	15.01.2021	326.270	0,00 %
Incitec Pivot Finance LLC	\$ 300.000	6,00 %	10.12.2019	317874	0,00 %
Transurban Finance Co. Pty Ltd.	\$ 300.000	4,13 %	02.02.2026	307875	0,00 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 300.000	3,38 %	14.01.2026	304.446	0,00 %
Macquarie Bank Ltd.	\$ 300.000	2,35 %	15.01.2019	300.050	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 300.000	1,75 %	02.11.2018	299.301	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 300.000	2,40 %	02.11.2020	299.270	0,00 %
Westpac Banking Corp.	\$ 300.000	2,75 %	11.01.2023	298.949	0,00 %
Westpac Banking Corp.	\$ 300.000	2,15 %	06.03.2020	298.548	0,00 %
Rio Tinto Finance USA plc	\$ 250.000	4,75 %	22.03.2042	288.944	0,00 %
BHP Billiton Finance Ltd.	€ 200.000	3,13 %	29.04.2033	286.175	0,00 %
Westpac Banking Corp.	£ 200.000	2,63 %	14.12.2022	285.538	0,00 %
Rio Tinto Finance USA plc	\$ 250.000	4,13 %	21.08.2042	268.778	0,00 %
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd.	€ 200.000	2,75 %	23.04.2024	266.242	0,00 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 250.000	3,70 %	16.11.2025	262.637	0,00 %
Origin Energy Finance Ltd.	€ 200.000	2,50 %	23.10.2020	255.069	0,00 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 250.000	2,25 %	13.06.2019	250.058	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 250.000	2,55 %	15.03.2021	249.731	0,00 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 250.000	2,00 %	14.01.2019	249.434	0,00 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 250.000	2,05 %	23.09.2019	248.809	0,00 %
Westpac Banking Corp.	\$ 250.000	2,00 %	03.03.2020	247.882	0,00 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 250.000	2,25 %	16.03.2021	247.863	0,00 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 250.000	1,60 %	15.07.2019	247.552	0,00 %
AusNet Services Holdings Pty Ltd.	€ 200.000	1,50 %	26.02.2027	247.413	0,00 %
Westpac Banking Corp.	€ 200.000	0,75 %	22.07.2021	246.202	0,00 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.	\$ 200.000	5,00 %	30.09.2043	243.526	0,00 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	€ 200.000	0,38 %	19.11.2019	243.056	0,00 %
Treasury Corp. of Victoria	AUD 300.000	5,50 %	15.11.2018	241.997	0,00 %
FBG Finance Pty Ltd.	AUD 300.000	3,75 %	07.08.2020	240.257	0,00 %
Tasmanian Public Finance Corp.	AUD 300.000	3,25 %	19.02.2026	237.634	0,00 %
Rio Tinto Finance USA Ltd.	\$ 225.000	4,13 %	20.05.2021	236.070	0,00 %
BHP Billiton Finance Ltd.	AUD 280.000	3,00 %	30.03.2020	220.912	0,00 %
BHP Billiton Finance USA Ltd. ^	\$ 200.000	6,25 %	19.10.2075	216.500	0,00 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.	\$ 200.000	4,13 %	24.02.2042	213.030	0,00 %
Macquarie Bank Ltd.	\$ 200.000	4,88 %	10.06.2025	211.097	0,00 %
APT Pipelines Ltd.	\$ 200.000	4,25 %	15.07.2027	206.919	0,00 %
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd.	\$ 200.000	3,90 %	22.03.2023	206.338	0,00 %
Woodside Finance Ltd.	\$ 200.000	3,65 %	05.03.2025	201.319	0,00 %
Westpac Banking Corp.	\$ 200.000	2,80 %	11.01.2022	201.253	0,00 %
Westpac Banking Corp.	\$ 200.000	1,95 %	23.11.2018	200.028	0,00 %
Woodside Finance Ltd.	\$ 200.000	3,70 %	15.09.2026	199.926	0,00 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 200.000	2,25 %	09.11.2020	198.799	0,00 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 200.000	2,63 %	09.11.2022	198.736	0,00 %
Westpac Banking Corp.	\$ 200.000	1,60 %	19.08.2019	197.796	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 200.000	2,05 %	18.09.2020	197.763	0,00 %
Amcor Finance USA, Inc.	\$ 200.000	3,63 %	28.04.2026	197.172	0,00 %
Westpac Banking Corp.	\$ 200.000	2,00 %	19.08.2021	196.313	0,00 %
Westpac Banking Corp.	\$ 200.000	2,85 %	13.05.2026	194.832	0,00 %
Qantas Airways Ltd.	AUD 200.000	7,50 %	11.06.2021	176.467	0,00 %
Telstra Corp., Ltd.	\$ 175.000	3,13 %	07.04.2025	175.114	0,00 %
BHP Billiton Finance Ltd.	£ 100.000	4,30 %	25.09.2042	170.053	0,00 %
Macquarie Bank Ltd.	\$ 150.000	4,00 %	29.07.2025	156.527	0,00 %
Scentre Group Trust 1	£ 100.000	3,88 %	16.07.2026	152.499	0,00 %
Rio Tinto Finance USA Ltd.	\$ 125.000	5,20 %	02.11.2040	151.898	0,00 %
Macquarie Bank Ltd.	\$ 150.000	2,85 %	29.07.2020	150.781	0,00 %
National Australia Bank Ltd.	£ 100.000	3,00 %	04.09.2026	150.533	0,00 %
SGSP Australia Assets Pty Ltd.	£ 100.000	5,13 %	11.02.2021	150.014	0,00 %
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd.	\$ 150.000	3,38 %	30.04.2025	149.350	0,00 %
Westpac Banking Corp.	\$ 150.000	1,65 %	13.05.2019	148.892	0,00 %
Vicinity Centres	£ 100.000	3,38 %	07.04.2026	145.546	0,00 %
Westpac Banking Corp.	£ 100.000	5,00 %	21.10.2019	144.936	0,00 %
BHP Billiton Finance Ltd.	€ 100.000	3,25 %	24.09.2027	143.672	0,00 %
APT Pipelines Ltd.	£ 100.000	3,50 %	22.03.2030	143.063	0,00 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	€ 100.000	3,63 %	18.07.2022	138.764	0,00 %
Rio Tinto Finance plc	€ 100.000	2,88 %	11.12.2024	137.812	0,00 %
Telstra Corp., Ltd.	€ 100.000	3,50 %	21.09.2022	137.208	0,00 %
Telstra Corp., Ltd.	€ 100.000	2,50 %	15.09.2023	132.464	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Transurban Finance Co. Pty Ltd.	€ 100.000	2,00 %	28.08.2025	127.412	0,00 %
Transurban Finance Co. Pty Ltd.	€ 100.000	2,50 %	08.10.2020	127.202	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	CAD 150.000	5,15 %	09.04.2020	127.044	0,00 %
Transurban Finance Co. Pty Ltd.	€ 100.000	1,88 %	16.09.2024	126.918	0,00 %
Aurizon Network Pty Ltd.	€ 100.000	2,00 %	18.09.2024	126.773	0,00 %
Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd.	€ 100.000	1,75 %	15.10.2024	126.492	0,00 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.	\$ 125.000	2,88 %	24.02.2022	126.267	0,00 %
Rio Tinto Finance plc	€ 100.000	2,00 %	11.05.2020	125.476	0,00 %
Westpac Banking Corp.	€ 100.000	2,13 %	09.07.2019	124.517	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 125.000	2,50 %	18.09.2022	123.655	0,00 %
Macquarie Bank Ltd.	€ 100.000	1,13 %	20.01.2022	123.546	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	€ 100.000	1,38 %	22.01.2019	122.268	0,00 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.^	\$ 100.000	6,75 %	19.10.2075	116.750	0,00 %
Macquarie Group Ltd.	\$ 100.000	7,63 %	13.08.2019	107.902	0,00 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 100.000	5,10 %	13.01.2020	105.375	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 100.000	5,00 %	15.10.2019	104.647	0,00 %
Westpac Banking Corp.	\$ 100.000	4,88 %	19.11.2019	104.641	0,00 %
Goodman US Finance Four LLC	\$ 100.000	4,50 %	15.10.2037	103.671	0,00 %
WEA Finance LLC	\$ 100.000	3,15 %	05.04.2022	101.075	0,00 %
Macquarie Bank Ltd.	\$ 100.000	2,60 %	24.06.2019	100.284	0,00 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 100.000	2,13 %	09.09.2019	99.771	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 100.000	3,15 %	19.09.2027	98.559	0,00 %
Transurban Finance Co. Pty Ltd.	\$ 100.000	3,38 %	22.03.2027	97.443	0,00 %
Scentre Group Trust 1/Scentre Group Trust 2	\$ 80.000	2,38 %	05.11.2019	79.810	0,00 %
Scentre Group Trust 1/Scentre Group Trust 2	\$ 75.000	3,25 %	28.10.2025	73.789	0,00 %
National Australia Bank Ltd.	€ 50.000	4,00 %	13.07.2020	66.049	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	€ 50.000	4,38 %	25.02.2020	65.693	0,00 %
National Australia Bank Ltd.	€ 50.000	4,63 %	10.02.2020	65.602	0,00 %
Rio Tinto Finance USA plc	\$ 63.000	2,88 %	21.08.2022	63.354	0,00 %
QPH Finance Co. Pty Ltd.	AUD 70.000	5,75 %	29.07.2020	58.314	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 50.000	2,00 %	18.06.2019	49.819	0,00 %
Virgin Australia 2013-1A Pass Through Trust	\$ 32.791	5,00 %	23.10.2023	34.103	0,00 %
				176.222.509	1,85 %
Österreich 0,71 % (2016: 0,74 %)					
Republic of Austria Government Bond	€ 7.600.000	0,75 %	20.10.2026	9.331.417	0,10 %
Republic of Austria Government Bond	€ 5.500.000	0,00 %	15.07.2023	6.588.774	0,07 %
Republic of Austria Government Bond	€ 5.000.000	0,50 %	20.04.2027	5.961.384	0,06 %
Republic of Austria Government Bond	€ 2.550.000	4,15 %	15.03.2037	4.653.113	0,05 %
Republic of Austria Government Bond	€ 2.750.000	3,40 %	22.11.2022	3.869.373	0,04 %
Republic of Austria Government Bond	€ 2.450.000	3,65 %	20.04.2022	3.429.384	0,04 %
Republic of Austria Government Bond	€ 1.600.000	3,15 %	20.06.2044	2.689.638	0,03 %
Republic of Austria Government Bond	€ 1.900.000	3,90 %	15.07.2020	2.533.523	0,03 %
Republic of Austria Government Bond	€ 1.350.000	4,85 %	15.03.2026	2.219.858	0,02 %
Republic of Austria Government Bond	€ 1.550.000	1,95 %	18.06.2019	1.928.114	0,02 %
Republic of Austria Government Bond	€ 1.500.000	1,20 %	20.10.2025	1.922.295	0,02 %
Republic of Austria Government Bond	€ 1.400.000	4,35 %	15.03.2019	1.779.691	0,02 %
Republic of Austria Government Bond	€ 1.666.000	1,50 %	02.11.2086	1.755.996	0,02 %
Republic of Austria Government Bond	€ 1.200.000	1,65 %	21.10.2024	1.585.383	0,02 %
Republic of Austria Government Bond	€ 1.050.000	2,40 %	23.05.2034	1.512.652	0,02 %
OMV AG	€ 1.000.000	1,00 %	14.12.2026	1.184.361	0,01 %
Republic of Austria Government Bond	€ 800.000	3,50 %	15.09.2021	1.097.493	0,01 %
KAF Kaerntner Ausgleichszahlungs-Fonds	€ 1.000.000	0,00 %	14.01.2032	1.005.312	0,01 %
Republic of Austria Government Bond	€ 700.000	2,10 %	20.09.2117	896.356	0,01 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	CHF 600.000	2,88 %	25.02.2030	805.028	0,01 %
OeBB-Infrastruktur AG	€ 500.000	2,25 %	28.05.2029	680.257	0,01 %
Erste Group Bank AG	€ 500.000	0,75 %	05.02.2025	611.841	0,01 %
JAB Holdings BV	€ 500.000	1,25 %	22.05.2024	610.242	0,01 %
Republic of Austria Government Bond	€ 500.000	0,25 %	18.10.2019	608.442	0,01 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	\$ 500.000	1,50 %	21.10.2020	490.689	0,01 %
Erste Group Bank AG	€ 400.000	0,63 %	19.01.2023	490.151	0,01 %
Republic of Austria Government Bond	€ 400.000	1,50 %	20.02.2047	485.427	0,01 %
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	€ 400.000	0,38 %	23.02.2022	485.342	0,01 %
Hypoe NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG	€ 300.000	0,75 %	22.09.2021	368.432	0,01 %
Erste Group Bank AG	€ 300.000	0,38 %	09.09.2020	365.275	0,01 %
KA Finanz AG	€ 300.000	0,38 %	11.08.2020	365.268	0,00 %
UniCredit Bank Austria AG	€ 300.000	0,75 %	25.02.2025	365.110	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
OMV AG^	€ 200.000	6,25 %	09.12.2166	301.157	0,00 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	\$ 300.000	1,63 %	12.03.2019	298.914	0,00 %
Republic of Austria Government Bond	€ 150.000	6,25 %	15.07.2027	277.356	0,00 %
Autobahnen- und Schnell- strassen-Finanzierungs AG	€ 200.000	0,63 %	15.09.2022	246.459	0,00 %
Raiffeisen-Landesbank Steiermark AG	€ 200.000	0,63 %	20.01.2023	244.045	0,00 %
Hypoe NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG	€ 200.000	0,50 %	11.09.2020	243.629	0,00 %
Hypo Vorarlberg Bank AG	€ 200.000	0,75 %	11.02.2025	242.676	0,00 %
OeBB-Infrastruktur AG	€ 180.000	1,00 %	18.11.2024	224.969	0,00 %
OeBB-Infrastruktur AG	€ 150.000	3,63 %	13.07.2021	204.032	0,00 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	\$ 200.000	1,38 %	10.02.2020	196.752	0,00 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	\$ 180.000	1,13 %	26.04.2019	177.775	0,00 %
UNIQA Insurance Group AG^	€ 100.000	6,00 %	27.07.2046	150.511	0,00 %
OeBB-Infrastruktur AG	€ 100.000	3,00 %	24.10.2033	147.953	0,00 %
Autobahnen- und Schnell- strassen-Finanzierungs AG	€ 100.000	2,75 %	20.06.2033	143.869	0,00 %
Autobahnen- und Schnell- strassen-Finanzierungs AG	€ 100.000	2,75 %	11.06.2032	143.340	0,00 %
OMV AG^	€ 100.000	5,25 %	09.12.2166	136.591	0,00 %
UniCredit Bank Austria AG	€ 100.000	4,13 %	24.02.2021	135.714	0,00 %
UniCredit Bank Austria AG	€ 100.000	1,88 %	29.10.2020	126.703	0,00 %
KA Finanz AG	€ 100.000	1,63 %	19.02.2021	125.737	0,00 %
Verbund AG	€ 100.000	1,50 %	20.11.2024	125.655	0,00 %
Hypo Vorarlberg Bank AG	€ 100.000	1,50 %	22.05.2019	122.659	0,00 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	CHF 100.000	2,63 %	22.11.2024	121.652	0,00 %
OeBB-Infrastruktur AG	€ 50.000	3,38 %	18.05.2032	76.535	0,00 %
Autobahnen- und Schnell- strassen-Finanzierungs AG	€ 50.000	3,38 %	22.09.2025	73.208	0,00 %
Telekom Finanzmanagement GmbH	€ 50.000	4,00 %	04.04.2022	69.159	0,00 %
OMV AG	€ 50.000	4,25 %	12.10.2021	69.142	0,00 %
OeBB-Infrastruktur AG	€ 50.000	2,25 %	04.07.2023	66.771	0,00 %
Telekom Finanzmanagement GmbH	€ 50.000	3,13 %	03.12.2021	66.717	0,00 %
				67.235.301	0,71 %
Belgien 1,22 % (2016: 1,17 %)					
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 7.300.000	2,25 %	22.06.2023	9.858.186	0,10 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 6.000.000	3,75 %	28.09.2020	8.036.011	0,08 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 5.550.000	0,80 %	22.06.2027	6.765.133	0,07 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 5.000.000	1,90 %	22.06.2038	6.556.212	0,07 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 5.000.000	0,50 %	22.10.2024	6.115.734	0,06 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 3.100.000	4,25 %	28.03.2041	5.804.612	0,06 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 4.500.000	0,80 %	22.06.2025	5.589.835	0,06 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 4.630.000	1,00 %	22.06.2031	5.551.943	0,06 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 2.800.000	3,00 %	22.06.2034	4.282.156	0,05 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 2.900.000	4,25 %	28.09.2021	4.079.628	0,04 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 3.000.000	2,15 %	22.06.2066	3.806.987	0,04 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 2.600.000	4,25 %	28.09.2022	3.773.736	0,04 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 2.753.000	1,00 %	22.06.2026	3.452.669	0,04 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 2.600.000	3,00 %	28.09.2019	3.313.966	0,04 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 1.800.000	2,60 %	22.06.2024	2.503.877	0,03 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 2.000.000	1,45 %	22.06.2037	2.450.689	0,03 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 1.900.000	4,00 %	28.03.2019	2.410.065	0,03 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 1.900.000	0,88 %	17.03.2022	2.336.680	0,02 %
KBC Bank NV	€ 1.500.000	0,75 %	24.10.2027	1.794.228	0,02 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 1.500.000	1,60 %	22.06.2047	1.763.375	0,02 %
Dexia Credit Local SA	\$ 1.600.000	2,25 %	18.02.2020	1.596.059	0,02 %
Dexia Credit Local SA	£ 1.000.000	2,00 %	17.06.2020	1.386.014	0,01 %
Dexia Credit Local SA	£ 1.000.000	0,88 %	07.09.2021	1.340.986	0,01 %
Anheuser-Busch InBev SA	£ 1.000.000	1,75 %	07.03.2025	1.338.211	0,01 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 1.000.000	0,63 %	17.03.2020	1.217.157	0,01 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 750.000	4,50 %	28.03.2026	1.204.612	0,01 %
Belfius Bank SA	€ 1.000.000	0,75 %	12.09.2022	1.203.693	0,01 %
Dexia Credit Local SA	€ 900.000	0,63 %	21.01.2022	1.106.126	0,01 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 600.000	3,75 %	22.06.2045	1.068.916	0,01 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 1.000.000	3,75 %	15.01.2022	1.043.965	0,01 %
Argenta Spaarbank NV^	€ 700.000	3,88 %	24.05.2026	911.839	0,01 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 550.000	4,00 %	28.03.2022	780.297	0,01 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 600.000	2,00 %	17.03.2028	769.305	0,01 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 600.000	1,50 %	17.03.2025	755.923	0,01 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 650.000	4,95 %	15.01.2042	753.179	0,01 %
Kingdom of Belgium Government International Bond	\$ 750.000	1,63 %	15.01.2020	742.598	0,01 %
Anheuser-Busch InBev SA	£ 500.000	2,85 %	25.05.2037	676.171	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeitsdatum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Eandis System Operator SCRL	€ 500.000	1,75 %	04.12.2026	636.915	0,01 %
Dexia Credit Local SA	€ 500.000	0,75 %	25.01.2023	615.986	0,01 %
Belfius Bank SA	€ 500.000	0,38 %	27.11.2019	608.385	0,01 %
Dexia Credit Local SA	€ 500.000	0,20 %	16.03.2021	605.947	0,01 %
Dexia Credit Local SA	\$ 500.000	1,88 %	29.01.2020	495.631	0,01 %
KBC Bank NV	€ 400.000	0,45 %	22.01.2022	489.071	0,01 %
KBC Bank NV	€ 400.000	0,38 %	01.09.2022	486.937	0,01 %
Brussels Airport Co. NV	€ 400.000	1,00 %	03.05.2024	482.979	0,01 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 300.000	2,75 %	17.03.2036	395.344	0,00 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 300.000	1,88 %	20.01.2020	374.134	0,00 %
Koninklijke Ahold Delhaize NV	\$ 225.000	5,70 %	01.10.2040	264.824	0,00 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 200.000	2,25 %	24.09.2020	254.341	0,00 %
Dexia Credit Local SA	\$ 250.000	1,88 %	15.09.2021	244.120	0,00 %
Solvay Finance America LLC	\$ 225.000	3,40 %	03.12.2020	229.139	0,00 %
Kingdom of Belgium Government International Bond	\$ 200.000	2,88 %	18.09.2024	202.570	0,00 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 100.000	2,70 %	31.03.2026	135.834	0,00 %
Eandis System Operator SCRL	€ 100.000	2,88 %	09.10.2023	135.152	0,00 %
Proximus SADP	€ 100.000	2,38 %	04.04.2024	132.064	0,00 %
Proximus SADP	€ 100.000	1,88 %	01.10.2025	128.472	0,00 %
Dexia Credit Local SA	€ 100.000	2,00 %	22.01.2021	127.803	0,00 %
Dexia Credit Local SA	€ 100.000	1,25 %	26.11.2024	125.908	0,00 %
Belfius Bank SA	€ 100.000	0,63 %	14.10.2021	122.979	0,00 %
Belfius Bank SA	€ 100.000	1,25 %	28.01.2019	122.155	0,00 %
Belfius Bank SA	€ 100.000	0,75 %	10.02.2025	122.139	0,00 %
KBC Bank NV	€ 100.000	1,00 %	25.02.2019	121.985	0,00 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 50.000	2,88 %	25.09.2024	68.546	0,00 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 50.000	2,00 %	16.12.2019	62.501	0,00 %
				115.932.634	1,22 %
Bermuda 0,08 % (2016: 0,09 %)					
Bermuda Government International Bond	\$ 3.800.000	3,72 %	25.01.2027	3.801.368	0,04 %
Allied World Assurance Co. Holdings Ltd.	\$ 1.875.000	4,35 %	29.10.2025	1.880.449	0,02 %
XLIT Ltd. ^	€ 1.000.000	3,25 %	29.06.2047	1.211.217	0,01 %
PartnerRe Ireland Finance DAC	€ 242.000	1,25 %	15.09.2026	284.718	0,01 %
Bacardi Ltd.	\$ 100.000	2,75 %	15.07.2026	95.474	0,00 %
Allied World Assurance Co. Holdings Ltd.	\$ 50.000	5,50 %	15.11.2020	53.202	0,00 %
Enstar Group Ltd.	\$ 50.000	4,50 %	10.03.2022	51.000	0,00 %
				7.377.428	0,08 %
Brasilien 0,09 % (2016: 0,08 %)					
Vale Overseas Ltd.	\$ 1.800.000	5,88 %	10.06.2021	1.964.250	0,02 %
Embraer SA	\$ 1.725.000	5,15 %	15.06.2022	1.838.044	0,02 %
Vale Overseas Ltd.	\$ 1.125.000	4,38 %	11.01.2022	1.164.375	0,01 %
GTL Trade Finance, Inc./Gerdau Holdings, Inc.	\$ 600.000	5,89 %	29.04.2024	642.750	0,01 %
Vale Overseas Ltd.	\$ 375.000	6,88 %	10.11.2039	458.438	0,01 %
Vale SA	\$ 400.000	5,63 %	11.09.2042	438.000	0,01 %
Braskem America Finance Co.	\$ 200.000	7,13 %	22.07.2041	238.500	0,01 %
Vale Canada Ltd.	\$ 200.000	7,20 %	15.09.2032	230.210	0,00 %
Embraer Overseas Ltd.	\$ 200.000	5,70 %	16.09.2023	219.646	0,00 %
Raizen Fuels Finance SA	\$ 200.000	5,30 %	20.01.2027	209.139	0,00 %
Gerdau Trade, Inc.	\$ 200.000	4,88 %	24.10.2027	199.686	0,00 %
GTL Trade Finance, Inc./Gerdau Holdings, Inc.	\$ 150.000	5,89 %	29.04.2024	160.688	0,00 %
Embraer Netherlands Finance BV	\$ 150.000	5,05 %	15.06.2025	159.318	0,00 %
Vale Overseas Ltd.	\$ 125.000	6,88 %	21.11.2036	153.281	0,00 %
Fibria Overseas Finance Ltd.	\$ 150.000	4,00 %	14.01.2025	148.762	0,00 %
BRF SA	€ 100.000	2,75 %	03.06.2022	124.508	0,00 %
Vale Overseas Ltd.	\$ 100.000	6,25 %	10.08.2026	115.875	0,00 %
				8.465.470	0,09 %
Bulgarien 0,02 % (2016: 0,02 %)					
Bulgaria Government International Bond	€ 400.000	3,13 %	26.03.2035	540.961	0,01 %
Bulgaria Government International Bond	€ 400.000	1,88 %	21.03.2023	521.435	0,01 %
Bulgaria Government International Bond	€ 400.000	2,00 %	26.03.2022	521.147	0,00 %
Bulgaria Government International Bond	€ 100.000	2,95 %	03.09.2024	138.293	0,00 %
Bulgaria Government International Bond	€ 100.000	3,00 %	21.03.2028	138.272	0,00 %
				1.860.108	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Kanada 3,62 % (2016: 3,47 %)					
Canadian Government Bond	CAD 10.000.000	1,00 %	01.09.2022	7.673.491	0,08 %
Canadian Government Bond	CAD 7.625.000	3,50 %	01.06.2020	6.339.287	0,07 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 8.000.000	1,75 %	15.06.2022	6.289.477	0,07 %
Canadian Government Bond	CAD 8.000.000	0,75 %	01.09.2020	6.223.329	0,07 %
Canadian Government Bond	CAD 4.525.000	5,00 %	01.06.2037	5.183.625	0,06 %
Canadian Government Bond	CAD 6.500.000	0,75 %	01.08.2019	5.113.883	0,05 %
Canadian Government Bond	CAD 5.085.000	1,25 %	01.11.2019	4.026.564	0,04 %
Canadian Government Bond	CAD 4.475.000	3,75 %	01.06.2019	3.676.361	0,04 %
Canadian Government Bond	CAD 4.550.000	1,50 %	01.03.2020	3.614.689	0,04 %
Canadian Government Bond	CAD 3.005.000	5,75 %	01.06.2033	3.523.161	0,04 %
Canadian Government Bond	CAD 4.400.000	0,75 %	01.09.2021	3.382.236	0,04 %
Canadian Government Bond	CAD 4.176.000	1,75 %	01.09.2019	3.337.234	0,04 %
Canadian Government Bond	CAD 2.950.000	4,00 %	01.06.2041	3.086.558	0,03 %
Province Ontario Kanada	CAD 3.575.000	3,50 %	02.06.2024	3.035.590	0,03 %
Canadian Government Bond	CAD 2.890.000	3,50 %	01.12.2045	2.884.995	0,03 %
Toronto-Dominion Bank	CAD 3.650.000	1,68 %	08.06.2021	2.854.251	0,03 %
Canadian Government Bond	CAD 3.203.000	2,75 %	01.12.2048	2.829.898	0,03 %
Province Ontario Kanada	CAD 3.110.000	3,45 %	02.06.2045	2.713.751	0,03 %
Province Ontario Kanada	CAD 2.625.000	4,65 %	02.06.2041	2.699.877	0,03 %
Province Ontario Kanada	CAD 3.450.000	2,80 %	02.06.2048	2.676.817	0,03 %
Bank of Nova Scotia	£ 2.000.000	0,75 %	14.09.2021	2.676.248	0,03 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 3.385.000	1,25 %	15.12.2020	2.649.942	0,03 %
Bank of Nova Scotia	€ 2.100.000	0,50 %	23.07.2020	2.563.331	0,03 %
Province Ontario Kanada	CAD 3.200.000	2,60 %	02.06.2027	2.550.320	0,03 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 3.100.000	2,35 %	15.03.2028	2.458.153	0,03 %
Province Ontario Kanada	€ 2.000.000	0,38 %	14.06.2024	2.383.905	0,03 %
Canadian Government Bond	CAD 3.000.000	0,50 %	01.02.2019	2.367.485	0,03 %
Province Ontario Kanada	CAD 2.900.000	2,60 %	02.06.2025	2.328.425	0,03 %
Canadian Government Bond	CAD 3.000.000	0,75 %	01.03.2021	2.320.603	0,03 %
Province Ontario Kanada	CAD 2.750.000	4,20 %	02.06.2020	2.312.133	0,03 %
Canadian Government Bond	CAD 3.000.000	1,50 %	01.06.2026	2.296.947	0,02 %
Province Ontario Kanada	CAD 2.700.000	3,15 %	02.06.2022	2.241.068	0,02 %
Province Ontario Kanada	CAD 2.200.000	4,60 %	02.06.2039	2.222.949	0,02 %
Province Ontario Kanada	CAD 2.800.000	2,90 %	02.12.2046	2.212.580	0,02 %
Canadian Government Bond	CAD 2.360.000	2,75 %	01.12.2064	2.161.191	0,02 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 2.400.000	3,50 %	01.12.2048	2.140.989	0,02 %
Canadian Government Bond	CAD 2.525.000	2,50 %	01.06.2024	2.081.949	0,02 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 2.500.000	3,00 %	01.09.2023	2.066.383	0,02 %
Canadian Government Bond	CAD 2.500.000	2,25 %	01.06.2025	2.030.089	0,02 %
CDP Financial, Inc.	\$ 1.950.000	4,40 %	25.11.2019	2.028.657	0,02 %
Air Canada 2017-1 Klasse AA Pass Through Trust	\$ 2.000.000	3,30 %	15.01.2030	2.020.898	0,02 %
Province Ontario Kanada	CAD 2.250.000	3,50 %	02.06.2043	1.972.788	0,02 %
Canadian Government Bond	CAD 2.370.000	2,75 %	01.06.2022	1.964.587	0,02 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 2.180.000	3,50 %	01.12.2045	1.924.827	0,02 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 1.750.000	5,00 %	01.12.2041	1.891.444	0,02 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 2.400.000	1,25 %	15.06.2021	1.868.282	0,02 %
Canadian Government Bond	CAD 1.700.000	5,75 %	01.06.2029	1.863.833	0,02 %
Agrium, Inc.	\$ 1.800.000	4,13 %	15.03.2035	1.854.029	0,02 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 2.100.000	4,25 %	01.12.2021	1.812.139	0,02 %
Province Ontario Kanada	CAD 1.600.000	5,60 %	02.06.2035	1.759.304	0,02 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 1.750.000	4,25 %	01.12.2043	1.727.122	0,02 %
Hydro-Quebec	CAD 1.475.000	5,00 %	15.02.2050	1.684.263	0,02 %
Province Ontario Kanada	\$ 1.700.000	2,25 %	18.05.2022	1.682.142	0,02 %
Province Ontario Kanada	CAD 1.650.000	4,70 %	02.06.2037	1.668.397	0,02 %
Husky Energy, Inc.	\$ 1.600.000	3,95 %	15.04.2022	1.656.539	0,02 %
Province Ontario Kanada	CAD 2.000.000	2,85 %	02.06.2023	1.639.507	0,02 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 2.000.000	1,95 %	15.06.2019	1.601.836	0,02 %
Province of Alberta Canada	\$ 1.700.000	2,05 %	17.08.2026	1.594.858	0,02 %
Canadian Government Bond	CAD 1.500.000	8,00 %	01.06.2023	1.570.945	0,02 %
Export Development Canada	AUD 2.000.000	2,40 %	07.06.2021	1.560.137	0,02 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 1.900.000	2,75 %	01.09.2025	1.541.548	0,02 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 2.000.000	1,90 %	15.09.2026	1.536.518	0,02 %
Royal Bank of Canada	€ 1.200.000	0,13 %	11.03.2021	1.448.220	0,02 %
Province Ontario Kanada	CAD 1.700.000	4,00 %	02.06.2021	1.443.036	0,02 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 1.250.000	5,75 %	01.12.2036	1.415.549	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 1.600.000	3,75 %	01.09.2024	1.381.316	0,02 %
Export Development Canada	£ 1.000.000	1,00 %	15.12.2020	1.361.372	0,02 %
Royal Bank of Canada	£ 1.000.000	1,13 %	22.12.2021	1.355.382	0,02 %
Province Ontario Kanada	CAD 1.200.000	6,20 %	02.06.2031	1.323.175	0,01 %
Royal Bank of Canada	\$ 1.300.000	2,10 %	14.10.2020	1.287.512	0,01 %
Province of Alberta Canada	CAD 1.500.000	3,30 %	01.12.2046	1.263.606	0,01 %
Hydro-Quebec	CAD 1.125.000	5,00 %	15.02.2045	1.240.180	0,01 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 1.100.000	6,25 %	01.06.2032	1.231.356	0,01 %
Intact Financial Corp.	CAD 1.600.000	2,85 %	07.06.2027	1.226.277	0,01 %
Province Ontario Kanada	CAD 1.120.000	5,85 %	08.03.2033	1.224.040	0,01 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 1.500.000	2,00 %	15.12.2019	1.202.239	0,01 %
Bank of Nova Scotia	€ 1.000.000	0,38 %	06.04.2022	1.200.068	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	\$ 1.200.000	2,50 %	18.01.2022	1.197.000	0,01 %
Bank of Montreal	€ 1.000.000	0,20 %	26.01.2023	1.196.530	0,01 %
Royal Bank of Canada	\$ 1.200.000	2,13 %	02.03.2020	1.195.099	0,01 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 1.500.000	2,50 %	01.09.2026	1.191.740	0,01 %
Canadian Government Bond	CAD 1.500.000	2,00 %	01.06.2028	1.188.016	0,01 %
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust	\$ 1.170.000	3,13 %	20.03.2022	1.179.196	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	CAD 1.500.000	1,91 %	18.07.2023	1.154.196	0,01 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 1.400.000	2,85 %	18.06.2025	1.147.599	0,01 %
HSBC Bank Canada	CAD 1.450.000	2,17 %	29.06.2022	1.135.165	0,01 %
Canadian Government Bond	CAD 1.400.000	1,50 %	01.06.2023	1.094.546	0,01 %
Province Ontario Kanada	CAD 950.000	7,60 %	02.06.2027	1.072.542	0,01 %
Bank of Montreal	\$ 1.100.000	1,75 %	15.06.2021	1.068.456	0,01 %
Bank of Nova Scotia	\$ 1.000.000	4,50 %	16.12.2025	1.052.239	0,01 %
Canadian Government Bond	CAD 1.300.000	1,75 %	01.03.2019	1.039.844	0,01 %
Canadian Government Bond	CAD 1.415.000	1,00 %	01.06.2027	1.028.824	0,01 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 950.000	5,00 %	01.12.2038	1.006.790	0,01 %
Alimentation Couche-Tard, Inc.	\$ 1.000.000	2,35 %	13.12.2019	998.554	0,01 %
Province of Alberta Canada	\$ 1.000.000	1,90 %	06.12.2019	994.114	0,01 %
Provinz Quebec (Kanada)	\$ 1.000.000	2,75 %	12.04.2027	992.324	0,01 %
Province Ontario Kanada	€ 750.000	3,00 %	28.09.2020	979.454	0,01 %
Province Ontario Kanada	\$ 975.000	2,50 %	10.09.2021	976.728	0,01 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 900.000	4,30 %	18.06.2042	903.484	0,01 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 1.100.000	2,70 %	18.12.2022	898.033	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 800.000	4,88 %	15.01.2026	896.996	0,01 %
Province Ontario Kanada	CAD 850.000	9,50 %	13.07.2022	888.709	0,01 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 1.040.000	4,50 %	01.12.2019	871.294	0,01 %
Provinz Quebec (Kanada)	€ 700.000	0,88 %	15.01.2025	859.557	0,01 %
Canadian Government Bond	CAD 700.000	8,00 %	01.06.2027	842.453	0,01 %
Canadian Government Bond	CAD 700.000	9,00 %	01.06.2025	826.955	0,01 %
Agrium, Inc.	\$ 700.000	5,25 %	15.01.2045	815.123	0,01 %
Royal Bank of Canada^	CAD 1.000.000	3,31 %	20.01.2026	810.431	0,01 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 1.000.000	2,40 %	15.12.2022	807.502	0,01 %
Province of Alberta Canada	CAD 1.015.000	2,55 %	01.06.2027	802.068	0,01 %
Province Ontario Kanada	\$ 800.000	2,40 %	08.02.2022	797.367	0,01 %
Export Development Canada	AUD 1.000.000	3,50 %	05.06.2019	797.231	0,01 %
Inter Pipeline Ltd.	CAD 1.000.000	3,48 %	16.12.2026	795.547	0,01 %
Bank of Montreal	\$ 800.000	2,10 %	15.06.2020	794.338	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	\$ 800.000	1,95 %	02.04.2020	792.072	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	CAD 1.000.000	2,05 %	08.03.2021	790.981	0,01 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 1.000.000	1,45 %	15.06.2020	790.494	0,01 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	CAD 1.000.000	2,30 %	11.07.2022	790.183	0,01 %
Municipal Finance Authority of British Columbia	CAD 1.000.000	2,50 %	19.04.2026	789.377	0,01 %
Royal Bank of Canada	CAD 1.000.000	2,03 %	15.03.2021	788.858	0,01 %
Province of Manitoba Canada	CAD 1.000.000	1,15 %	21.11.2019	788.180	0,01 %
Province Ontario Kanada	CAD 1.000.000	2,40 %	02.06.2026	787.573	0,01 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	CAD 1.000.000	2,04 %	21.03.2022	784.014	0,01 %
Royal Bank of Canada	CAD 1.000.000	1,97 %	02.03.2022	781.923	0,01 %
Bank of Nova Scotia	CAD 1.000.000	1,90 %	02.12.2021	781.364	0,01 %
PSP Capital, Inc.	CAD 1.000.000	1,73 %	21.06.2022	781.220	0,01 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 925.000	3,50 %	01.12.2022	781.158	0,01 %
Province Ontario Kanada	CAD 750.000	8,10 %	08.09.2023	779.666	0,01 %
Bank of Nova Scotia	CAD 1.000.000	2,29 %	28.06.2024	777.469	0,01 %
Province of Alberta Canada	CAD 1.000.000	1,35 %	01.09.2021	777.198	0,01 %
Emera US Finance LP	\$ 700.000	4,75 %	15.06.2046	768.028	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Hydro-Quebec	CAD 725.000	9,63 %	15.07.2022	760.887	0,01 %
Province Ontario Kanada	CAD 700.000	6,50 %	08.03.2029	760.326	0,01 %
Canadian Government Bond	CAD 900.000	3,25 %	01.06.2021	752.927	0,01 %
Hydro-Quebec	CAD 625.000	6,00 %	15.02.2040	746.638	0,01 %
CPPIB Capital, Inc.	\$ 750.000	1,25 %	20.09.2019	739.031	0,01 %
Export Development Canada	\$ 750.000	1,50 %	26.05.2021	732.547	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	€ 600.000	0,63 %	29.07.2019	731.325	0,01 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 825.000	3,20 %	18.06.2044	697.130	0,01 %
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust	\$ 670.000	3,88 %	20.03.2027	684.077	0,01 %
Hydro-Quebec	CAD 575.000	6,50 %	15.02.2035	683.740	0,01 %
Province Ontario Kanada	CAD 850.000	2,10 %	08.09.2019	681.852	0,01 %
Bank of Nova Scotia	CAD 800.000	3,27 %	11.01.2021	655.305	0,01 %
Bell Canada, Inc.	CAD 800.000	3,35 %	18.06.2019	649.367	0,01 %
City of Montreal Canada	CAD 750.000	4,50 %	01.12.2021	648.803	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 625.000	3,80 %	01.10.2020	647.601	0,01 %
Canadian Natural Resources Ltd.	\$ 500.000	6,75 %	01.02.2039	640.582	0,01 %
Province of Alberta Canada	CAD 825.000	2,20 %	01.06.2026	637.672	0,01 %
Bank of Montreal	\$ 650.000	2,50 %	11.01.2022	635.484	0,01 %
Provinz Neubraunschweig	CAD 750.000	4,50 %	02.06.2020	634.431	0,01 %
Encana Corp.	\$ 500.000	6,63 %	15.08.2037	634.165	0,01 %
Rogers Communications, Inc.	CAD 750.000	4,00 %	13.03.2024	633.677	0,01 %
Canada Government International Bond	\$ 640.000	2,00 %	15.11.2022	631.064	0,01 %
Bank of Nova Scotia^	CAD 800.000	2,58 %	30.03.2027	628.035	0,01 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 800.000	1,95 %	15.12.2025	620.047	0,01 %
Canada Government International Bond	\$ 620.000	1,63 %	27.02.2019	618.604	0,01 %
Bank of Montreal	€ 500.000	0,75 %	21.09.2022	615.767	0,01 %
Province of Manitoba Canada	CAD 800.000	2,85 %	05.09.2046	613.471	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	€ 500.000	0,38 %	12.01.2021	608.495	0,01 %
Canadian Government Bond	CAD 800.000	0,50 %	01.03.2022	604.545	0,01 %
Canadian Imperial Bank of Commerce^	CAD 750.000	3,00 %	28.10.2024	603.645	0,01 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 750.000	2,35 %	15.09.2023	603.262	0,01 %
Bank of Montreal^	\$ 600.000	3,80 %	15.12.2032	598.853	0,01 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 500.000	6,75 %	15.11.2039	596.875	0,01 %
Province Ontario Kanada	\$ 600.000	1,88 %	21.05.2020	594.954	0,01 %
Province Ontario Kanada	CAD 700.000	4,40 %	02.06.2019	579.314	0,01 %
Enbridge, Inc.	\$ 550.000	4,25 %	01.12.2026	573.855	0,01 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 700.000	2,65 %	15.03.2022	571.565	0,01 %
Loblaw Cos Ltd.	CAD 700.000	3,75 %	12.03.2019	569.375	0,01 %
Bank of Montreal^	CAD 700.000	3,32 %	01.06.2026	567.766	0,01 %
Royal Bank of Canada^	CAD 700.000	2,99 %	06.12.2024	566.095	0,01 %
Province of Alberta Canada	CAD 700.000	2,55 %	15.12.2022	565.738	0,01 %
Province of Alberta Canada	CAD 700.000	3,05 %	01.12.2048	564.570	0,01 %
Canadian Natural Resources Ltd.	CAD 700.000	2,89 %	14.08.2020	563.363	0,01 %
CDP Financial, Inc.	\$ 550.000	3,15 %	24.07.2024	558.664	0,01 %
HSBC Bank Canada	CAD 700.000	2,45 %	29.01.2021	558.296	0,01 %
Bank of Montreal	CAD 700.000	2,12 %	16.03.2022	550.614	0,01 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 700.000	1,20 %	15.06.2020	550.022	0,01 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 650.000	2,90 %	15.06.2024	538.655	0,01 %
Province of Alberta Canada	CAD 600.000	3,90 %	01.12.2033	538.221	0,01 %
Enbridge, Inc.	CAD 700.000	4,24 %	27.08.2042	535.820	0,01 %
Canadian Pacific Railway Co.	\$ 500.000	7,25 %	15.05.2019	532.581	0,01 %
Canadian Imperial Bank of Commerce^	CAD 650.000	3,42 %	26.01.2026	528.176	0,01 %
Royal Bank of Canada	CAD 650.000	2,86 %	04.03.2021	526.350	0,01 %
Municipal Finance Authority of British Columbia	CAD 650.000	2,05 %	02.06.2019	520.643	0,01 %
Provinz Neubraunschweig	CAD 600.000	3,55 %	03.06.2043	515.590	0,01 %
CPPIB Capital, Inc.	CAD 650.000	1,10 %	10.06.2019	513.655	0,01 %
Shaw Communications, Inc.	CAD 500.000	6,75 %	09.11.2039	512.155	0,01 %
TELUS Corp.	CAD 650.000	2,35 %	28.03.2022	511.876	0,01 %
Methanex Corp.	\$ 500.000	4,25 %	01.12.2024	505.226	0,01 %
Toronto-Dominion Bank^	\$ 500.000	3,63 %	15.09.2031	499.239	0,01 %
Bank of Nova Scotia	\$ 500.000	2,70 %	07.03.2022	499.114	0,01 %
Provinz Quebec (Kanada)	\$ 500.000	2,38 %	31.01.2022	498.426	0,01 %
National Bank of Canada	\$ 500.000	2,15 %	12.06.2020	497.650	0,01 %
Hydro-Quebec	CAD 500.000	4,00 %	15.02.2055	496.939	0,01 %
Export Development Canada	\$ 500.000	1,50 %	04.04.2019	496.838	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 500.000	2,50 %	01.08.2022	495.829	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Bell Canada, Inc.	CAD 600.000	4,45 %	27.02.2047	494.902	0,01 %
Encana Corp.	\$ 400.000	6,50 %	15.08.2034	494.824	0,01 %
Province of Manitoba Canada	CAD 500.000	4,40 %	05.03.2042	489.828	0,01 %
Bank of Montreal	\$ 500.000	1,90 %	27.08.2021	489.339	0,01 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 600.000	2,55 %	15.03.2025	486.422	0,01 %
HSBC Bank Canada	CAD 600.000	2,94 %	14.01.2020	484.990	0,01 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 600.000	2,75 %	01.09.2027	484.980	0,01 %
Toronto-Dominion Bank^	CAD 600.000	2,98 %	30.09.2025	483.510	0,01 %
Fortis Inc	\$ 500.000	3,06 %	04.10.2026	482.500	0,01 %
Caisse Centrale Desjardins	CAD 600.000	1,75 %	02.03.2020	473.971	0,01 %
Province of Alberta Canada	CAD 550.000	3,45 %	01.12.2043	473.857	0,01 %
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd.	CAD 600.000	2,10 %	23.02.2022	468.900	0,01 %
Bank of Nova Scotia	\$ 465.000	2,80 %	21.07.2021	468.687	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	CAD 530.000	4,55 %	15.11.2041	464.282	0,01 %
Ontario Electricity Financial Corp.	CAD 450.000	10,13 %	15.10.2021	461.593	0,01 %
Provinz Saskatchewan	CAD 600.000	2,75 %	02.12.2046	455.353	0,01 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 575.000	2,80 %	18.06.2048	452.226	0,01 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 400.000	4,90 %	18.06.2048	450.077	0,01 %
Bank of Montreal	\$ 450.000	1,50 %	18.07.2019	445.701	0,01 %
Ontario Teachers' Finance Trust	\$ 450.000	2,13 %	19.09.2022	441.461	0,01 %
Toronto-Dominion Bank^	CAD 500.000	4,86 %	04.03.2031	439.786	0,01 %
Bell Canada, Inc.	CAD 500.000	4,75 %	29.09.2044	430.632	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 325.000	6,20 %	15.10.2037	428.245	0,01 %
City of Toronto Canada	CAD 500.000	3,90 %	29.09.2023	428.110	0,01 %
Provinz Saskatchewan	CAD 500.000	3,30 %	02.06.2048	422.898	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	CAD 500.000	3,69 %	19.07.2023	420.867	0,01 %
Province of Manitoba Canada	CAD 500.000	3,30 %	02.06.2024	418.875	0,01 %
Export Development Canada	\$ 415.000	2,00 %	30.11.2020	413.379	0,01 %
SSL Finance, Inc./SSL Financement, Inc.	CAD 500.000	4,10 %	31.10.2045	412.578	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	CAD 500.000	3,23 %	24.07.2024	411.641	0,01 %
Pembina Pipeline Corp.	CAD 500.000	4,81 %	25.03.2044	406.349	0,01 %
Province of Newfoundland & Labrador Canada	CAD 500.000	3,00 %	02.06.2026	405.431	0,01 %
Financement-Quebec	CAD 500.000	2,45 %	01.12.2019	403.444	0,01 %
Pembina Pipeline Corp.	CAD 500.000	3,54 %	03.02.2025	402.734	0,01 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 500.000	2,25 %	01.03.2019	401.963	0,01 %
Province of Nova Scotia Canada	CAD 450.000	3,50 %	02.06.2062	401.522	0,01 %
Bank of Nova Scotia	CAD 500.000	2,40 %	28.10.2019	401.173	0,01 %
Provinz Quebec (Kanada)	\$ 400.000	2,63 %	13.02.2023	400.762	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	\$ 400.000	2,25 %	25.09.2019	400.041	0,01 %
Bank of Nova Scotia	\$ 400.000	2,35 %	21.10.2020	399.036	0,00 %
Federation des Caisses Desjardins du Quebec	\$ 400.000	2,25 %	30.10.2020	397.618	0,00 %
Husky Energy, Inc.	CAD 500.000	3,60 %	10.03.2027	396.927	0,00 %
Brookfield Renewable Partners ULC	CAD 500.000	3,63 %	15.01.2027	396.440	0,00 %
John Deere Canada Funding, Inc.	CAD 500.000	2,05 %	17.09.2020	396.432	0,00 %
First Capital Realty, Inc.	CAD 500.000	3,60 %	06.05.2026	395.511	0,00 %
Cameco Corp.	CAD 500.000	4,19 %	24.06.2024	394.421	0,00 %
Province of Alberta Canada	CAD 500.000	2,35 %	01.06.2025	393.815	0,00 %
Bank of Montreal	CAD 500.000	2,70 %	09.12.2026	393.787	0,00 %
Bank of Montreal	CAD 500.000	1,88 %	31.03.2021	393.017	0,00 %
Toyota Credit Canada, Inc.	CAD 500.000	2,02 %	28.02.2022	391.791	0,00 %
Bank of Nova Scotia	CAD 500.000	2,62 %	02.12.2026	391.376	0,00 %
Canadian Natural Resources Ltd.	\$ 350.000	4,95 %	01.06.2047	387.520	0,00 %
Bank of Montreal	CAD 500.000	1,61 %	28.10.2021	387.110	0,00 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 500.000	1,15 %	15.12.2021	385.458	0,00 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 300.000	5,85 %	15.03.2036	375.994	0,00 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 350.000	4,95 %	18.06.2040	375.671	0,00 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 350.000	6,00 %	01.10.2029	370.280	0,00 %
Province of Newfoundland & Labrador Canada	CAD 425.000	3,70 %	17.10.2048	369.853	0,00 %
Royal Bank of Canada	€ 300.000	0,50 %	16.12.2020	366.378	0,00 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 300.000	5,60 %	31.03.2034	366.018	0,00 %
Province of Manitoba Canada	CAD 450.000	3,15 %	05.09.2052	365.319	0,00 %
Toronto-Dominion Bank	€ 300.000	0,25 %	27.04.2022	361.967	0,00 %
Province of Manitoba Canada	\$ 350.000	3,05 %	14.05.2024	356.699	0,00 %
Provinz Quebec (Kanada)	\$ 250.000	7,50 %	15.09.2029	354.075	0,00 %
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd.	CAD 425.000	4,05 %	22.07.2044	352.764	0,00 %
Air Canada 2015-1 Klasse A Pass Through Trust	\$ 346.558	3,60 %	15.03.2027	350.457	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Enbridge Pipelines, Inc.	CAD 400.000	4,55 %	29.09.2045	348.387	0,00 %
CPPIB Capital, Inc.	\$ 350.000	2,25 %	25.01.2022	347.781	0,00 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 400.000	4,50 %	01.12.2020	341.763	0,00 %
Ontario Electricity Financial Corp.	CAD 300.000	9,00 %	26.05.2025	340.747	0,00 %
Canadian Pacific Railway Co.	\$ 265.000	5,95 %	15.05.2037	340.730	0,00 %
Hydro One, Inc.	CAD 300.000	6,93 %	01.06.2032	337.895	0,00 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 300.000	6,35 %	18.06.2031	336.705	0,00 %
Provinz Saskatchewan	CAD 400.000	3,20 %	03.06.2024	333.996	0,00 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 400.000	3,35 %	15.12.2020	332.262	0,00 %
Province of Manitoba Canada	CAD 400.000	3,25 %	05.09.2029	331.997	0,00 %
TELUS Corp.	CAD 400.000	3,75 %	17.01.2025	331.116	0,00 %
Greater Toronto Airports Authority	CAD 300.000	5,30 %	25.02.2041	325.169	0,00 %
Province of Alberta Canada	CAD 400.000	2,90 %	20.09.2029	322.698	0,00 %
Great-West Lifeco, Inc.	CAD 300.000	6,00 %	16.11.2039	317.258	0,00 %
Barrick North America Finance LLC	\$ 250.000	5,75 %	01.05.2043	312.142	0,00 %
Saputo, Inc.	CAD 400.000	1,94 %	13.06.2022	309.478	0,00 %
Goldcorp, Inc.	\$ 300.000	3,70 %	15.03.2023	307.696	0,00 %
Barrick North America Finance LLC	\$ 250.000	5,70 %	30.05.2041	305.794	0,00 %
Province of Nova Scotia Canada	CAD 300.000	4,90 %	01.06.2035	303.165	0,00 %
Provinz Quebec (Kanada)	\$ 300.000	2,88 %	16.10.2024	303.146	0,00 %
Royal Bank of Canada	\$ 300.000	2,75 %	01.02.2022	302.833	0,00 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 300.000	5,20 %	15.09.2043	301.500	0,00 %
Province of Manitoba Canada	\$ 300.000	1,75 %	30.05.2019	298.247	0,00 %
Province Ontario Kanada	\$ 300.000	1,65 %	27.09.2019	297.493	0,00 %
Royal Bank of Canada	\$ 300.000	1,88 %	05.02.2020	297.333	0,00 %
Province of Alberta Canada	\$ 300.000	1,75 %	26.08.2020	295.639	0,00 %
Manulife Financial Corp.	\$ 280.000	4,15 %	04.03.2026	295.586	0,00 %
Province of Nova Scotia Canada	CAD 350.000	4,15 %	25.11.2019	291.266	0,00 %
CU, Inc.	CAD 300.000	4,72 %	09.09.2043	288.732	0,00 %
TELUS Corp.	CAD 350.000	3,75 %	10.03.2026	287.154	0,00 %
Financement-Quebec	CAD 275.000	5,25 %	01.06.2034	284.275	0,00 %
Province of Manitoba Canada	CAD 300.000	4,05 %	05.09.2045	283.651	0,00 %
Muskkrat Falls/Labrador Transmission Assets Funding Trust	CAD 300.000	3,86 %	01.12.2048	282.519	0,00 %
CU, Inc.	CAD 300.000	4,54 %	24.10.2041	280.110	0,00 %
Suncor Energy, Inc.	\$ 200.000	6,85 %	01.06.2039	277.036	0,00 %
Toronto-Dominion Bank	\$ 275.000	2,25 %	05.11.2019	275.327	0,00 %
Petro-Canada	\$ 200.000	6,80 %	15.05.2038	274.279	0,00 %
Export Development Canada	£ 200.000	1,38 %	16.12.2019	274.108	0,00 %
City of Montreal Canada	CAD 300.000	4,10 %	01.12.2034	272.235	0,00 %
Manulife Finance Delaware LP^	CAD 300.000	5,06 %	15.12.2041	270.755	0,00 %
Provinz Saskatchewan	CAD 260.000	4,75 %	01.06.2040	267.116	0,00 %
Regional Municipality of York	CAD 300.000	4,00 %	31.05.2032	266.094	0,00 %
Muskkrat Falls/Labrador Transmission Assets Funding Trust	CAD 300.000	3,63 %	01.06.2029	260.790	0,00 %
407 International, Inc.	CAD 250.000	5,75 %	14.02.2036	259.480	0,00 %
AltaLink LP	CAD 300.000	3,99 %	30.06.2042	259.176	0,00 %
Brookfield Asset Management, Inc.	CAD 300.000	4,54 %	31.03.2023	256.363	0,00 %
Province Ontario Kanada	CAD 250.000	7,50 %	07.02.2024	256.185	0,00 %
TELUS Corp.	CAD 300.000	4,85 %	05.04.2044	254.905	0,00 %
WestJet Airlines Ltd.	\$ 250.000	3,50 %	16.06.2021	251.985	0,00 %
Agrium, Inc.	\$ 250.000	3,38 %	15.03.2025	250.795	0,00 %
Bruce Power LP	CAD 300.000	4,01 %	21.06.2029	249.654	0,00 %
Canadian Natural Resources Ltd.	\$ 200.000	6,25 %	15.03.2038	249.359	0,00 %
Province Ontario Kanada	\$ 250.000	1,63 %	18.01.2019	249.132	0,00 %
Bank of Nova Scotia	\$ 250.000	2,13 %	11.09.2019	249.099	0,00 %
Canadian Natural Resources Ltd.	\$ 200.000	6,50 %	15.02.2037	249.028	0,00 %
Schlumberger Finance Canada Ltd.	\$ 250.000	2,20 %	20.11.2020	248.759	0,00 %
Export Development Canada	\$ 250.000	1,63 %	03.12.2019	248.230	0,00 %
Enbridge, Inc.	\$ 250.000	2,90 %	15.07.2022	247.954	0,00 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	\$ 250.000	2,35 %	27.07.2022	246.742	0,00 %
Bank of Nova Scotia	€ 200.000	0,75 %	17.09.2021	246.410	0,00 %
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	\$ 200.000	5,88 %	01.12.2036	244.187	0,00 %
Provinz Quebec (Kanada)	\$ 200.000	7,50 %	15.07.2023	243.806	0,00 %
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	\$ 250.000	3,00 %	01.04.2025	243.750	0,00 %
Bank of Montreal	€ 200.000	0,38 %	05.08.2020	243.404	0,00 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	€ 200.000	0,38 %	15.10.2019	243.044	0,00 %
Caisse Centrale Desjardins	€ 200.000	0,38 %	22.10.2019	242.896	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Province of Newfoundland & Labrador Canada	CAD 300.000	3,30 %	17.10.2046	242.054	0,00 %
Thomson Reuters Corp.	\$ 200.000	5,65 %	23.11.2043	240.714	0,00 %
Provinz Neubraunschweig	CAD 235.000	4,80 %	03.06.2041	240.317	0,00 %
RioCan	CAD 300.000	3,29 %	12.02.2024	239.272	0,00 %
Provinz Neubraunschweig	CAD 300.000	3,10 %	14.08.2048	239.002	0,00 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 300.000	2,25 %	15.12.2025	237.697	0,00 %
National Bank of Canada	CAD 300.000	2,11 %	18.03.2022	235.829	0,00 %
Hydro One, Inc.	CAD 250.000	4,59 %	09.10.2043	233.702	0,00 %
Goldcorp, Inc.	\$ 200.000	5,45 %	09.06.2044	231.796	0,00 %
Provinz Neubraunschweig	CAD 300.000	2,35 %	14.08.2027	231.447	0,00 %
Plenary Properties LTAP LP	CAD 216.390	6,29 %	31.01.2044	229.874	0,00 %
Ontario Electricity Financial Corp.	CAD 200.000	8,25 %	22.06.2026	225.896	0,00 %
Province of Newfoundland & Labrador Canada	CAD 230.000	4,65 %	17.10.2040	225.842	0,00 %
Canadian Pacific Railway Co.	CAD 200.000	6,45 %	17.11.2039	223.647	0,00 %
Province of Manitoba Canada	CAD 250.000	3,45 %	05.03.2063	219.594	0,00 %
Province of Nova Scotia Canada	CAD 200.000	5,80 %	01.06.2033	216.813	0,00 %
Hydro-Quebec	CAD 200.000	6,00 %	15.08.2031	215.784	0,00 %
Provinz Saskatchewan	CAD 250.000	3,40 %	03.02.2042	212.928	0,00 %
Thomson Reuters Corp.	\$ 200.000	4,30 %	23.11.2023	211.335	0,00 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 200.000	5,40 %	15.06.2047	209.000	0,00 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 200.000	5,70 %	18.06.2029	206.894	0,00 %
Brookfield Finance LLC	\$ 200.000	4,00 %	01.04.2024	205.846	0,00 %
Provinz Saskatchewan	CAD 200.000	5,75 %	05.03.2029	204.945	0,00 %
Province of Nova Scotia Canada	CAD 200.000	4,70 %	01.06.2041	204.674	0,00 %
Canadian Natural Resources Ltd.	\$ 200.000	3,85 %	01.06.2027	204.206	0,00 %
407 International, Inc.	CAD 250.000	3,60 %	21.05.2047	203.256	0,00 %
Rogers Communications, Inc.	CAD 200.000	6,11 %	25.08.2040	201.500	0,00 %
Rogers Communications, Inc.	\$ 175.000	5,00 %	15.03.2044	200.947	0,00 %
Hydro One, Inc.	CAD 200.000	5,36 %	20.05.2036	200.444	0,00 %
Alimentation Couche-Tard, Inc.	\$ 200.000	3,55 %	26.07.2027	199.764	0,00 %
Bank of Nova Scotia	\$ 200.000	2,15 %	14.07.2020	199.125	0,00 %
Canadian Natural Resources Ltd.	\$ 200.000	2,95 %	15.01.2023	198.843	0,00 %
Toronto-Dominion Bank	\$ 200.000	2,25 %	15.03.2021	198.561	0,00 %
National Bank of Canada	\$ 200.000	2,20 %	02.11.2020	198.481	0,00 %
Thomson Reuters Corp.	\$ 200.000	3,35 %	15.05.2026	198.344	0,00 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	\$ 200.000	2,10 %	05.10.2020	198.304	0,00 %
Canadian National Railway Co.	\$ 200.000	2,75 %	01.03.2026	197.622	0,00 %
Province of Nova Scotia Canada	CAD 200.000	4,40 %	01.06.2042	197.591	0,00 %
Alimentation Couche-Tard, Inc.	\$ 200.000	2,70 %	26.07.2022	197.585	0,00 %
Province Ontario Kanada	\$ 200.000	1,25 %	17.06.2019	197.567	0,00 %
Canada Post Corp.	CAD 200.000	4,36 %	16.07.2040	196.225	0,00 %
Province Ontario Kanada	\$ 200.000	2,50 %	27.04.2026	195.944	0,00 %
Fortis, Inc.	\$ 200.000	2,10 %	04.10.2021	195.079	0,00 %
Provinz Neubraunschweig	CAD 200.000	4,65 %	26.09.2035	194.975	0,00 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 180.000	5,40 %	18.06.2035	194.929	0,00 %
Metro, Inc.	CAD 200.000	5,97 %	15.10.2035	194.380	0,00 %
Provinz Neubraunschweig	CAD 200.000	4,55 %	26.03.2037	194.119	0,00 %
Province of Manitoba Canada	CAD 200.000	4,10 %	05.03.2041	187.431	0,00 %
Manulife Financial Corp.	\$ 150.000	5,38 %	04.03.2046	187.201	0,00 %
Brookfield Asset Management, Inc.	CAD 200.000	5,95 %	14.06.2035	187.035	0,00 %
Provinz Saskatchewan	CAD 200.000	3,90 %	02.06.2045	186.137	0,00 %
Labrador-Island Link Funding Trust	CAD 200.000	3,86 %	01.12.2045	185.960	0,00 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 125.000	7,25 %	15.08.2038	181.809	0,00 %
Provinz Neubraunschweig	CAD 200.000	3,80 %	14.08.2045	179.895	0,00 %
TELUS Corp.	\$ 175.000	3,70 %	15.09.2027	178.945	0,00 %
Union Gas Ltd.	CAD 200.000	4,20 %	02.06.2044	177.613	0,00 %
Petro-Canada	\$ 150.000	5,35 %	15.07.2033	176.433	0,00 %
Hydro-Quebec	CAD 150.000	6,50 %	16.01.2035	176.377	0,00 %
Fairfax Financial Holdings Ltd.	CAD 200.000	5,84 %	14.10.2022	176.256	0,00 %
Manulife Financial Corp.^	\$ 175.000	4,06 %	24.02.2032	176.227	0,00 %
Hydro One, Inc.	CAD 200.000	4,17 %	06.06.2044	176.111	0,00 %
CU, Inc.	CAD 200.000	4,09 %	02.09.2044	175.922	0,00 %
Yamana Gold, Inc.	\$ 175.000	4,63 %	15.12.2027	174.563	0,00 %
Schlumberger Finance Canada Ltd.	\$ 175.000	2,65 %	20.11.2022	173.928	0,00 %
Maritime Link Financing Trust	CAD 200.000	3,50 %	01.12.2052	170.122	0,00 %
Capital City Link General Partnership	CAD 197.495	4,39 %	31.03.2046	170.035	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
AltaLink LP	CAD 200.000	3,67 %	06.11.2023	169.255	0,00 %
Teranet Holdings LP	CAD 200.000	5,75 %	17.12.2040	168.813	0,00 %
Hydro One, Inc.	CAD 200.000	3,72 %	18.11.2047	164.348	0,00 %
Barrick North America Finance LLC	\$ 151.000	4,40 %	30.05.2021	159.733	0,00 %
Manulife Financial Corp.	\$ 150.000	4,90 %	17.09.2020	158.674	0,00 %
Nova Scotia Power, Inc.	CAD 150.000	5,61 %	15.06.2040	156.845	0,00 %
Province Ontario Kanada	CAD 200.000	1,35 %	08.03.2022	154.397	0,00 %
Province of Newfoundland & Labrador Canada	CAD 150.000	6,15 %	17.04.2028	153.674	0,00 %
Suncor Energy, Inc.	\$ 150.000	4,00 %	15.11.2047	153.565	0,00 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 150.000	4,70 %	18.06.2037	152.969	0,00 %
TransAlta Corp.	\$ 150.000	4,50 %	15.11.2022	152.321	0,00 %
Provinz Neubraunschweig	CAD 150.000	4,80 %	26.09.2039	151.986	0,00 %
Province of Manitoba Canada	CAD 150.000	4,65 %	05.03.2040	150.721	0,00 %
Enbridge, Inc.	\$ 150.000	3,70 %	15.07.2027	150.304	0,00 %
Rogers Communications, Inc.	\$ 150.000	3,00 %	15.03.2023	150.106	0,00 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 150.000	2,13 %	15.11.2019	149.541	0,00 %
Province of Manitoba Canada	CAD 150.000	4,60 %	05.03.2038	148.373	0,00 %
Newfoundland & Labrador Hydro	CAD 175.000	3,60 %	01.12.2045	147.637	0,00 %
Hydro-Quebec	\$ 100.000	8,50 %	01.12.2029	147.311	0,00 %
Provinz Britisch-Kolumbien	\$ 150.000	2,25 %	02.06.2026	145.230	0,00 %
Export Development Canada	\$ 150.000	1,38 %	21.10.2021	145.219	0,00 %
Rogers Communications, Inc.	\$ 100.000	7,50 %	15.08.2038	140.977	0,00 %
Husky Energy, Inc.	\$ 125.000	7,25 %	15.12.2019	135.649	0,00 %
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	\$ 125.000	4,88 %	30.03.2020	130.663	0,00 %
Province Ontario Kanada	€ 100.000	1,88 %	21.05.2024	130.628	0,00 %
Regional Municipality of Peel Ontario	CAD 125.000	5,10 %	29.06.2040	130.584	0,00 %
Thomson Reuters Corp.	\$ 125.000	3,95 %	30.09.2021	129.103	0,00 %
Provinz Quebec (Kanada)	\$ 125.000	3,50 %	29.07.2020	128.949	0,00 %
Province Ontario Kanada	\$ 125.000	4,00 %	07.10.2019	128.944	0,00 %
Provinz Quebec (Kanada)	\$ 125.000	2,75 %	25.08.2021	126.321	0,00 %
Provinz Britisch-Kolumbien	\$ 125.000	2,65 %	22.09.2021	126.305	0,00 %
National Bank of Canada	€ 100.000	1,50 %	25.03.2021	125.967	0,00 %
Royal Bank of Canada	€ 100.000	1,63 %	04.08.2020	125.570	0,00 %
Royal Bank of Canada	€ 100.000	0,88 %	17.06.2022	123.886	0,00 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	\$ 125.000	1,60 %	06.09.2019	123.644	0,00 %
Provinz Britisch-Kolumbien	\$ 125.000	2,00 %	23.10.2022	122.548	0,00 %
Toronto-Dominion Bank	€ 100.000	0,50 %	15.06.2020	122.102	0,00 %
Caisse Centrale Desjardins	€ 100.000	0,38 %	25.11.2020	121.622	0,00 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	€ 100.000	0,25 %	28.01.2020	121.331	0,00 %
Thomson Reuters Corp.	\$ 100.000	5,85 %	15.04.2040	121.197	0,00 %
Bank of Nova Scotia	€ 100.000	0,38 %	10.03.2023	120.747	0,00 %
CPPIB Capital, Inc.	CAD 150.000	1,00 %	15.01.2019	118.917	0,00 %
Hydro-Quebec	CAD 150.000	1,00 %	25.05.2019	118.532	0,00 %
City of Ottawa Ontario	CAD 150.000	3,10 %	27.07.2048	117.874	0,00 %
City of Toronto Canada	CAD 150.000	2,95 %	28.04.2035	117.321	0,00 %
Thomson Reuters Corp.	\$ 100.000	5,50 %	15.08.2035	114.128	0,00 %
Newfoundland & Labrador Hydro	CAD 100.000	6,65 %	27.08.2031	110.836	0,00 %
Provinz Neubraunschweig	\$ 110.000	2,50 %	12.12.2022	109.633	0,00 %
Magna International, Inc.	\$ 100.000	4,15 %	01.10.2025	106.435	0,00 %
City of Toronto Canada	CAD 100.000	5,20 %	01.06.2040	105.720	0,00 %
Air Canada 2013-1 Klasse A Pass Through Trust	\$ 101.153	4,13 %	15.05.2025	105.325	0,00 %
Provinz Neubraunschweig	CAD 100.000	5,50 %	27.01.2034	105.134	0,00 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 100.000	5,70 %	15.10.2019	105.125	0,00 %
Alimentation Couche-Tard, Inc.	\$ 100.000	4,50 %	26.07.2047	104.464	0,00 %
Great-West Lifeco Finance Delaware LP	\$ 100.000	4,15 %	03.06.2047	104.462	0,00 %
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	\$ 100.000	4,00 %	15.12.2026	103.653	0,00 %
Husky Energy, Inc.	\$ 100.000	4,00 %	15.04.2024	103.611	0,00 %
Hydro One, Inc.	CAD 100.000	5,49 %	16.07.2040	103.594	0,00 %
Magna International, Inc.	\$ 100.000	3,63 %	15.06.2024	103.198	0,00 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 100.000	5,25 %	15.06.2037	102.500	0,00 %
Export Development Canada	CAD 130.000	1,80 %	01.09.2022	102.490	0,00 %
Brookfield Asset Management, Inc.	\$ 100.000	4,00 %	15.01.2025	102.063	0,00 %
Agrium, Inc.	\$ 100.000	3,15 %	01.10.2022	101.077	0,00 %
Emera US Finance LP	\$ 100.000	3,55 %	15.06.2026	100.111	0,00 %
Royal Bank of Canada	\$ 100.000	2,35 %	30.10.2020	99.920	0,00 %
City of Toronto Canada	CAD 100.000	4,70 %	10.06.2041	99.805	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Emera US Finance LP	\$ 100.000	2,70 %	15.06.2021	99.429	0,00 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 100.000	4,25 %	15.04.2027	99.250	0,00 %
City of Toronto Canada	CAD 125.000	2,40 %	07.06.2027	96.394	0,00 %
Canadian National Railway Co.	\$ 100.000	3,20 %	02.08.2046	95.588	0,00 %
Labrador-Island Link Funding Trust	CAD 100.000	3,85 %	01.12.2053	95.321	0,00 %
Provinz Saskatchewan	CAD 100.000	3,75 %	05.03.2054	93.081	0,00 %
Rogers Communications, Inc.	\$ 85.000	4,50 %	15.03.2043	90.949	0,00 %
Regional Municipality of York	CAD 100.000	4,05 %	01.05.2034	89.688	0,00 %
City of Toronto Canada	CAD 100.000	3,25 %	24.06.2046	80.686	0,00 %
Toronto-Dominion Bank	CAD 100.000	2,62 %	22.12.2021	80.397	0,00 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 100.000	2,55 %	18.06.2027	79.737	0,00 %
Royal Bank of Canada	CAD 100.000	1,40 %	26.04.2019	79.281	0,00 %
Canadian Pacific Railway Co.	\$ 75.000	2,90 %	01.02.2025	74.219	0,00 %
Bank of Nova Scotia	\$ 75.000	1,85 %	14.04.2020	74.183	0,00 %
Canadian National Railway Co.	\$ 50.000	6,38 %	15.11.2037	69.888	0,00 %
Province Ontario Kanada	€ 50.000	4,00 %	03.12.2019	65.043	0,00 %
Provinz Quebec (Kanada)	€ 50.000	5,00 %	29.04.2019	64.327	0,00 %
Province Ontario Kanada	€ 50.000	4,75 %	23.04.2019	64.087	0,00 %
Province Ontario Kanada	\$ 50.000	3,20 %	16.05.2024	51.512	0,00 %
Emera US Finance LP	\$ 50.000	2,15 %	15.06.2019	49.729	0,00 %
Rogers Communications, Inc.	\$ 50.000	2,90 %	15.11.2026	48.343	0,00 %
CCL Industries, Inc.	\$ 50.000	3,25 %	01.10.2026	47.952	0,00 %
National Bank of Canada	CAD 50.000	1,74 %	03.03.2020	39.492	0,00 %
Federation des Caisses Desjardins du Quebec	CAD 50.000	2,09 %	17.01.2022	39.304	0,00 %
				344.205.071	3,62 %
Kaimaninseln 0,03 % (2016: 0,04 %)					
IPIC GMTN Ltd.	€ 600.000	5,88 %	14.03.2021	847.166	0,01 %
IPIC GMTN Ltd.	\$ 700.000	5,50 %	01.03.2022	769.547	0,01 %
ADCB Finance Cayman Ltd.	\$ 575.000	2,75 %	16.09.2019	573.551	0,01 %
JD.com, Inc.	\$ 200.000	3,88 %	29.04.2026	200.707	0,00 %
ADCB Finance Cayman Ltd.	\$ 200.000	2,63 %	10.03.2020	198.498	0,00 %
				2.589.469	0,03 %
Chile 0,13 % (2016: 0,12 %)					
Empresa Nacional del Petroleo	\$ 1.250.000	4,50 %	14.09.2047	1.195.897	0,01 %
Corp. Nacional del Cobre de Chile	\$ 1.000.000	4,50 %	13.08.2023	1.066.680	0,01 %
Chile Government International Bond	€ 800.000	1,88 %	27.05.2030	1.000.554	0,01 %
Corp. Nacional del Cobre de Chile	\$ 800.000	3,63 %	01.08.2027	801.305	0,01 %
Corp. Nacional del Cobre de Chile	\$ 700.000	3,00 %	17.07.2022	698.197	0,01 %
Corp. Nacional del Cobre de Chile	\$ 600.000	4,50 %	16.09.2025	644.280	0,01 %
Cencosud SA	\$ 500.000	5,15 %	12.02.2025	530.345	0,01 %
Inversiones CMPC SA	\$ 500.000	4,75 %	15.09.2024	528.006	0,01 %
Chile Government International Bond	\$ 517.000	3,13 %	21.01.2026	523.204	0,01 %
Celulosa Arauco y Constitucion SA	\$ 450.000	5,50 %	02.11.2047	467.954	0,01 %
Cencosud SA	\$ 400.000	4,38 %	17.07.2027	396.014	0,01 %
Chile Government International Bond	€ 300.000	1,63 %	30.01.2025	381.404	0,01 %
Engie Energia Chile SA	\$ 325.000	4,50 %	29.01.2025	339.919	0,01 %
Empresa Electrica Angamos SA	\$ 300.000	4,88 %	25.05.2029	299.119	0,00 %
Colbun SA	\$ 250.000	4,50 %	10.07.2024	261.250	0,00 %
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	\$ 200.000	5,00 %	25.01.2047	220.083	0,00 %
Celulosa Arauco y Constitucion SA	\$ 200.000	4,50 %	01.08.2024	210.924	0,00 %
Banco del Estado de Chile	\$ 200.000	3,88 %	08.02.2022	208.260	0,00 %
Inversiones CMPC SA/Cayman Islands Branch	\$ 200.000	4,38 %	15.05.2023	207.575	0,00 %
Chile Government International Bond	\$ 200.000	3,86 %	21.06.2047	205.574	0,00 %
Inversiones CMPC SA	\$ 200.000	4,38 %	04.04.2027	204.275	0,00 %
Itau CorpBanca	\$ 200.000	3,88 %	22.09.2019	204.000	0,00 %
Enel Americas SA	\$ 200.000	4,00 %	25.10.2026	203.196	0,00 %
Corp. Nacional del Cobre de Chile	\$ 200.000	3,00 %	17.07.2022	199.538	0,00 %
Celulosa Arauco y Constitucion SA	\$ 200.000	3,88 %	02.11.2027	197.905	0,00 %
Itau CorpBanca	\$ 175.000	3,88 %	22.09.2019	178.536	0,00 %
Transelec SA	\$ 175.000	3,88 %	12.01.2029	173.611	0,00 %
Empresa Nacional del Petroleo	\$ 100.000	4,75 %	06.12.2021	106.125	0,00 %
GNL Quintero SA	\$ 100.000	4,63 %	31.07.2029	104.207	0,00 %
Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA	\$ 100.000	4,75 %	01.08.2026	104.125	0,00 %
Colbun SA	\$ 100.000	3,95 %	11.10.2027	100.282	0,00 %
Latam Airlines 2015-1 Pass Through Trust A	\$ 13.472	4,20 %	15.11.2027	13.658	0,00 %
				11.976.002	0,13 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
China 0,58 % (2016: 0,53 %)					
BOC Aviation Ltd.	\$ 3.200.000	2,38 %	15.09.2021	3.113.440	0,03 %
Huarong Finance II Co., Ltd.	\$ 2.750.000	4,50 %	16.01.2020	2.808.218	0,03 %
China Development Bank Corp.	€ 1.667.000	0,13 %	03.11.2019	1.997.500	0,02 %
CNOOC Finance 2015 USA LLC	\$ 1.800.000	3,50 %	05.05.2025	1.814.526	0,02 %
China Construction Bank Asia Corp., Ltd.^	\$ 1.450.000	4,25 %	20.08.2024	1.471.750	0,02 %
Export-Import Bank von China	€ 1.200.000	0,75 %	28.05.2023	1.425.830	0,01 %
China Development Bank Corp.	€ 1.000.000	0,88 %	24.01.2024	1.178.286	0,01 %
BOC Aviation Ltd.	\$ 1.000.000	3,88 %	27.04.2026	1.008.670	0,01 %
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	\$ 1.000.000	3,38 %	24.01.2020	998.820	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd.	\$ 1.000.000	3,25 %	28.04.2025	988.910	0,01 %
Huarong Finance II Co., Ltd.^	\$ 1.000.000	2,88 %	14.03.2166	973.180	0,01 %
Bank of China Ltd.	\$ 900.000	5,00 %	13.11.2024	960.478	0,01 %
China Overseas Finance Cayman VI Ltd.	\$ 800.000	5,95 %	08.05.2024	907.000	0,01 %
China Development Bank	\$ 850.000	3,38 %	24.01.2027	853.485	0,01 %
China Development Bank	€ 700.000	0,38 %	16.11.2021	834.424	0,01 %
CITIC Ltd.	\$ 800.000	3,88 %	28.02.2027	798.312	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2013 Ltd.	\$ 750.000	4,38 %	17.10.2023	796.405	0,01 %
CNOOC Nexen Finance 2014 ULC	\$ 700.000	4,25 %	30.04.2024	738.291	0,01 %
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.	\$ 700.000	4,00 %	04.05.2047	721.615	0,01 %
China Development Bank	\$ 700.000	4,00 %	24.01.2037	721.539	0,01 %
CNPC General Capital Ltd.	\$ 700.000	3,40 %	16.04.2023	708.950	0,01 %
State Grid Overseas Investment 2014 Ltd.	\$ 700.000	2,75 %	07.05.2019	701.744	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.	\$ 700.000	3,00 %	12.04.2022	699.292	0,01 %
Three Gorges Finance I Cayman Islands Ltd.	\$ 700.000	2,30 %	02.06.2021	688.646	0,01 %
Tencent Holdings Ltd.	\$ 650.000	3,80 %	11.02.2025	673.990	0,01 %
Avi Funding Co., Ltd.	\$ 600.000	3,80 %	16.09.2025	613.584	0,01 %
CITIC Ltd.	\$ 600.000	3,70 %	14.06.2026	594.318	0,01 %
Sino-Ocean Land Treasure Finance I Ltd.	\$ 500.000	6,00 %	30.07.2024	550.625	0,01 %
Alibaba Group Holding Ltd.	\$ 550.000	3,40 %	06.12.2027	549.785	0,01 %
CITIC Ltd.	\$ 500.000	6,38 %	10.04.2020	534.375	0,01 %
Bank of China Ltd.	\$ 500.000	5,00 %	13.11.2024	533.360	0,01 %
CNOOC Curtis Funding No 1 Pty Ltd.	\$ 500.000	4,50 %	03.10.2023	532.112	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd.	\$ 500.000	4,38 %	10.04.2024	530.719	0,01 %
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	\$ 500.000	4,88 %	21.09.2025	529.385	0,01 %
Sinochem Overseas Capital Co., Ltd.	\$ 500.000	4,50 %	12.11.2020	521.991	0,01 %
China Cinda Finance 2017 I Ltd.	\$ 500.000	4,10 %	09.03.2024	510.800	0,01 %
China Overseas Finance Cayman VI Ltd.	\$ 500.000	4,25 %	08.05.2019	508.745	0,01 %
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	\$ 500.000	3,23 %	13.11.2019	503.843	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.	\$ 500.000	3,63 %	12.04.2027	503.534	0,01 %
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	\$ 500.000	2,91 %	13.11.2020	498.846	0,01 %
ICBCIL Finance Co., Ltd.	\$ 500.000	3,00 %	05.04.2020	498.750	0,01 %
China Cinda Finance 2015 I Ltd.	\$ 500.000	3,13 %	23.04.2020	498.670	0,01 %
Bank of China Ltd.	\$ 500.000	3,50 %	20.04.2027	497.545	0,01 %
Baidu, Inc.	\$ 500.000	2,88 %	06.07.2022	494.579	0,01 %
State Grid Europe Development 2014 plc	€ 400.000	1,50 %	26.01.2022	494.352	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.	\$ 500.000	2,25 %	13.09.2020	493.811	0,01 %
China Development Bank	\$ 500.000	1,63 %	22.06.2019	493.125	0,01 %
Alibaba Group Holding Ltd.	\$ 490.000	2,50 %	28.11.2019	490.615	0,01 %
China Development Bank	\$ 500.000	3,00 %	01.06.2026	489.340	0,01 %
China Development Bank	\$ 500.000	2,13 %	01.06.2021	488.065	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2016 Ltd.	\$ 500.000	2,00 %	29.09.2021	485.000	0,01 %
Tencent Holdings Ltd.	\$ 450.000	3,38 %	02.05.2019	455.152	0,00 %
China Cinda Finance 2015 I Ltd.	\$ 400.000	4,25 %	23.04.2025	409.520	0,00 %
CNOOC Finance 2015 Australia Pty Ltd.	\$ 400.000	2,63 %	05.05.2020	398.517	0,00 %
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.	\$ 400.000	2,50 %	13.09.2022	391.214	0,00 %
Charming Light Investments Ltd.	\$ 400.000	2,38 %	30.08.2021	386.404	0,00 %
China Construction Bank Asia Corp., Ltd.	€ 300.000	1,50 %	11.02.2020	367.819	0,00 %
Bank of China Ltd.	\$ 350.000	2,88 %	30.06.2020	350.844	0,00 %
Alibaba Group Holding Ltd.	\$ 325.000	3,13 %	28.11.2021	330.022	0,00 %
Azure Orbit II International Finance Ltd.	\$ 300.000	3,38 %	25.04.2019	301.884	0,00 %
CNPC General Capital Ltd.	\$ 300.000	2,75 %	14.05.2019	300.415	0,00 %
ICBCIL Finance Co., Ltd.	\$ 300.000	2,38 %	19.05.2019	297.407	0,00 %
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.	\$ 300.000	2,75 %	04.05.2022	297.029	0,00 %
Huarong Finance II Co., Ltd.	\$ 250.000	5,50 %	16.01.2025	270.058	0,00 %
Nexen Energy ULC	\$ 200.000	6,40 %	15.05.2037	259.991	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Tencent Holdings Ltd.	\$ 250.000	2,88 %	11.02.2020	251.628	0,00 %
Bank of Communications Co., Ltd.^	€ 200.000	3,63 %	03.10.2026	251.424	0,00 %
CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	\$ 250.000	4,13 %	19.07.2027	250.053	0,00 %
Export-Import Bank von China	\$ 250.000	2,50 %	31.07.2019	250.045	0,00 %
Agricultural Bank of China Ltd.	\$ 250.000	2,75 %	21.05.2020	249.201	0,00 %
Industrial & Commercial Bank of China Ltd./New York	\$ 250.000	3,54 %	08.11.2027	248.625	0,00 %
China Southern Power Grid International Finance BVI Co., Ltd.	\$ 250.000	2,75 %	08.05.2022	247.921	0,00 %
Industrial & Commercial Bank of China Ltd./New York	\$ 250.000	2,96 %	08.11.2022	247.567	0,00 %
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	\$ 250.000	2,64 %	26.05.2021	246.953	0,00 %
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.	\$ 250.000	3,25 %	13.09.2027	244.198	0,00 %
State Grid Overseas Investment 2014 Ltd.	\$ 200.000	4,85 %	07.05.2044	232.441	0,00 %
Alibaba Group Holding Ltd.	\$ 200.000	4,50 %	28.11.2034	219.603	0,00 %
State Grid Overseas Investment 2014 Ltd.	\$ 200.000	4,13 %	07.05.2024	210.751	0,00 %
China Resources Gas Group Ltd.	\$ 200.000	4,50 %	05.04.2022	210.340	0,00 %
Alibaba Group Holding Ltd.	\$ 200.000	4,20 %	06.12.2047	208.232	0,00 %
CNOOC Finance 2011 Ltd.	\$ 200.000	4,25 %	26.01.2021	207.770	0,00 %
Baidu, Inc.	\$ 200.000	4,13 %	30.06.2025	207.580	0,00 %
Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd.	\$ 200.000	3,90 %	17.05.2022	206.782	0,00 %
COSCO Finance 2011 Ltd.	\$ 200.000	4,00 %	03.12.2022	206.530	0,00 %
CNOOC Finance 2012 Ltd.	\$ 200.000	3,88 %	02.05.2022	206.355	0,00 %
Franshion Brilliant Ltd.	\$ 200.000	5,75 %	19.03.2019	206.012	0,00 %
CNOOC Finance 2013 Ltd.	\$ 200.000	4,25 %	09.05.2043	205.211	0,00 %
Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.	\$ 200.000	4,20 %	27.07.2026	204.314	0,00 %
Baidu, Inc.	\$ 200.000	3,50 %	28.11.2022	203.334	0,00 %
Semiconductor Manufacturing International Corp.	\$ 200.000	4,13 %	07.10.2019	202.000	0,00 %
Bluestar Finance Holdings Ltd.	\$ 200.000	3,50 %	30.09.2021	199.984	0,00 %
Sinopec Capital 2013 Ltd.	\$ 200.000	3,13 %	24.04.2023	199.316	0,00 %
Avi Funding Co., Ltd.	\$ 200.000	2,85 %	16.09.2020	198.787	0,00 %
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.	\$ 200.000	4,00 %	13.09.2047	198.486	0,00 %
Baidu, Inc.	\$ 200.000	3,63 %	06.07.2027	197.473	0,00 %
Azure Orbit III International Finance Ltd.	\$ 200.000	2,63 %	21.03.2021	196.740	0,00 %
ICBCIL Finance Co., Ltd.	\$ 200.000	2,75 %	19.05.2021	196.540	0,00 %
Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd.	\$ 150.000	4,88 %	17.05.2042	168.955	0,00 %
Sinochem Offshore Capital Co., Ltd.	\$ 150.000	3,25 %	29.04.2019	150.589	0,00 %
Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd.	€ 100.000	1,00 %	28.04.2022	121.457	0,00 %
CNOOC Finance 2012 Ltd.	\$ 100.000	5,00 %	02.05.2042	113.539	0,00 %
China Overseas Finance Cayman II Ltd.	\$ 100.000	5,50 %	10.11.2020	106.638	0,00 %
Bank of China Hong Kong Ltd.	\$ 100.000	5,55 %	11.02.2020	105.143	0,00 %
Alibaba Group Holding Ltd.	\$ 75.000	3,60 %	28.11.2024	77.812	0,00 %
				54.695.780	0,58 %
Kolumbien 0,09 % (2016: 0,10 %)					
Colombia Government International Bond	\$ 1.300.000	4,00 %	26.02.2024	1.346.800	0,02 %
Colombia Government International Bond	\$ 1.150.000	5,00 %	15.06.2045	1.216.125	0,01 %
Colombia Government International Bond	\$ 975.000	3,88 %	25.04.2027	992.574	0,01 %
Ecopetrol SA	\$ 825.000	5,38 %	26.06.2026	886.875	0,01 %
Colombia Government International Bond	\$ 500.000	10,38 %	28.01.2033	789.724	0,01 %
GrupoSura Finance SA	\$ 600.000	5,50 %	29.04.2026	650.128	0,01 %
Colombia Government International Bond	\$ 500.000	5,63 %	26.02.2044	572.500	0,01 %
Ecopetrol SA	\$ 400.000	5,88 %	28.05.2045	406.000	0,01 %
Colombia Government International Bond	\$ 290.000	4,50 %	28.01.2026	310.010	0,00 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA	\$ 300.000	4,88 %	21.04.2025	309.513	0,00 %
Ecopetrol SA	\$ 300.000	4,13 %	16.01.2025	302.250	0,00 %
Colombia Government International Bond	\$ 200.000	4,38 %	12.07.2021	210.800	0,00 %
Transportadora de Gas Internacional SA ESP	\$ 200.000	5,70 %	20.03.2022	205.070	0,00 %
Ecopetrol SA	\$ 125.000	7,63 %	23.07.2019	134.078	0,00 %
Colombia Government International Bond	\$ 125.000	7,38 %	18.03.2019	132.401	0,00 %
Colombia Government International Bond	\$ 100.000	8,13 %	21.05.2024	127.026	0,00 %
Colombia Government International Bond	\$ 100.000	6,13 %	18.01.2041	121.625	0,00 %
Ecopetrol SA	\$ 50.000	7,38 %	18.09.2043	59.938	0,00 %
				8.773.437	0,09 %
Tschechische Republik 0,14 % (2016: 0,11 %)					
Czech Republic Government Bond	Kč 65.000.000	3,85 %	29.09.2021	3.393.330	0,04 %
Czech Republic Government Bond	Kč 55.090.000	3,75 %	12.09.2020	2.792.073	0,03 %
Czech Republic Government Bond	Kč 42.090.000	0,45 %	25.10.2023	1.914.293	0,02 %
Tschechische Republik Internationale	€ 1.000.000	3,63 %	14.04.2021	1.351.783	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
CEZ A.S.	€ 500.000	3,00 %	05.06.2028	671.211	0,01 %
Czech Republic Government Bond	Kč 15.000.000	0,95 %	15.05.2030	625.894	0,01 %
Czech Republic Government Bond	Kč 10.000.000	5,00 %	11.04.2019	497.201	0,01 %
Czech Republic Government Bond	Kč 8.000.000	5,70 %	25.05.2024	482.803	0,01 %
Czech Republic Government Bond	Kč 10.000.000	1,50 %	29.10.2019	476.952	0,00 %
Czech Republic Government Bond	Kč 8.000.000	2,40 %	17.09.2025	402.596	0,00 %
Tschechische Republik Internationale	€ 250.000	4,13 %	18.03.2020	329.536	0,00 %
Czech Republic Government Bond	Kč 5.000.000	4,20 %	04.12.2036	304.410	0,00 %
Czech Republic Government Bond	Kč 5.000.000	2,50 %	25.08.2028	252.375	0,00 %
Tschechische Republik Internationale	€ 100.000	3,88 %	24.05.2022	140.494	0,00 %
CEZ A.S.	€ 50.000	4,50 %	29.06.2020	66.475	0,00 %
				13.701.426	0,14 %
Dänemark 0,60 % (2016: 0,52 %)					
Nykredit Realkredit A/S	DKK(kr) 50.200.000	1,00 %	01.01.2022	8.396.687	0,09 %
Realkredit Danmark A/S	DKK(kr) 42.000.000	1,00 %	01.04.2022	7.035.074	0,07 %
Denmark Government Bond	DKK(kr) 20.650.000	4,50 %	15.11.2039	5.622.699	0,06 %
Denmark Government Bond	DKK(kr) 31.000.000	1,75 %	15.11.2025	5.599.139	0,06 %
Nykredit Realkredit	DKK(kr) 15.000.000	1,00 %	01.07.2021	2.504.983	0,03 %
Danske Bank A/S	€ 2.000.000	0,13 %	14.02.2022	2.407.047	0,03 %
Denmark Government Bond	DKK(kr) 11.000.000	4,00 %	15.11.2019	1.926.671	0,02 %
Orsted A/S	€ 1.500.000	1,50 %	26.11.2029	1.790.431	0,02 %
Danske Bank A/S	\$ 1.600.000	2,75 %	17.09.2020	1.608.000	0,02 %
Denmark Government Bond	DKK(kr) 8.000.000	0,50 %	15.11.2027	1.292.491	0,01 %
Denmark Government Bond	DKK(kr) 7.000.000	1,50 %	15.11.2023	1.228.296	0,01 %
Nykredit Realkredit	DKK(kr) 7.465.373	2,00 %	01.10.2047	1.210.938	0,01 %
Denmark Government Bond	DKK(kr) 5.000.000	7,00 %	10.11.2024	1.188.838	0,01 %
Danske Bank A/S	€ 1.000.000	0,25 %	28.11.2022	1.188.023	0,01 %
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab	DKK(kr) 6.000.000	1,00 %	01.10.2021	988.576	0,01 %
Kommunekredit	\$ 960.000	1,63 %	01.06.2021	939.504	0,01 %
Carlsberg Breweries A/S	€ 700.000	2,50 %	28.05.2024	923.105	0,01 %
Nykredit Realkredit A/S	€ 763.000	0,38 %	16.06.2020	921.285	0,01 %
Orsted A/S^	€ 700.000	2,25 %	24.11.3017	853.168	0,01 %
Danske Bank	\$ 850.000	2,00 %	08.09.2021	831.182	0,01 %
AP Moller – Maersk A/S	£ 500.000	4,00 %	04.04.2025	731.183	0,01 %
Jyske Bank A/S^	€ 583.000	2,25 %	05.04.2029	717.855	0,01 %
Danske Bank A/S	€ 500.000	0,38 %	26.08.2019	607.217	0,01 %
BRFKredit A/S	€ 500.000	0,50 %	01.10.2026	587.838	0,01 %
AP Moller – Maersk A/S	€ 400.000	1,75 %	18.03.2021	501.692	0,01 %
Nykredit Realkredit A/S	€ 408.000	0,88 %	13.06.2019	495.964	0,01 %
Kommunekredit	€ 400.000	0,88 %	03.11.2036	438.656	0,01 %
Denmark Government Bond	DKK(kr) 2.400.000	3,00 %	15.11.2021	436.672	0,01 %
Danske Bank A/S	\$ 400.000	2,20 %	02.03.2020	398.075	0,01 %
Danske Bank A/S	€ 300.000	0,25 %	04.06.2020	364.167	0,00 %
TDC A/S	€ 300.000	1,75 %	27.02.2027	364.167	0,00 %
Danske Bank A/S	€ 300.000	0,13 %	09.03.2021	362.598	0,00 %
Kommunekredit	€ 300.000	0,25 %	29.03.2023	361.441	0,00 %
ISS Global A/S	€ 200.000	1,13 %	07.01.2021	245.526	0,00 %
BRFKredit A/S	€ 200.000	0,25 %	01.07.2023	239.321	0,00 %
Danske Bank A/S	\$ 200.000	2,80 %	10.03.2021	201.305	0,00 %
Danske Bank	\$ 200.000	2,70 %	02.03.2022	200.038	0,00 %
Orsted	£ 100.000	4,88 %	12.01.2032	170.234	0,00 %
TDC A/S	£ 100.000	5,63 %	23.02.2023	157.514	0,00 %
Nykredit Realkredit A/S^	€ 100.000	2,75 %	17.11.2027	128.654	0,00 %
Danske Bank A/S^	€ 100.000	2,75 %	19.05.2026	128.206	0,00 %
AP Moller – Maersk A/S	€ 100.000	3,38 %	28.08.2019	126.802	0,00 %
Orsted^	€ 100.000	3,00 %	06.11.3015	126.324	0,00 %
Danske Bank A/S	€ 100.000	1,63 %	28.02.2020	124.898	0,00 %
Danfoss A/S	€ 100.000	1,38 %	23.02.2022	124.447	0,00 %
Nykredit Realkredit A/S	€ 100.000	1,75 %	28.01.2019	122.657	0,00 %
Danske Bank A/S	€ 50.000	4,13 %	26.11.2019	65.076	0,00 %
AP Moller – Maersk A/S	\$ 50.000	2,55 %	22.09.2019	50.072	0,00 %
Nykredit Realkredit A/S	DKK(kr) 283.675	3,00 %	01.10.2031	47.307	0,00 %
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab	DKK(kr) 211.214	3,50 %	01.10.2044	36.926	0,00 %
				57.118.969	0,60 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Finnland 0,39 % (2016: 0,38 %)					
Finland Government Bond	€ 4.300.000	0,75 %	15.04.2031	5.083.086	0,05 %
Finland Government Bond	€ 2.250.000	0,00 %	15.09.2023	2.695.467	0,03 %
Finland Government Bond	€ 1.800.000	2,00 %	15.04.2024	2.414.143	0,03 %
OP Corporate Bank plc	€ 2.000.000	0,38 %	11.10.2022	2.402.443	0,03 %
Finland Government Bond	€ 1.600.000	3,50 %	15.04.2021	2.163.841	0,02 %
Finland Government International Bond	£ 1.500.000	1,63 %	15.12.2020	2.078.041	0,02 %
OP Mortgage Bank	€ 1.400.000	0,63 %	04.09.2022	1.719.982	0,02 %
Nordea Mortgage Bank plc	€ 1.000.000	4,00 %	10.02.2021	1.354.065	0,02 %
Finland Government Bond	€ 1.000.000	0,38 %	15.09.2020	1.227.374	0,01 %
Finland Government Bond	€ 800.000	4,00 %	04.07.2025	1.224.386	0,01 %
Finnvera OYJ	€ 1.000.000	0,50 %	13.04.2026	1.193.413	0,01 %
Finland Government Bond	€ 800.000	1,63 %	15.09.2022	1.040.888	0,01 %
Finland Government Bond	€ 575.000	2,63 %	04.07.2042	905.814	0,01 %
Finland Government Bond	€ 700.000	0,88 %	15.09.2025	876.126	0,01 %
Finland Government Bond	€ 500.000	2,75 %	04.07.2028	729.306	0,01 %
Municipality Finance plc	£ 500.000	1,25 %	07.03.2019	680.410	0,01 %
Municipality Finance plc	£ 500.000	0,75 %	15.12.2020	674.596	0,01 %
Finland Government International Bond	\$ 650.000	1,00 %	23.04.2019	641.967	0,01 %
Sampo OYJ	€ 500.000	1,00 %	18.09.2023	610.645	0,01 %
Nordea Mortgage Bank plc	€ 500.000	0,03 %	24.01.2022	600.099	0,01 %
Municipality Finance plc	\$ 550.000	2,38 %	15.03.2022	548.688	0,01 %
Fortum OYJ	€ 400.000	2,25 %	06.09.2022	513.724	0,01 %
Municipality Finance plc	\$ 500.000	1,50 %	23.03.2020	492.563	0,01 %
Nordea Mortgage Bank plc	€ 400.000	0,13 %	17.06.2020	484.299	0,01 %
Finland Government International Bond	\$ 400.000	1,50 %	21.09.2020	393.494	0,01 %
Citycon Treasury BV	€ 300.000	2,50 %	01.10.2024	387.971	0,00 %
Finnvera OYJ	€ 300.000	0,63 %	22.09.2022	369.517	0,00 %
Finland Government Bond	€ 250.000	4,38 %	04.07.2019	322.688	0,00 %
OP Corporate Bank plc	£ 200.000	2,50 %	20.05.2022	284.298	0,00 %
Sampo OYJ	€ 200.000	1,50 %	16.09.2021	250.896	0,00 %
Nordea Mortgage Bank plc	€ 200.000	1,00 %	05.11.2024	249.558	0,00 %
Municipality Finance plc	\$ 250.000	1,88 %	18.09.2020	247.814	0,00 %
Danske Kiinnitysluottopankki OYJ	€ 200.000	0,25 %	26.11.2020	242.864	0,00 %
OP Mortgage Bank	€ 200.000	0,25 %	23.11.2020	242.765	0,00 %
Finnvera OYJ	\$ 200.000	1,88 %	05.10.2020	198.116	0,00 %
Finland Government Bond	€ 150.000	3,38 %	15.04.2020	196.010	0,00 %
Finland Government Bond	€ 150.000	1,50 %	15.04.2023	194.678	0,00 %
Finnvera OYJ	\$ 200.000	2,38 %	04.06.2025	193.627	0,00 %
Nordea Mortgage Bank plc	€ 150.000	2,25 %	03.05.2019	186.430	0,00 %
Finland Government International Bond	£ 100.000	1,50 %	19.12.2019	137.310	0,00 %
Nordea Mortgage Bank plc	€ 100.000	1,38 %	15.01.2020	124.140	0,00 %
Danske Kiinnitysluottopankki OYJ	€ 100.000	1,63 %	27.09.2019	124.133	0,00 %
Finnvera OYJ	€ 100.000	0,63 %	19.11.2021	123.307	0,00 %
OP Corporate Bank plc	€ 100.000	1,13 %	17.06.2019	122.276	0,00 %
Municipality Finance plc	\$ 100.000	1,38 %	21.09.2021	96.532	0,00 %
				37.043.790	0,39 %
Frankreich 6,63 % (2016: 6,36 %)					
French Republic Government Bond OAT	€ 25.500.000	2,25 %	25.05.2024	34.769.464	0,37 %
French Republic Government Bond OAT	€ 28.000.000	1,00 %	25.05.2027	34.737.386	0,37 %
French Republic Government Bond OAT	€ 17.000.000	0,00 %	25.05.2021	20.615.735	0,22 %
French Republic Government Bond OAT	€ 15.000.000	0,00 %	25.05.2022	18.118.991	0,19 %
French Republic Government Bond OAT	€ 15.000.000	0,00 %	25.03.2023	18.008.037	0,19 %
French Republic Government Bond OAT	€ 13.000.000	1,00 %	25.05.2019	15.956.545	0,17 %
French Republic Government Bond OAT	€ 13.000.000	0,50 %	25.11.2019	15.912.149	0,17 %
French Republic Government Bond OAT	€ 12.500.000	1,75 %	25.06.2039	15.814.206	0,17 %
French Republic Government Bond OAT	€ 10.900.000	2,25 %	25.10.2022	14.572.640	0,15 %
French Republic Government Bond OAT	€ 7.100.000	4,75 %	25.04.2035	13.243.041	0,14 %
French Republic Government Bond OAT	€ 10.000.000	0,00 %	25.05.2020	12.139.295	0,13 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 9.500.000	0,05 %	25.11.2020	11.504.165	0,12 %
French Republic Government Bond OAT	€ 5.650.000	5,75 %	25.10.2032	11.134.089	0,12 %
French Republic Government Bond OAT	€ 7.700.000	2,50 %	25.05.2030	10.915.684	0,12 %
French Republic Government Bond OAT	€ 5.300.000	4,50 %	25.04.2041	10.157.340	0,11 %
French Republic Government Bond OAT	€ 7.350.000	3,25 %	25.10.2021	10.017.109	0,11 %
French Republic Government Bond OAT	€ 7.600.000	3,50 %	25.04.2020	9.967.413	0,11 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
French Republic Government Bond OAT	€ 8.000.000	0,50 %	25.05.2025	9.754.300	0,10 %
French Republic Government Bond OAT	€ 8.000.000	0,50 %	25.05.2026	9.646.074	0,10 %
French Republic Government Bond OAT	€ 6.200.000	3,75 %	25.10.2019	8.031.593	0,09 %
French Republic Government Bond OAT	€ 5.050.000	3,75 %	25.04.2021	6.891.660	0,07 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 5.000.000	0,13 %	25.11.2024	5.918.215	0,06 %
French Republic Government Bond OAT	€ 5.000.000	0,25 %	25.11.2026	5.850.898	0,06 %
French Republic Government Bond OAT	€ 4.350.000	1,75 %	25.05.2023	5.722.322	0,06 %
French Republic Government Bond OAT	€ 3.500.000	3,25 %	25.05.2045	5.668.518	0,06 %
French Republic Government Bond OAT	€ 3.150.000	4,00 %	25.10.2038	5.577.908	0,06 %
French Republic Government Bond OAT	€ 2.700.000	4,00 %	25.04.2055	5.122.775	0,05 %
French Republic Government Bond OAT	€ 3.700.000	1,75 %	25.11.2024	4.914.980	0,05 %
French Republic Government Bond OAT	€ 4.000.000	1,75 %	25.05.2066	4.547.093	0,05 %
French Republic Government Bond OAT	€ 3.250.000	2,00 %	25.05.2048	4.119.249	0,04 %
French Republic Government Bond OAT	€ 3.000.000	1,00 %	25.11.2025	3.779.537	0,04 %
French Republic Government Bond OAT	€ 2.800.000	1,50 %	25.05.2031	3.551.924	0,04 %
French Republic Government Bond OAT	€ 1.750.000	4,00 %	25.04.2060	3.403.759	0,04 %
French Republic Government Bond OAT	€ 2.250.000	3,50 %	25.04.2026	3.392.974	0,04 %
French Republic Government Bond OAT	€ 1.850.000	5,50 %	25.04.2029	3.349.947	0,04 %
French Republic Government Bond OAT	€ 2.700.000	0,00 %	25.02.2019	3.265.633	0,04 %
Agence Francaise de Developpement	€ 2.800.000	0,25 %	21.07.2026	3.231.062	0,03 %
French Republic Government Bond OAT	€ 2.200.000	2,75 %	25.10.2027	3.163.016	0,03 %
French Republic Government Bond OAT	€ 2.300.000	3,00 %	25.04.2022	3.143.692	0,03 %
French Republic Government Bond OAT	€ 2.100.000	4,25 %	25.10.2023	3.141.645	0,03 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 1.900.000	4,00 %	24.10.2025	2.884.083	0,03 %
French Republic Government Bond OAT	€ 1.650.000	6,00 %	25.10.2025	2.859.909	0,03 %
BNP Paribas SA	€ 2.172.000	1,50 %	17.11.2025	2.692.680	0,03 %
French Republic Government Bond OAT	€ 2.200.000	0,25 %	25.11.2020	2.688.841	0,03 %
French Republic Government Bond OAT	€ 2.000.000	2,50 %	25.10.2020	2.599.184	0,03 %
BNP Paribas SA	€ 2.050.000	2,50 %	23.08.2019	2.567.734	0,03 %
SNCF Reseau EPIC	€ 2.000.000	0,10 %	27.05.2021	2.414.573	0,03 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	€ 2.000.000	0,38 %	30.09.2024	2.401.105	0,03 %
Bpifrance Financement SA	€ 2.000.000	0,13 %	25.11.2023	2.384.894	0,03 %
French Republic Government Bond OAT	€ 2.000.000	1,25 %	25.05.2036	2.359.334	0,03 %
Veolia Environnement SA	€ 1.700.000	0,31 %	04.10.2023	2.003.191	0,02 %
Electricite de France SA	£ 1.100.000	5,88 %	18.07.2031	1.964.505	0,02 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 1.300.000	4,13 %	25.04.2023	1.897.093	0,02 %
Bpifrance Financement SA	€ 1.500.000	0,75 %	25.10.2021	1.857.469	0,02 %
Dexia Credit Local SA	€ 1.500.000	0,63 %	03.02.2024	1.828.339	0,02 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH S.A.	€ 1.500.000	0,63 %	10.02.2025	1.827.762	0,02 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 1.500.000	0,38 %	16.09.2019	1.824.131	0,02 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 1.400.000	2,63 %	31.03.2027	1.816.971	0,02 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 1.500.000	0,04 %	25.05.2019	1.812.465	0,02 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 1.500.000	0,75 %	11.01.2027	1.812.384	0,02 %
Electricite de France SA	\$ 1.750.000	3,63 %	13.10.2025	1.789.496	0,02 %
Credit Agricole SA	¥ 200.000.000	0,44 %	09.06.2022	1.777.850	0,02 %
Societe Generale SA	¥ 200.000.000	0,45 %	26.05.2022	1.776.996	0,02 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	€ 1.400.000	0,75 %	26.05.2024	1.699.446	0,02 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	\$ 1.700.000	1,88 %	13.01.2020	1.689.698	0,02 %
BNP Paribas SA	\$ 1.600.000	3,80 %	10.01.2024	1.652.667	0,02 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 1.200.000	2,50 %	25.10.2022	1.615.627	0,02 %
Coentreprise de Transport d'Electricite SA	€ 1.300.000	2,13 %	29.07.2032	1.614.126	0,02 %
Unibail-Rodamco SE	€ 1.318.000	0,88 %	21.02.2025	1.589.298	0,02 %
Total Capital International SA	€ 1.300.000	1,38 %	04.10.2029	1.588.734	0,02 %
Credit Mutuel Arkea SA	€ 1.300.000	1,25 %	31.05.2024	1.585.080	0,02 %
SNCF Reseau EPIC	€ 1.050.000	4,38 %	02.06.2022	1.502.196	0,02 %
Klepierre SA	€ 1.200.000	1,38 %	16.02.2027	1.471.343	0,02 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	€ 1.200.000	1,13 %	06.02.2019	1.465.210	0,02 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 1.100.000	3,50 %	05.11.2020	1.460.251	0,02 %
Air Liquide Finance SA	\$ 1.500.000	2,25 %	27.09.2023	1.459.656	0,02 %
Agence Francaise de Developpement	€ 1.100.000	1,38 %	17.09.2024	1.404.324	0,02 %
Bpifrance Financement SA	€ 1.000.000	2,50 %	25.05.2024	1.367.214	0,02 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	€ 1.000.000	3,60 %	13.09.2021	1.366.462	0,02 %
Credit Mutuel Arkea SA	€ 1.000.000	3,50 %	09.02.2029	1.358.488	0,02 %
Total Capital International SA	\$ 1.358.000	2,10 %	19.06.2019	1.358.326	0,02 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	\$ 1.350.000	2,75 %	15.10.2020	1.356.858	0,02 %
BPCE SA	€ 1.100.000	1,13 %	18.01.2023	1.353.176	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 1.100.000	1,13 %	25.05.2019	1.349.571	0,02 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	£ 1.000.000	1,00 %	14.06.2022	1.346.384	0,02 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	£ 1.000.000	0,88 %	08.06.2020	1.345.432	0,02 %
Gecina SA	€ 1.100.000	1,38 %	26.01.2028	1.326.101	0,01 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	\$ 1.300.000	3,00 %	26.10.2020	1.317.342	0,01 %
SNCF Reseau EPIC	€ 1.000.000	1,88 %	30.03.2034	1.277.555	0,01 %
CNP Assurances	€ 1.000.000	1,88 %	20.10.2022	1.266.142	0,01 %
SNCF Reseau EPIC	£ 800.000	5,50 %	01.12.2021	1.260.105	0,01 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	€ 1.000.000	1,38 %	03.02.2032	1.235.938	0,01 %
Credit Agricole SA	€ 1.000.000	1,38 %	03.05.2027	1.234.585	0,01 %
Imerys SA	€ 1.000.000	1,50 %	15.01.2027	1.216.221	0,01 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 1.000.000	0,00 %	25.11.2020	1.208.210	0,01 %
BNP Paribas SA	€ 1.000.000	1,50 %	23.05.2028	1.204.871	0,01 %
Holding d'Infrastructures de Transport SAS	€ 1.000.000	1,63 %	27.11.2027	1.203.702	0,01 %
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA	€ 1.000.000	1,13 %	13.10.2027	1.202.925	0,01 %
Bpifrance Financement SA	€ 1.000.000	0,50 %	25.05.2025	1.202.355	0,01 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 1.000.000	0,38 %	11.12.2024	1.199.623	0,01 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	€ 1.000.000	0,25 %	23.02.2024	1.197.427	0,01 %
Arkea Home Loans SFH SA	€ 1.000.000	0,75 %	05.10.2027	1.197.292	0,01 %
Renault SA	€ 1.000.000	1,00 %	28.11.2025	1.184.570	0,01 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 1.000.000	0,23 %	14.09.2026	1.156.089	0,01 %
Credit Agricole SA	€ 900.000	1,88 %	20.12.2026	1.135.076	0,01 %
Arkema SA	€ 900.000	1,50 %	20.04.2027	1.104.200	0,01 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	€ 900.000	0,00 %	26.05.2020	1.081.053	0,01 %
SNCF Reseau EPIC	CHF 1.000.000	3,00 %	24.04.2019	1.072.345	0,01 %
Orange SA	\$ 700.000	9,00 %	01.03.2031	1.052.181	0,01 %
Accor SA	€ 800.000	2,38 %	17.09.2023	1.037.145	0,01 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	€ 700.000	4,00 %	17.06.2022	990.811	0,01 %
Renault SA	€ 800.000	1,00 %	08.03.2023	975.242	0,01 %
Sanofi	€ 800.000	0,00 %	13.01.2020	962.494	0,01 %
Electricite de France SA	€ 700.000	3,88 %	18.01.2022	960.804	0,01 %
Total Capital International SA	€ 800.000	0,63 %	04.10.2024	959.654	0,01 %
Cie de Saint-Gobain	€ 800.000	0,00 %	27.03.2020	959.188	0,01 %
Air Liquide Finance SA	\$ 1.000.000	2,50 %	27.09.2026	954.788	0,01 %
Electricite de France SA	€ 700.000	2,75 %	10.03.2023	931.962	0,01 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 700.000	1,38 %	25.11.2024	904.151	0,01 %
Electricite de France SA	€ 800.000	1,88 %	13.10.2036	882.480	0,01 %
RCI Banque SA	€ 700.000	1,63 %	11.04.2025	870.061	0,01 %
Credit Agricole Assurances SA^	€ 600.000	4,75 %	27.09.2048	855.570	0,01 %
RCI Banque SA	€ 700.000	0,75 %	12.01.2022	847.494	0,01 %
Airbus Finance BV	\$ 850.000	2,70 %	17.04.2023	846.240	0,01 %
Credit Mutuel Arkea SA^	€ 700.000	1,88 %	25.10.2029	843.721	0,01 %
Danone SA	€ 700.000	0,71 %	03.11.2024	840.549	0,01 %
Vivendi SA	€ 700.000	0,88 %	18.09.2024	835.826	0,01 %
Aeroports de Paris	€ 600.000	2,75 %	05.06.2028	830.733	0,01 %
Electricite de France SA	\$ 700.000	5,25 %	13.10.2055	806.243	0,01 %
Total Capital International SA	\$ 750.000	3,75 %	10.04.2024	790.488	0,01 %
Credit Agricole Public Sector SCF SA	€ 667.000	0,25 %	31.10.2026	771.865	0,01 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 600.000	1,25 %	21.10.2027	756.933	0,01 %
Orange SA^	£ 500.000	5,88 %	07.02.2166	754.490	0,01 %
TOTAL SA^	€ 600.000	2,25 %	26.02.2166	752.044	0,01 %
Electricite de France SA	\$ 750.000	2,35 %	13.10.2020	748.289	0,01 %
Danone SA	€ 600.000	0,17 %	03.11.2020	723.209	0,01 %
CNP Assurances^	€ 500.000	4,50 %	10.06.2047	710.093	0,01 %
Orange SA	€ 600.000	0,88 %	03.02.2027	710.029	0,01 %
SNCF Reseau EPIC	€ 500.000	2,63 %	29.12.2025	696.282	0,01 %
Agence Francaise de Developpement	€ 600.000	0,88 %	25.05.2031	688.797	0,01 %
Credit Agricole SA	\$ 640.000	4,38 %	17.03.2025	668.540	0,01 %
Electricite de France SA^	€ 500.000	5,00 %	22.01.2166	665.653	0,01 %
AXA SA^	€ 500.000	3,38 %	06.07.2047	664.935	0,01 %
SCOR SE^	€ 500.000	3,00 %	08.06.2046	658.879	0,01 %
BPCE SA	\$ 650.000	3,00 %	22.05.2022	649.333	0,01 %
Sanofi	€ 500.000	4,13 %	11.10.2019	646.532	0,01 %
RTE Reseau de Transport d'Electricite SA	€ 500.000	1,63 %	08.10.2024	635.833	0,01 %
Pernod Ricard SA	\$ 600.000	4,25 %	15.07.2022	634.170	0,01 %
Sodexo SA	€ 500.000	1,75 %	24.01.2022	633.183	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Societe Generale SFH SA	€ 500.000	1,75 %	05.03.2020	627.602	0,01 %
BPCE SFH SA	€ 500.000	1,50 %	30.01.2020	623.186	0,01 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	€ 500.000	0,88 %	14.11.2024	622.139	0,01 %
Aeroports de Paris	€ 500.000	2,38 %	11.06.2019	621.422	0,01 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 500.000	1,25 %	14.01.2025	620.632	0,01 %
BNP Paribas SA	€ 500.000	1,13 %	15.01.2023	620.626	0,01 %
APRR SA	€ 500.000	1,13 %	15.01.2021	616.694	0,01 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	€ 500.000	1,25 %	24.03.2031	615.830	0,01 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 500.000	0,63 %	10.02.2023	614.840	0,01 %
BNP Paribas SA	€ 500.000	1,13 %	10.10.2023	614.592	0,01 %
BNP Paribas SA	€ 500.000	2,00 %	28.01.2019	614.165	0,01 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 500.000	0,75 %	21.01.2025	613.370	0,01 %
BPCE SA	€ 500.000	1,38 %	22.05.2019	613.125	0,01 %
Societe Generale SA	€ 500.000	1,00 %	01.04.2022	612.989	0,01 %
Societe Generale SFH SA	€ 500.000	0,50 %	20.01.2023	611.573	0,01 %
Sanofi	€ 500.000	1,13 %	05.04.2028	609.243	0,01 %
BPCE SA	€ 500.000	0,63 %	20.04.2020	608.709	0,01 %
RCI Banque SA	€ 500.000	1,00 %	17.05.2023	607.263	0,01 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 500.000	0,50 %	04.09.2024	605.945	0,01 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 500.000	0,13 %	05.03.2020	605.666	0,01 %
AXA Bank Europe SCF	€ 500.000	0,38 %	23.03.2023	605.371	0,01 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 500.000	0,25 %	24.11.2023	604.574	0,01 %
Bpifrance Financement SA	€ 500.000	0,10 %	19.02.2021	604.482	0,01 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 500.000	0,33 %	12.09.2023	603.795	0,01 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 500.000	0,25 %	14.06.2019	603.493	0,01 %
Danone SA^	€ 500.000	1,75 %	23.06.2166	603.384	0,01 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	€ 500.000	0,38 %	26.05.2022	602.609	0,01 %
BPCE SFH SA	€ 500.000	0,38 %	21.02.2024	602.133	0,01 %
Veolia Environnement SA	€ 300.000	6,13 %	29.10.2037	600.976	0,01 %
Engie SA	€ 500.000	0,38 %	28.02.2023	598.359	0,01 %
SNCF Reseau EPIC	€ 500.000	1,13 %	25.05.2030	596.303	0,01 %
Airbus Finance BV	€ 500.000	1,38 %	13.05.2031	595.116	0,01 %
Electricite de France SA	€ 300.000	6,00 %	23.01.2114	587.850	0,01 %
APRR SA	€ 500.000	1,50 %	17.01.2033	585.559	0,01 %
Credit Agricole SA	\$ 550.000	3,88 %	15.04.2024	577.855	0,01 %
Credit Agricole SA	\$ 575.000	2,38 %	01.07.2021	570.805	0,01 %
Sanofi	\$ 525.000	4,00 %	29.03.2021	552.498	0,01 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	\$ 550.000	2,00 %	22.03.2021	543.906	0,01 %
BPCE SA	\$ 500.000	4,88 %	01.04.2026	535.354	0,01 %
RCI Banque SA	£ 385.000	1,88 %	08.11.2022	527.131	0,01 %
SNCF Reseau EPIC	€ 350.000	4,50 %	30.01.2024	526.984	0,01 %
TOTAL SA^	€ 400.000	3,37 %	06.10.2166	526.551	0,01 %
Credit Agricole SA	£ 300.000	7,38 %	18.12.2023	523.918	0,01 %
Credit Agricole SA	€ 400.000	2,63 %	17.03.2027	518.999	0,01 %
Societe Fonciere Lyonnaise SA	€ 400.000	2,25 %	16.11.2022	513.635	0,01 %
Electricite de France SA^	€ 400.000	4,13 %	22.01.2166	512.742	0,01 %
TOTAL SA^	€ 400.000	2,71 %	05.05.2166	512.425	0,01 %
Societe Generale SA	\$ 500.000	4,25 %	14.04.2025	508.611	0,01 %
TOTAL SA^	€ 400.000	2,63 %	26.02.2166	505.297	0,01 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 400.000	1,13 %	09.09.2025	502.406	0,01 %
Engie SA	€ 400.000	2,00 %	28.09.2037	496.464	0,01 %
Credit Agricole SA	\$ 500.000	3,25 %	04.10.2024	495.955	0,01 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	\$ 475.000	3,38 %	20.03.2024	495.872	0,01 %
La Poste SA	€ 400.000	1,13 %	04.06.2025	493.917	0,01 %
BPCE SA	£ 300.000	5,25 %	16.04.2029	493.778	0,01 %
Suez	€ 400.000	1,50 %	03.04.2029	492.488	0,01 %
BPCE SFH SA	€ 400.000	0,50 %	11.10.2022	489.199	0,01 %
Danone SA	\$ 500.000	2,08 %	02.11.2021	487.644	0,01 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 400.000	0,63 %	03.03.2026	487.257	0,01 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	\$ 485.000	1,75 %	24.09.2019	482.031	0,01 %
BNP Paribas SA	\$ 450.000	4,38 %	28.09.2025	470.114	0,01 %
SNCF Reseau EPIC	£ 200.000	4,83 %	25.03.2060	458.090	0,01 %
SNCF Reseau EPIC	€ 250.000	5,00 %	10.10.2033	454.621	0,01 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 350.000	4,00 %	25.10.2019	454.366	0,01 %
Suez	€ 350.000	6,25 %	08.04.2019	453.793	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Credit Agricole Home Loan SFH SA	€ 300.000	4,00 %	16.07.2025	453.784	0,01 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	€ 350.000	1,38 %	25.10.2019	433.586	0,01 %
Electricite de France SA	\$ 400.000	4,75 %	13.10.2035	433.193	0,01 %
Orange SA^	€ 300.000	5,25 %	07.02.2166	427.672	0,01 %
Electricite de France SA^	£ 300.000	5,88 %	22.07.2166	422.756	0,01 %
Orange SA	\$ 425.000	1,63 %	03.11.2019	419.732	0,01 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	€ 300.000	4,00 %	17.01.2022	419.117	0,01 %
BNP Paribas SA	\$ 400.000	4,38 %	12.05.2026	417.942	0,01 %
RCI Banque SA	£ 300.000	3,00 %	09.05.2019	416.583	0,01 %
Electricite de France SA^	\$ 400.000	5,25 %	29.07.2166	407.000	0,01 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	€ 300.000	3,90 %	18.01.2021	405.774	0,01 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 300.000	2,63 %	18.03.2024	403.063	0,01 %
BNP Paribas SA	\$ 400.000	3,50 %	16.11.2027	397.859	0,01 %
Capgemini SE	€ 300.000	2,50 %	01.07.2023	395.226	0,01 %
Total Capital International SA	€ 300.000	2,13 %	15.03.2023	392.576	0,01 %
Danone SA	\$ 400.000	2,59 %	02.11.2023	389.790	0,01 %
Suez	€ 300.000	1,75 %	10.09.2025	383.920	0,00 %
BPCE SFH SA	€ 300.000	2,13 %	17.09.2020	383.376	0,00 %
HSBC SFH France SA	€ 300.000	1,88 %	28.10.2020	381.948	0,00 %
Total Capital International SA	\$ 375.000	2,75 %	19.06.2021	379.274	0,00 %
Pernod Ricard SA	€ 300.000	2,00 %	22.06.2020	377.368	0,00 %
TDF Infrastructure SAS	€ 300.000	2,50 %	07.04.2026	376.875	0,00 %
Credit Agricole SA	€ 300.000	3,88 %	13.02.2019	376.381	0,00 %
Publicis Groupe SA	€ 300.000	1,13 %	16.12.2021	370.156	0,00 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 300.000	0,63 %	12.11.2021	369.647	0,00 %
Credit Mutuel Arkea SA	€ 300.000	1,00 %	26.01.2023	368.913	0,00 %
Bouygues SA	€ 300.000	1,38 %	07.06.2027	368.835	0,00 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 300.000	0,50 %	13.04.2022	367.399	0,00 %
HSBC France SA	€ 300.000	0,63 %	03.12.2020	366.390	0,00 %
HSBC SFH France SA	€ 300.000	0,38 %	11.03.2022	366.124	0,00 %
BPCE SFH SA	€ 300.000	0,38 %	28.07.2020	366.031	0,00 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	€ 300.000	0,25 %	02.09.2021	364.792	0,00 %
BPCE SFH SA	€ 300.000	0,38 %	10.02.2023	364.201	0,00 %
Societe Generale SFH SA	€ 300.000	0,13 %	27.02.2020	363.783	0,00 %
APRR SA	€ 300.000	1,63 %	13.01.2032	362.846	0,00 %
Agence Francaise de Developpement	€ 300.000	0,13 %	31.03.2021	362.798	0,00 %
La Banque Postale Home Loan SFH SA	€ 300.000	0,18 %	22.04.2022	362.685	0,00 %
RCI Banque SA	€ 300.000	0,75 %	26.09.2022	362.567	0,00 %
Schneider Electric SE	€ 300.000	0,88 %	11.03.2025	362.195	0,00 %
Cie de Saint-Gobain	€ 300.000	1,00 %	17.03.2025	361.736	0,00 %
AXA SA	\$ 250.000	8,60 %	15.12.2030	359.808	0,00 %
Region of Ile de France	€ 300.000	0,63 %	23.04.2027	354.224	0,00 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 250.000	4,38 %	25.10.2021	352.767	0,00 %
French Republic Government Bond OAT	€ 200.000	8,50 %	25.04.2023	349.170	0,00 %
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA	€ 300.000	0,38 %	07.02.2025	349.058	0,00 %
Electricite de France SA	€ 200.000	5,63 %	21.02.2033	348.638	0,00 %
Danone SA	\$ 350.000	1,69 %	30.10.2019	344.797	0,00 %
Engie SA	£ 150.000	5,00 %	01.10.2060	328.434	0,00 %
BNP Paribas SA	\$ 300.000	4,63 %	13.03.2027	320.615	0,00 %
Electricite de France SA	€ 200.000	4,63 %	26.04.2030	312.624	0,00 %
BNP Paribas/BNP Paribas US Medium-Term Note Program LLC	\$ 300.000	3,25 %	03.03.2023	305.362	0,00 %
Orange SA^	£ 200.000	5,75 %	01.04.2166	301.865	0,00 %
BPCE SA	\$ 300.000	2,25 %	27.01.2020	299.282	0,00 %
SNCF Reseau EPIC	€ 200.000	3,13 %	25.10.2028	294.210	0,00 %
Societe Generale SCF SA	€ 200.000	4,25 %	03.02.2023	290.277	0,00 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	€ 200.000	3,30 %	23.09.2022	277.255	0,00 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	€ 200.000	4,38 %	17.03.2021	275.170	0,00 %
Electricite de France SA^	€ 200.000	5,38 %	29.01.2166	270.912	0,00 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 200.000	2,38 %	17.01.2024	270.200	0,00 %
Engie SA^	€ 200.000	3,88 %	02.06.2166	269.906	0,00 %
CNP Assurances^	€ 200.000	4,00 %	18.11.2166	269.575	0,00 %
Societe Generale SFH SA	€ 200.000	2,00 %	29.04.2024	265.642	0,00 %
Wendel SA	€ 200.000	2,75 %	02.10.2024	264.035	0,00 %
BNP Paribas SA	€ 200.000	2,75 %	27.01.2026	262.666	0,00 %
BPCE SA^	€ 200.000	2,75 %	30.11.2027	259.335	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Transport et Infrastructures Gaz France SA	€ 200.000	2,20 %	05.08.2025	258.878	0,00 %
La Banque Postale SA^	€ 200.000	2,75 %	19.11.2027	257.898	0,00 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 200.000	2,38 %	24.03.2026	256.107	0,00 %
Imerys SA	€ 200.000	2,00 %	10.12.2024	255.548	0,00 %
Electricite de France SA^	€ 200.000	4,25 %	29.01.2166	254.522	0,00 %
Suez^	€ 200.000	2,88 %	19.04.2166	253.969	0,00 %
Credit Agricole SA	\$ 250.000	3,38 %	10.01.2022	253.479	0,00 %
BPCE SA	\$ 250.000	3,38 %	02.12.2026	253.085	0,00 %
RTE Reseau de Transport d'Electricite SA	€ 200.000	1,63 %	27.11.2025	252.959	0,00 %
Schneider Electric SE	€ 200.000	1,50 %	08.09.2023	252.366	0,00 %
Societe Generale SA	€ 200.000	2,25 %	23.01.2020	251.396	0,00 %
Total Capital International SA	€ 200.000	1,38 %	19.03.2025	251.390	0,00 %
APRR SA	€ 200.000	1,50 %	15.01.2024	251.346	0,00 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 200.000	1,50 %	13.01.2031	251.161	0,00 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 200.000	3,00 %	25.04.2019	251.034	0,00 %
Region of Ile de France	€ 200.000	1,38 %	14.03.2029	250.364	0,00 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 200.000	0,88 %	25.10.2022	250.122	0,00 %
S.A. de Gestion de Stocks de Securite	€ 200.000	1,75 %	22.10.2019	249.167	0,00 %
Capgemini SE	€ 200.000	1,75 %	01.07.2020	248.996	0,00 %
Kering	€ 200.000	1,50 %	05.04.2027	247.972	0,00 %
Veolia Environnement SA	€ 200.000	1,59 %	10.01.2028	247.348	0,00 %
RCI Banque SA	€ 200.000	1,25 %	08.06.2022	247.085	0,00 %
Infra Park SAS	€ 200.000	1,25 %	16.10.2020	246.489	0,00 %
Credit Agricole SA	€ 200.000	1,25 %	14.04.2026	246.337	0,00 %
Bpifrance Financement SA	€ 200.000	1,00 %	25.10.2019	245.991	0,00 %
Klepierre SA	€ 200.000	1,00 %	17.04.2023	245.870	0,00 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH S.A.	€ 200.000	0,88 %	07.04.2026	245.824	0,00 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 200.000	0,63 %	26.01.2023	245.752	0,00 %
Arkea Home Loans SFH SA	€ 200.000	0,63 %	30.09.2022	245.751	0,00 %
Carrefour SA	€ 200.000	1,25 %	03.06.2025	245.122	0,00 %
Air Liquide Finance SA	€ 200.000	1,25 %	13.06.2028	244.840	0,00 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 200.000	0,38 %	29.10.2020	244.274	0,00 %
Imerys SA	€ 200.000	0,88 %	31.03.2022	244.124	0,00 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	€ 200.000	1,00 %	25.02.2019	244.092	0,00 %
BPCE SA	€ 200.000	0,75 %	22.01.2020	244.075	0,00 %
Agence Francaise de Developpement	€ 200.000	0,50 %	25.10.2022	243.884	0,00 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH S.A.	€ 200.000	0,38 %	12.09.2022	243.712	0,00 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	€ 200.000	0,38 %	24.03.2023	242.823	0,00 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	€ 200.000	0,13 %	28.08.2020	242.649	0,00 %
Capgemini SE	€ 200.000	0,50 %	09.11.2021	241.997	0,00 %
Bpifrance Financement SA	€ 200.000	0,13 %	25.11.2020	241.920	0,00 %
Sanofi	€ 200.000	0,00 %	05.04.2019	240.742	0,00 %
La Banque Postale Home Loan SFH SA	€ 200.000	0,38 %	24.01.2025	239.621	0,00 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	€ 200.000	0,38 %	07.05.2025	239.385	0,00 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 200.000	1,25 %	22.01.2035	237.302	0,00 %
Orange SA	\$ 200.000	5,38 %	13.01.2042	237.242	0,00 %
SNCF Reseau EPIC	€ 200.000	1,50 %	29.05.2037	234.119	0,00 %
Electricite de France SA	\$ 200.000	4,95 %	13.10.2045	226.899	0,00 %
SNCF Mobilites	€ 150.000	4,63 %	02.02.2024	226.757	0,00 %
BNP Paribas SA	\$ 225.000	2,45 %	17.03.2019	225.868	0,00 %
BPCE SA	\$ 200.000	5,70 %	22.10.2023	221.534	0,00 %
Electricite de France SA	\$ 200.000	4,88 %	22.01.2044	220.790	0,00 %
Electricite de France SA	\$ 200.000	6,00 %	22.01.2114	219.500	0,00 %
BPCE SA	\$ 200.000	5,15 %	21.07.2024	216.432	0,00 %
Societe Generale SA	\$ 200.000	5,20 %	15.04.2021	215.309	0,00 %
Orange SA	\$ 200.000	4,13 %	14.09.2021	211.587	0,00 %
BNP Paribas SA	\$ 200.000	4,25 %	15.10.2024	210.653	0,00 %
Societe Generale SA	\$ 200.000	4,75 %	24.11.2025	210.135	0,00 %
French Republic Government Bond OAT	€ 150.000	8,50 %	25.10.2019	209.834	0,00 %
BPCE SA	\$ 200.000	4,50 %	15.03.2025	208.936	0,00 %
La Poste SA	€ 150.000	4,25 %	08.11.2021	208.430	0,00 %
Danone SA	\$ 200.000	3,00 %	15.06.2022	201.038	0,00 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	\$ 200.000	2,75 %	22.01.2019	201.027	0,00 %
Total Capital International SA	\$ 200.000	2,13 %	10.01.2019	200.104	0,00 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	\$ 200.000	2,50 %	13.04.2021	199.529	0,00 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 150.000	4,25 %	25.04.2020	199.463	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Banque Federative du Credit Mutuel SA	\$ 200.000	2,00 %	12.04.2019	199.415	0,00 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	\$ 200.000	2,20 %	20.07.2020	198.288	0,00 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	€ 150.000	5,00 %	08.04.2019	192.470	0,00 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 150.000	4,38 %	25.04.2019	191.379	0,00 %
Electricite de France SA	£ 100.000	5,50 %	17.10.2041	177.494	0,00 %
Electricite de France SA	£ 100.000	5,13 %	22.09.2050	173.853	0,00 %
AXA SA^	£ 100.000	5,63 %	16.01.2054	164.529	0,00 %
Pernod Ricard SA	\$ 150.000	4,45 %	15.01.2022	159.231	0,00 %
SNCF Reseau EPIC	€ 100.000	4,25 %	07.10.2026	157.011	0,00 %
Veolia Environnement SA	€ 100.000	4,63 %	30.03.2027	156.749	0,00 %
AXA SA	£ 100.000	7,13 %	15.12.2020	156.735	0,00 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	\$ 150.000	3,38 %	20.03.2024	156.635	0,00 %
Veolia Environnement SA	€ 80.000	6,13 %	25.11.2033	154.836	0,00 %
AXA SA^	£ 100.000	5,45 %	04.03.2166	154.430	0,00 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 100.000	4,00 %	15.12.2025	153.936	0,00 %
Pernod Ricard SA	\$ 150.000	3,25 %	08.06.2026	149.813	0,00 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 100.000	5,75 %	04.10.2021	146.279	0,00 %
Electricite de France SA	€ 100.000	4,00 %	12.11.2025	146.194	0,00 %
BNP Paribas SA	€ 100.000	4,50 %	21.03.2023	145.439	0,00 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	€ 100.000	3,60 %	08.03.2024	144.764	0,00 %
Orange SA^	€ 100.000	5,00 %	01.10.2166	142.400	0,00 %
Total Capital International SA	£ 100.000	2,25 %	09.06.2022	141.688	0,00 %
Credit Agricole SA	€ 100.000	3,13 %	05.02.2026	141.183	0,00 %
Holding d'Infrastructures de Transport SAS	€ 100.000	4,88 %	27.10.2021	141.084	0,00 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 100.000	4,25 %	26.01.2022	140.780	0,00 %
COFACE SA	€ 100.000	4,13 %	27.03.2024	140.494	0,00 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 100.000	4,88 %	25.05.2021	140.445	0,00 %
Total Capital International SA	£ 100.000	2,25 %	17.12.2020	140.234	0,00 %
BPCE SFH SA	€ 100.000	4,00 %	23.03.2022	140.210	0,00 %
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA	€ 100.000	5,00 %	24.05.2021	139.643	0,00 %
RTE Reseau de Transport d'Electricite SA	€ 100.000	2,75 %	20.06.2029	138.763	0,00 %
Arkea Home Loans SFH SA	€ 100.000	4,50 %	13.04.2021	138.401	0,00 %
Airbus SE	\$ 130.000	3,95 %	10.04.2047	137.850	0,00 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH S.A.	€ 100.000	4,38 %	17.03.2021	137.585	0,00 %
Region of Ile de France	€ 100.000	2,38 %	24.04.2026	137.530	0,00 %
BPCE SFH SA	€ 100.000	3,75 %	13.09.2021	136.992	0,00 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 100.000	3,00 %	28.11.2023	136.937	0,00 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	€ 100.000	2,40 %	17.01.2025	136.845	0,00 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 100.000	2,38 %	25.05.2024	136.612	0,00 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 100.000	2,38 %	25.01.2024	136.326	0,00 %
Electricite de France SA	\$ 100.000	6,95 %	26.01.2039	136.237	0,00 %
Autoroutes du Sud de la France SA	€ 100.000	2,95 %	17.01.2024	136.207	0,00 %
RTE Reseau de Transport d'Electricite SA	€ 100.000	2,88 %	12.09.2023	135.895	0,00 %
Total Capital International SA	€ 100.000	2,50 %	25.03.2026	135.885	0,00 %
Regie Autonome des Transports Parisiens	€ 100.000	2,88 %	09.09.2022	135.856	0,00 %
Agence Francaise de Developpement	€ 100.000	2,25 %	28.05.2026	135.496	0,00 %
Suez	€ 100.000	2,75 %	09.10.2023	135.475	0,00 %
Agence Francaise de Developpement	€ 100.000	2,25 %	27.05.2025	135.161	0,00 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	€ 100.000	3,88 %	12.01.2021	135.011	0,00 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	€ 100.000	3,75 %	11.01.2021	134.547	0,00 %
Sanofi	€ 100.000	2,50 %	14.11.2023	134.164	0,00 %
BPCE SA	€ 100.000	2,88 %	22.04.2026	132.778	0,00 %
Orange SA^	€ 100.000	4,00 %	01.10.2166	132.748	0,00 %
Credit Agricole SA	€ 100.000	2,38 %	20.05.2024	132.678	0,00 %
Bpifrance Financement SA	€ 100.000	2,38 %	25.04.2022	132.500	0,00 %
HSBC SFH France SA	€ 100.000	2,00 %	16.10.2023	132.301	0,00 %
CIF Euromortgage SA	€ 100.000	3,50 %	17.06.2020	131.018	0,00 %
Lafarge SA	\$ 100.000	7,13 %	15.07.2036	131.000	0,00 %
Agence Francaise de Developpement	€ 100.000	3,63 %	21.04.2020	130.839	0,00 %
BPCE SFH SA	€ 100.000	1,75 %	27.06.2024	130.825	0,00 %
Orange SA	\$ 125.000	5,38 %	08.07.2019	130.490	0,00 %
Legrand SA	€ 100.000	1,88 %	16.12.2027	129.405	0,00 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 100.000	2,63 %	24.02.2021	129.402	0,00 %
BNP Paribas SA^	€ 100.000	2,63 %	14.10.2027	129.243	0,00 %
Sanofi	€ 100.000	1,75 %	10.09.2026	129.241	0,00 %
Carmila SAS	€ 100.000	2,38 %	16.09.2024	128.606	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Carmila SAS	€ 100.000	2,38 %	18.09.2023	128.606	0,00 %
Holding d'Infrastructures de Transport SAS	€ 100.000	2,25 %	24.03.2025	128.585	0,00 %
BNP Paribas SA	€ 100.000	2,38 %	17.02.2025	128.436	0,00 %
Agence Francaise de Developpement	€ 100.000	2,13 %	15.02.2021	128.382	0,00 %
Infra Park SAS	€ 100.000	2,13 %	16.04.2025	128.291	0,00 %
BNP Paribas SA^	€ 100.000	2,88 %	20.03.2026	128.259	0,00 %
Credit Agricole SA	€ 100.000	2,38 %	27.11.2020	128.242	0,00 %
Sanofi	€ 100.000	1,50 %	22.09.2025	127.938	0,00 %
Wendel SA	€ 100.000	2,50 %	09.02.2027	127.910	0,00 %
BPCE SA	€ 100.000	2,13 %	17.03.2021	127.780	0,00 %
Klepierre SA	€ 100.000	1,75 %	06.11.2024	127.573	0,00 %
ICADE	€ 100.000	1,88 %	14.09.2022	127.516	0,00 %
RCI Banque SA	€ 100.000	2,25 %	29.03.2021	127.344	0,00 %
ICADE	€ 100.000	2,25 %	16.04.2021	127.272	0,00 %
La Banque Postale SA^	€ 100.000	2,75 %	23.04.2026	127.243	0,00 %
Carrefour SA	€ 100.000	1,75 %	15.07.2022	126.867	0,00 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 100.000	1,50 %	16.04.2021	126.866	0,00 %
Suez^	€ 100.000	2,50 %	30.03.2166	126.611	0,00 %
Aeroports de Paris	€ 100.000	1,50 %	24.07.2023	126.519	0,00 %
Suez^	€ 100.000	3,00 %	23.06.2166	126.504	0,00 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 100.000	1,75 %	16.07.2020	126.224	0,00 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 100.000	4,25 %	07.02.2019	126.218	0,00 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	€ 100.000	1,75 %	13.11.2020	125.730	0,00 %
Publicis Groupe SA	€ 100.000	1,63 %	16.12.2024	125.667	0,00 %
Eutelsat SA	€ 100.000	2,63 %	13.01.2020	125.472	0,00 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	€ 100.000	1,63 %	11.03.2020	125.236	0,00 %
BNP Paribas SA	\$ 125.000	2,38 %	21.05.2020	125.016	0,00 %
BPCE SFH SA	€ 100.000	1,75 %	29.11.2019	124.900	0,00 %
RTE Reseau de Transport d'Electricite SA	€ 100.000	2,00 %	18.04.2036	124.802	0,00 %
Societe Generale SFH SA	€ 100.000	2,88 %	14.03.2019	124.787	0,00 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH S.A.	€ 100.000	1,38 %	22.04.2020	124.769	0,00 %
HSBC France SA	€ 100.000	1,88 %	16.01.2020	124.737	0,00 %
Gecina SA	€ 100.000	1,50 %	20.01.2025	124.691	0,00 %
Pernod Ricard SA	€ 100.000	1,50 %	18.05.2026	124.615	0,00 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 100.000	1,25 %	29.05.2020	124.611	0,00 %
Air Liquide Finance SA	€ 100.000	1,25 %	03.06.2025	124.567	0,00 %
Danone SA	€ 100.000	1,25 %	30.05.2024	124.309	0,00 %
Orange SA	€ 100.000	1,88 %	02.10.2019	124.241	0,00 %
RCI Banque SA	€ 100.000	1,38 %	17.11.2020	124.144	0,00 %
Schneider Electric SE	\$ 125.000	2,95 %	27.09.2022	124.122	0,00 %
Danone SA	€ 100.000	1,13 %	14.01.2025	123.202	0,00 %
Sanofi	€ 100.000	0,88 %	22.09.2021	123.151	0,00 %
Carrefour SA	€ 100.000	1,75 %	22.05.2019	123.113	0,00 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	€ 100.000	0,63 %	28.11.2022	123.083	0,00 %
Credit Agricole SA	€ 100.000	0,88 %	19.01.2022	122.945	0,00 %
Kering	€ 100.000	0,88 %	28.03.2022	122.845	0,00 %
Edenred	€ 100.000	1,38 %	10.03.2025	122.811	0,00 %
Agence Francaise de Developpement	€ 100.000	1,25 %	25.05.2019	122.788	0,00 %
Societe Generale SA	€ 100.000	0,75 %	25.11.2020	122.467	0,00 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 100.000	1,13 %	11.03.2019	122.254	0,00 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 100.000	0,25 %	16.03.2022	121.385	0,00 %
Air Liquide Finance SA	€ 100.000	0,75 %	13.06.2024	121.380	0,00 %
RCI Banque SA	€ 100.000	0,63 %	04.03.2020	121.344	0,00 %
Valeo SA	€ 100.000	0,63 %	11.01.2023	121.088	0,00 %
PSA Banque France SA	€ 100.000	0,50 %	17.01.2020	121.006	0,00 %
Air Liquide Finance SA	€ 100.000	0,38 %	18.04.2022	120.856	0,00 %
Autoroutes du Sud de la France SA	€ 100.000	1,00 %	13.05.2026	120.693	0,00 %
Air Liquide Finance SA	€ 100.000	0,13 %	13.06.2020	120.461	0,00 %
ICADE	€ 100.000	1,13 %	17.11.2025	119.688	0,00 %
BNP Paribas SA	\$ 100.000	5,00 %	15.01.2021	107.274	0,00 %
Electricite de France SA	\$ 100.000	6,50 %	26.01.2019	104.298	0,00 %
Credit Agricole SA	\$ 100.000	2,75 %	10.06.2020	100.750	0,00 %
Total Capital Canada Ltd.	\$ 100.000	2,75 %	15.07.2023	100.436	0,00 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 50.000	3,88 %	25.04.2055	87.528	0,00 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 50.000	5,38 %	08.07.2024	79.341	0,00 %
Electricite de France SA	€ 50.000	4,50 %	12.11.2040	78.841	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Electricite de France SA	€ 50.000	4,63 %	11.09.2024	74.723	0,00 %
Autoroutes du Sud de la France SA	€ 50.000	5,63 %	04.07.2022	74.148	0,00 %
SNCF Reseau EPIC	€ 50.000	6,00 %	12.10.2020	70.456	0,00 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 50.000	4,88 %	02.06.2021	70.292	0,00 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 50.000	4,38 %	15.04.2021	68.947	0,00 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 50.000	4,25 %	26.01.2021	68.197	0,00 %
BNP Paribas SA	€ 50.000	2,88 %	26.09.2023	67.862	0,00 %
Carrefour SA	€ 50.000	3,88 %	25.04.2021	67.302	0,00 %
BNP Paribas SA	€ 50.000	2,88 %	24.10.2022	67.166	0,00 %
Credit Agricole SA	€ 50.000	3,90 %	19.04.2021	67.119	0,00 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 50.000	3,75 %	25.10.2020	66.926	0,00 %
Orange SA	€ 50.000	3,88 %	14.01.2021	66.819	0,00 %
BNP Paribas SA	€ 50.000	3,75 %	25.11.2020	66.463	0,00 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 50.000	4,13 %	20.07.2020	66.311	0,00 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 50.000	3,50 %	24.09.2020	66.155	0,00 %
Autoroutes du Sud de la France SA	€ 50.000	4,13 %	13.04.2020	65.622	0,00 %
SNCF Mobilites	€ 50.000	3,63 %	03.06.2020	65.595	0,00 %
Aeroports de Paris	€ 50.000	3,89 %	10.05.2020	65.542	0,00 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH S.A.	€ 50.000	3,13 %	09.09.2020	65.522	0,00 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	€ 50.000	3,75 %	19.02.2020	65.280	0,00 %
Credit Agricole SA	€ 50.000	5,88 %	11.06.2019	65.089	0,00 %
Bouygues SA	€ 50.000	3,64 %	29.10.2019	64.050	0,00 %
Total Capital SA	€ 50.000	4,88 %	28.01.2019	63.304	0,00 %
Caisse des Depots et Consignations	€ 50.000	4,13 %	20.02.2019	63.187	0,00 %
RCI Banque SA	€ 50.000	1,13 %	30.09.2019	61.222	0,00 %
Total Capital International SA	AUD 70.000	4,25 %	26.11.2021	57.339	0,00 %
				630.589.013	6,63 %
Deutschland 6,08 % (2016: 5,91 %)					
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 30.350.000	2,25 %	04.09.2020	39.192.980	0,41 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 12.850.000	4,75 %	04.07.2034	24.696.410	0,26 %
Bundesobligation	€ 17.191.434	0,00 %	07.10.2022	20.836.077	0,22 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 16.925.098	0,50 %	15.08.2027	20.453.770	0,22 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 15.400.000	2,25 %	04.09.2021	20.303.569	0,21 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 12.700.000	3,25 %	04.07.2021	17.230.607	0,18 %
Bundesobligation	€ 12.000.000	0,50 %	12.04.2019	14.629.231	0,15 %
Bundesobligation	€ 10.000.000	0,00 %	08.10.2021	12.178.634	0,13 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 4.610.000	5,50 %	04.01.2031	8.867.868	0,09 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 4.800.000	4,00 %	04.01.2037	8.814.629	0,09 %
Bundesobligation	€ 7.000.000	0,00 %	08.04.2022	8.509.241	0,09 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 5.050.000	2,50 %	04.07.2044	7.884.234	0,08 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 4.400.000	3,25 %	04.07.2042	7.699.605	0,08 %
KfW	€ 5.600.000	1,63 %	15.01.2021	7.128.399	0,08 %
Bundesland Berlin Deutschland	€ 5.000.000	3,13 %	17.08.2021	6.719.010	0,07 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 4.100.000	2,50 %	15.08.2046	6.459.245	0,07 %
Bundesobligation	€ 5.000.000	0,25 %	16.10.2020	6.137.421	0,07 %
Bundesobligation	€ 5.000.000	0,00 %	17.04.2020	6.085.582	0,07 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 5.000.000	0,00 %	18.02.2019	6.036.776	0,06 %
KfW	€ 5.000.000	0,50 %	15.09.2027	5.944.368	0,06 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 2.600.000	4,75 %	04.07.2040	5.446.156	0,06 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 4.100.000	1,00 %	15.08.2024	5.235.121	0,06 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 3.850.000	1,75 %	04.07.2022	5.047.100	0,05 %
Land Rheinland-Pfalz	€ 4.000.000	0,00 %	23.03.2020	4.843.004	0,05 %
Land Niedersachsen	€ 4.000.000	0,00 %	01.03.2021	4.836.457	0,05 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 3.600.000	2,00 %	04.01.2022	4.731.483	0,05 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 2.350.000	4,25 %	04.07.2039	4.580.645	0,05 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 3.541.000	0,25 %	15.02.2027	4.209.308	0,05 %
Land Nordrhein-Westfalen	\$ 4.000.000	1,88 %	17.06.2019	3.985.040	0,04 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 2.800.000	1,75 %	15.02.2024	3.726.256	0,04 %
Bundesobligation	€ 3.000.000	0,25 %	11.10.2019	3.660.078	0,04 %
KfW	€ 3.000.000	0,00 %	30.06.2021	3.636.439	0,04 %
Land Niedersachsen	€ 3.000.000	0,00 %	10.01.2022	3.614.356	0,04 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 3.000.000	0,00 %	05.12.2022	3.594.298	0,04 %
Bundesschatzanweisungen	€ 2.900.000	0,00 %	14.12.2018	3.503.910	0,04 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 2.650.000	2,50 %	04.01.2021	3.471.324	0,04 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 2.600.000	1,25 %	15.08.2048	3.111.156	0,03 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Landwirtschaftliche Rentenbank	€ 2.500.000	0,38 %	22.01.2024	3.038.853	0,03 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 2.500.000	0,00 %	15.04.2019	3.021.030	0,03 %
KFW	£ 2.200.000	1,13 %	23.12.2019	3.006.822	0,03 %
KFW	\$ 2.900.000	1,88 %	30.06.2020	2.882.194	0,03 %
KFW	€ 2.250.000	1,13 %	15.01.2020	2.791.616	0,03 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 2.150.000	3,25 %	04.01.2020	2.783.641	0,03 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 2.300.000	0,00 %	26.02.2019	2.777.163	0,03 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 2.000.000	3,50 %	04.07.2019	2.554.990	0,03 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	\$ 2.500.000	1,88 %	22.01.2020	2.490.550	0,03 %
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	€ 2.000.000	1,13 %	19.02.2019	2.435.158	0,03 %
Land Hessen	€ 2.000.000	0,00 %	15.09.2021	2.410.181	0,03 %
HSH Nordbank AG	€ 2.000.000	0,10 %	20.07.2020	2.407.923	0,03 %
Volkswagen Leasing GmbH	€ 2.000.000	0,25 %	05.10.2020	2.405.899	0,03 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	€ 2.000.000	0,13 %	14.04.2023	2.403.574	0,03 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	€ 2.000.000	0,25 %	18.03.2024	2.402.282	0,03 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	€ 2.000.000	0,63 %	18.05.2027	2.401.379	0,03 %
KFW	€ 1.950.000	0,63 %	15.01.2025	2.399.268	0,03 %
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	€ 2.000.000	0,38 %	09.10.2024	2.396.912	0,03 %
Free & Hanseatic City of Hamburg	€ 2.000.000	0,25 %	20.01.2025	2.383.307	0,03 %
UniCredit Bank AG	€ 2.000.000	0,13 %	26.10.2023	2.383.012	0,03 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 1.750.000	3,00 %	04.07.2020	2.290.270	0,03 %
KFW	\$ 2.300.000	1,50 %	15.06.2021	2.242.686	0,02 %
Deutsche Bank SA Espanola	€ 1.800.000	0,63 %	15.12.2021	2.202.875	0,02 %
KFW	\$ 2.200.000	1,00 %	15.07.2019	2.164.551	0,02 %
E.ON International Finance BV	£ 1.100.000	5,88 %	30.10.2037	2.133.828	0,02 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 1.700.000	0,00 %	13.11.2020	2.058.495	0,02 %
Deutsche Bank AG	\$ 2.000.000	3,30 %	16.11.2022	1.990.624	0,02 %
KFW	\$ 2.020.000	1,75 %	15.09.2021	1.982.553	0,02 %
FMS Wertmanagement AoeR	\$ 1.980.000	2,00 %	01.08.2022	1.950.524	0,02 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 1.500.000	1,50 %	04.09.2022	1.948.661	0,02 %
KFW	\$ 1.900.000	2,13 %	15.06.2022	1.884.038	0,02 %
HSH Nordbank AG	€ 1.500.000	0,38 %	27.04.2023	1.789.683	0,02 %
KFW	£ 1.300.000	1,38 %	01.02.2021	1.789.273	0,02 %
Volkswagen International Finance NV	€ 1.400.000	0,50 %	30.03.2021	1.693.527	0,02 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 850.000	6,25 %	04.01.2030	1.690.699	0,02 %
KFW	\$ 1.600.000	2,13 %	17.01.2023	1.580.722	0,02 %
innogy Finance BV	£ 1.000.000	6,50 %	20.04.2021	1.578.040	0,02 %
Deutsche Telekom International Finance BV	\$ 1.043.000	8,75 %	15.06.2030	1.558.795	0,02 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 1.200.000	3,75 %	04.01.2019	1.505.380	0,02 %
KFW	\$ 1.480.000	1,50 %	09.09.2019	1.467.238	0,02 %
KFW	€ 1.200.000	0,00 %	15.12.2022	1.443.388	0,02 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 1.100.000	1,50 %	15.05.2023	1.436.285	0,02 %
KFW	\$ 1.400.000	1,75 %	31.03.2020	1.389.564	0,02 %
KFW	\$ 1.400.000	1,63 %	29.05.2020	1.384.505	0,02 %
KFW	\$ 1.400.000	1,50 %	20.04.2020	1.380.967	0,02 %
Volkswagen Financial Services NV	£ 1.000.000	1,75 %	12.09.2022	1.361.624	0,02 %
Santander Consumer Bank AG	€ 1.100.000	0,75 %	17.10.2022	1.321.720	0,01 %
Volkswagen Bank GmbH	€ 1.100.000	0,75 %	15.06.2023	1.315.689	0,01 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 1.050.000	1,25 %	13.03.2020	1.306.329	0,01 %
Commerzbank AG	€ 950.000	4,00 %	30.03.2027	1.302.393	0,01 %
Volkswagen International Finance NV^	€ 1.000.000	3,88 %	14.06.2166	1.267.641	0,01 %
Land Berlin	€ 1.000.000	0,75 %	08.09.2023	1.240.006	0,01 %
Volkswagen International Finance NV^	€ 1.000.000	2,70 %	14.12.2166	1.236.793	0,01 %
KFW	€ 1.000.000	1,88 %	20.03.2019	1.236.560	0,01 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 1.000.000	1,50 %	17.09.2019	1.229.518	0,01 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 1.000.000	1,75 %	26.10.2057	1.226.850	0,01 %
Daimler AG	€ 1.000.000	2,13 %	03.07.2037	1.226.204	0,01 %
Aroundtown SA	€ 1.000.000	1,88 %	19.01.2026	1.226.133	0,01 %
KFW	€ 1.000.000	0,38 %	15.03.2023	1.223.018	0,01 %
KFW	€ 1.000.000	0,00 %	28.04.2022	1.208.393	0,01 %
DVB Bank SE	€ 1.000.000	0,88 %	11.11.2019	1.203.509	0,01 %
Land Niedersachsen	€ 1.000.000	0,25 %	06.02.2024	1.203.395	0,01 %
innogy Finance BV	€ 1.000.000	1,25 %	19.10.2027	1.202.024	0,01 %
Bayerische Landesbodenkreditanstalt	€ 1.000.000	0,63 %	23.11.2026	1.197.334	0,01 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 1.000.000	0,05 %	05.09.2022	1.197.331	0,01 %
KFW	€ 1.000.000	0,38 %	09.03.2026	1.196.797	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
TLG Immobilien AG	€ 1.000.000	1,38 %	27.11.2024	1.196.082	0,01 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	€ 1.000.000	0,63 %	30.08.2027	1.193.416	0,01 %
UniCredit Bank AG	€ 1.000.000	0,50 %	04.05.2026	1.193.031	0,01 %
FMS Wertmanagement AoeR	\$ 1.200.000	1,75 %	24.01.2020	1.192.703	0,01 %
Allianz Finance II BV	€ 1.000.000	0,25 %	06.06.2023	1.192.272	0,01 %
Land Hessen	€ 1.000.000	0,13 %	20.06.2024	1.189.054	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	€ 1.000.000	0,25 %	29.08.2025	1.188.561	0,01 %
Daimler AG	€ 1.000.000	1,00 %	15.11.2027	1.181.103	0,01 %
E.ON International Finance BV	£ 600.000	6,38 %	07.06.2032	1.153.234	0,01 %
Commerzbank AG	€ 1.000.000	0,13 %	15.12.2026	1.148.449	0,01 %
KFW	\$ 1.100.000	2,75 %	08.09.2020	1.117.978	0,01 %
KFW	€ 900.000	0,88 %	18.03.2019	1.099.928	0,01 %
E.ON International Finance BV	€ 800.000	5,75 %	07.05.2020	1.092.248	0,01 %
Allianz Finance II BV	€ 900.000	0,88 %	06.12.2027	1.063.330	0,01 %
Land Bremen	€ 800.000	0,50 %	07.10.2022	980.909	0,01 %
KFW	€ 800.000	1,25 %	04.07.2036	967.812	0,01 %
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	€ 800.000	0,00 %	23.11.2020	966.395	0,01 %
KFW	€ 800.000	0,00 %	15.09.2023	955.689	0,01 %
Brenntag Finance BV	€ 800.000	1,13 %	27.09.2025	952.907	0,01 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 900.000	1,70 %	15.09.2021	874.238	0,01 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 700.000	0,50 %	15.02.2025	864.012	0,01 %
Daimler International Finance BV	€ 700.000	0,00 %	15.03.2019	841.762	0,01 %
Volkswagen Bank GmbH	€ 700.000	1,25 %	15.12.2025	835.738	0,01 %
KFW	AUD 1.000.000	4,00 %	27.02.2025	833.058	0,01 %
KFW	\$ 775.000	4,88 %	17.06.2019	807.107	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	AUD 1.000.000	2,70 %	20.01.2020	788.894	0,01 %
Aroundtown SA	£ 567.000	3,00 %	16.10.2029	769.978	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 500.000	8,50 %	18.01.2031	751.557	0,01 %
Volkswagen International Finance NV	€ 600.000	1,88 %	30.03.2027	743.384	0,01 %
Deutsche Bank AG	€ 600.000	1,00 %	18.03.2019	728.418	0,01 %
Linde Finance BV	€ 600.000	0,25 %	18.01.2022	725.223	0,01 %
Allianz Finance II BV	€ 600.000	0,00 %	21.04.2020	722.639	0,01 %
BASF SE	€ 600.000	0,88 %	15.11.2027	710.444	0,01 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	€ 600.000	0,88 %	18.01.2030	709.241	0,01 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	€ 500.000	2,75 %	19.03.2029	705.316	0,01 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 370.000	6,50 %	04.07.2027	697.057	0,01 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 400.000	4,75 %	04.07.2028	688.498	0,01 %
Free & Hanseatic City of Hamburg	€ 550.000	1,00 %	18.06.2021	687.287	0,01 %
Volkswagen Financial Services NV	£ 500.000	2,25 %	12.04.2025	681.333	0,01 %
Deutsche Bank AG	\$ 650.000	4,25 %	14.10.2021	673.750	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	£ 500.000	1,25 %	06.10.2023	666.006	0,01 %
BMW Finance NV	£ 500.000	0,88 %	16.08.2022	662.509	0,01 %
Land Hessen	€ 500.000	3,50 %	10.03.2020	651.663	0,01 %
Land Baden-Württemberg	€ 500.000	1,00 %	18.07.2022	628.392	0,01 %
Bundesland Berlin Deutschland	€ 500.000	1,63 %	26.06.2019	619.292	0,01 %
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA	€ 500.000	1,63 %	07.04.2026	617.539	0,01 %
BMW Finance NV	€ 500.000	0,88 %	17.11.2020	614.819	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 500.000	1,38 %	30.01.2027	612.361	0,01 %
KFW	£ 300.000	4,88 %	15.03.2037	611.955	0,01 %
Land Rheinland-Pfalz	€ 500.000	0,75 %	19.01.2026	611.907	0,01 %
Land Niedersachsen	€ 500.000	0,63 %	20.01.2025	611.231	0,01 %
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	€ 500.000	0,25 %	25.11.2019	608.059	0,01 %
ATF Netherlands BV	€ 500.000	1,50 %	15.07.2024	606.876	0,01 %
Daimler AG	€ 500.000	1,50 %	03.07.2029	606.590	0,01 %
Land Hessen	€ 500.000	0,13 %	14.10.2019	606.580	0,01 %
Land Berlin	€ 500.000	0,63 %	20.03.2026	605.603	0,01 %
innogy Finance BV	€ 500.000	1,00 %	13.04.2025	605.398	0,01 %
Land Rheinland-Pfalz	€ 500.000	0,50 %	21.01.2025	605.299	0,01 %
Volkswagen Leasing GmbH	€ 500.000	1,13 %	04.04.2024	604.298	0,01 %
Muenchener Hypothekenbank eG	€ 500.000	0,50 %	14.03.2025	604.191	0,01 %
Linde Finance BV	€ 500.000	1,00 %	20.04.2028	603.515	0,01 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 500.000	0,20 %	17.04.2023	602.621	0,01 %
BMW Finance NV	€ 500.000	0,13 %	15.04.2020	602.501	0,01 %
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	€ 500.000	0,00 %	12.01.2022	601.102	0,01 %
LANXESS AG	€ 500.000	0,25 %	07.10.2021	600.611	0,01 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 500.000	0,13 %	16.03.2023	600.592	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
innogy Finance BV	£ 300.000	6,13 %	06.07.2039	600.488	0,01 %
Daimler International Finance BV	€ 500.000	0,20 %	13.09.2021	600.208	0,01 %
Grand City Properties SA	€ 500.000	1,38 %	03.08.2026	597.177	0,01 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	€ 500.000	0,38 %	06.06.2025	596.399	0,01 %
Land Berlin	€ 500.000	0,25 %	22.04.2025	593.797	0,01 %
KFW	\$ 600.000	2,00 %	04.10.2022	590.597	0,01 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 500.000	1,25 %	12.05.2036	589.780	0,01 %
E.ON International Finance BV	£ 400.000	6,00 %	30.10.2019	589.552	0,01 %
Volkswagen International Finance NV	€ 500.000	1,63 %	16.01.2030	586.020	0,01 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	€ 500.000	0,63 %	26.09.2028	584.659	0,01 %
EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG^	€ 450.000	3,63 %	02.04.2076	581.520	0,01 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 350.000	6,25 %	04.01.2024	578.589	0,01 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	€ 500.000	0,88 %	11.07.2031	570.232	0,01 %
HeidelbergCement AG	€ 455.000	1,50 %	07.02.2025	562.154	0,01 %
KFW	CAD 700.000	1,38 %	28.01.2020	552.201	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	£ 400.000	1,38 %	15.12.2020	550.841	0,01 %
Land Hessen	€ 500.000	0,75 %	04.08.2036	540.359	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	CAD 675.000	1,88 %	21.11.2019	537.888	0,01 %
KFW	€ 400.000	3,38 %	18.01.2021	534.983	0,01 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	€ 400.000	2,50 %	29.03.2022	530.742	0,01 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 500.000	1,00 %	16.10.2046	526.236	0,01 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 400.000	1,50 %	15.05.2024	525.725	0,01 %
BMW Finance NV	€ 410.000	1,00 %	15.02.2022	508.477	0,01 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	€ 400.000	1,13 %	30.09.2024	506.206	0,01 %
Sparkasse KoelnBonn	€ 400.000	1,13 %	14.10.2024	503.669	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 500.000	2,85 %	06.01.2022	502.411	0,01 %
innogy Finance BV	£ 300.000	4,75 %	31.01.2034	500.017	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 500.000	2,25 %	02.03.2020	497.804	0,01 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 400.000	0,88 %	16.12.2019	492.580	0,01 %
Volkswagen International Finance NV	€ 400.000	1,13 %	02.10.2023	490.152	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 400.000	1,50 %	03.04.2028	489.069	0,01 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 400.000	0,50 %	19.01.2023	487.863	0,01 %
Volkswagen Financial Services AG	€ 400.000	0,75 %	14.10.2021	487.841	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	\$ 500.000	1,95 %	19.09.2021	486.408	0,01 %
BMW Finance NV	€ 400.000	0,88 %	03.04.2025	486.358	0,01 %
Muenchener Hypothekenbank eG	€ 400.000	0,38 %	24.09.2019	486.167	0,01 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	€ 400.000	0,25 %	20.11.2019	485.888	0,01 %
Land Baden-Württemberg	€ 400.000	0,63 %	27.01.2026	485.408	0,01 %
NRW Bank	€ 400.000	0,13 %	18.01.2021	485.200	0,01 %
Commerzbank AG	€ 400.000	0,25 %	26.01.2022	485.153	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 400.000	0,63 %	03.04.2023	483.936	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 400.000	0,25 %	19.04.2021	482.236	0,01 %
Deutsche Bank AG	€ 400.000	0,25 %	08.03.2024	477.473	0,01 %
KFW	€ 350.000	3,50 %	04.07.2021	475.768	0,01 %
KFW	£ 300.000	5,55 %	07.06.2021	470.280	0,01 %
Wirtschafts- und Infrastrukturbank Hessen	€ 350.000	1,75 %	15.04.2024	453.950	0,01 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 350.000	4,00 %	22.10.2019	453.007	0,01 %
innogy Finance BV	€ 350.000	6,63 %	31.01.2019	450.893	0,01 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 450.000	1,30 %	13.09.2019	443.304	0,01 %
BMW US Capital LLC	\$ 450.000	2,80 %	11.04.2026	439.079	0,01 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 400.000	4,20 %	16.03.2047	439.010	0,01 %
Daimler AG	£ 300.000	1,00 %	20.12.2019	405.800	0,01 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 400.000	3,13 %	16.03.2024	405.290	0,01 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 400.000	2,20 %	16.03.2020	399.490	0,01 %
KFW	\$ 400.000	2,50 %	20.11.2024	398.878	0,01 %
FMS Wertmanagement AoeR	\$ 400.000	1,75 %	17.03.2020	397.139	0,01 %
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale	€ 300.000	1,88 %	26.06.2023	393.406	0,01 %
Deutsche Kreditbank AG	€ 300.000	1,63 %	18.06.2024	388.963	0,01 %
HeidelbergCement AG	€ 300.000	2,25 %	03.06.2024	387.303	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	\$ 400.000	2,00 %	13.01.2025	386.818	0,01 %
Merck KGaA^	€ 300.000	2,63 %	12.12.2074	380.954	0,01 %
Bertelsmann SE & Co. KGaA^	€ 300.000	3,00 %	23.04.2075	379.991	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	€ 300.000	1,38 %	19.11.2020	378.507	0,01 %
SAP SE	€ 300.000	1,13 %	20.02.2023	376.093	0,00 %
SAP SE	€ 300.000	1,00 %	01.04.2025	373.108	0,00 %
BMW Finance NV	€ 300.000	1,63 %	17.07.2019	370.168	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
LEG Immobilien AG	€ 300.000	1,25 %	23.01.2024	367.657	0,00 %
KFW	NOK(kr) 3.000.000	1,00 %	04.11.2020	366.909	0,00 %
Eurogrid GmbH	€ 300.000	1,50 %	18.04.2028	366.862	0,00 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	NZ(\$) 500.000	4,00 %	30.01.2020	366.780	0,00 %
Land Hessen	€ 300.000	0,38 %	04.07.2022	366.544	0,00 %
BMW US Capital LLC	€ 300.000	0,63 %	20.04.2022	365.736	0,00 %
Commerzbank AG	€ 300.000	0,25 %	23.07.2020	364.630	0,00 %
Volkswagen Leasing GmbH	€ 300.000	1,38 %	20.01.2025	364.468	0,00 %
BMW Finance NV	€ 300.000	0,75 %	12.07.2024	363.594	0,00 %
Gemeinsame Deutsche Bundesländer	€ 300.000	0,50 %	05.02.2025	363.303	0,00 %
Land Hessen	€ 300.000	0,50 %	17.02.2025	363.295	0,00 %
Landesbank Baden-Württemberg	€ 300.000	0,05 %	13.01.2020	362.928	0,00 %
Continental Rubber of America Corp.	€ 300.000	0,50 %	19.02.2019	362.803	0,00 %
Landesbank Baden-Württemberg	€ 300.000	0,38 %	29.01.2019	362.228	0,00 %
Landesbank Baden-Württemberg	€ 300.000	0,13 %	21.02.2022	362.221	0,00 %
Landesbank Baden-Württemberg	€ 300.000	0,10 %	21.01.2019	362.103	0,00 %
Landesbank Baden-Württemberg	€ 300.000	0,05 %	11.11.2021	361.656	0,00 %
Deutsche Hypothekbank AG	€ 300.000	0,25 %	22.02.2023	361.554	0,00 %
Allianz Finance II BV	€ 300.000	1,38 %	21.04.2031	359.945	0,00 %
Deutsche Hypothekbank AG	€ 300.000	0,25 %	17.05.2024	358.491	0,00 %
KFW	\$ 350.000	1,88 %	15.12.2020	348.061	0,00 %
Fresenius Finance Ireland plc	€ 278.000	1,50 %	30.01.2024	344.864	0,00 %
KFW	\$ 350.000	2,00 %	02.05.2025	337.553	0,00 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	\$ 325.000	2,50 %	15.11.2027	322.058	0,00 %
Volkswagen International Finance NV^	€ 250.000	3,75 %	24.03.2166	321.514	0,00 %
Deutsche Boerse AG^	€ 250.000	2,75 %	05.02.2041	321.205	0,00 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 275.000	4,40 %	27.05.2045	309.817	0,00 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 300.000	0,75 %	16.08.2041	307.809	0,00 %
NRW Bank	€ 250.000	0,63 %	24.06.2019	304.806	0,00 %
Berlin Hyp AG	€ 250.000	0,13 %	22.10.2020	302.903	0,00 %
UniCredit Bank AG	€ 250.000	0,05 %	16.12.2019	302.307	0,00 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 300.000	2,70 %	16.03.2022	301.959	0,00 %
Daimler AG	£ 200.000	2,13 %	07.06.2022	279.464	0,00 %
FMS Wertmanagement AoeR	£ 200.000	1,25 %	08.03.2019	272.674	0,00 %
BASF SE	£ 200.000	1,75 %	11.03.2025	271.900	0,00 %
FMS Wertmanagement AoeR	£ 200.000	0,88 %	14.05.2021	271.247	0,00 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 200.000	3,00 %	08.09.2021	267.890	0,00 %
Allianz SE^	CHF 250.000	3,25 %	04.07.2166	266.414	0,00 %
KFW	€ 200.000	2,50 %	17.01.2022	266.277	0,00 %
Deutsche Telekom International Finance BV	£ 200.000	2,25 %	13.04.2029	266.027	0,00 %
Land Baden-Württemberg	€ 200.000	2,00 %	13.11.2023	265.757	0,00 %
Land Berlin	€ 200.000	1,88 %	12.06.2023	262.808	0,00 %
Gemeinsame Deutsche Bundesländer	€ 200.000	1,75 %	14.05.2024	262.537	0,00 %
Covestro AG	€ 200.000	1,75 %	25.09.2024	255.131	0,00 %
Deutsche Bank AG	€ 258.230	0,00 %	15.10.2026	253.723	0,00 %
Eurogrid GmbH	€ 200.000	1,63 %	03.11.2023	253.100	0,00 %
Land Berlin	€ 200.000	1,50 %	21.01.2021	253.021	0,00 %
Deutsche Telekom International Finance BV	\$ 250.000	3,60 %	19.01.2027	251.422	0,00 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 250.000	2,25 %	03.09.2019	249.454	0,00 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	€ 200.000	1,63 %	01.10.2019	249.281	0,00 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 250.000	2,15 %	27.05.2020	249.075	0,00 %
BMW US Capital LLC	€ 200.000	1,13 %	18.09.2021	248.367	0,00 %
State of North Rhine-Westphalia Germany	\$ 250.000	1,63 %	22.01.2020	247.185	0,00 %
Evonik Industries AG^	€ 200.000	2,13 %	07.07.2077	246.013	0,00 %
HSH Nordbank AG	€ 200.000	0,75 %	07.10.2021	244.751	0,00 %
Land Niedersachsen	€ 200.000	0,40 %	10.07.2020	244.530	0,00 %
Bayerische Landesbodenkreditanstalt	€ 200.000	0,75 %	28.05.2025	244.464	0,00 %
Deutsche Bank SA Espanola	€ 200.000	0,63 %	25.11.2020	244.407	0,00 %
Gemeinsame Deutsche Bundesländer	€ 200.000	0,38 %	23.06.2020	244.363	0,00 %
Fresenius Finance Ireland plc	€ 200.000	0,88 %	31.01.2022	244.100	0,00 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 200.000	0,75 %	14.03.2019	243.776	0,00 %
Land Thüringen	€ 200.000	0,25 %	09.12.2019	243.237	0,00 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	€ 200.000	0,25 %	24.11.2022	243.011	0,00 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 200.000	0,25 %	30.07.2020	242.822	0,00 %
BMW Finance NV	€ 200.000	0,75 %	15.04.2024	242.614	0,00 %
Land Niedersachsen	€ 200.000	0,13 %	12.08.2019	242.408	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 200.000	0,13 %	27.11.2020	242.097	0,00 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 200.000	0,05 %	06.07.2021	241.930	0,00 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 200.000	0,20 %	01.03.2022	241.570	0,00 %
Berlin Hyp AG	€ 200.000	0,25 %	22.02.2023	241.489	0,00 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 200.000	0,05 %	09.08.2021	241.019	0,00 %
DVB Bank SE	€ 200.000	1,00 %	29.07.2019	240.974	0,00 %
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	€ 200.000	0,13 %	30.09.2022	240.519	0,00 %
BMW US Capital LLC	€ 200.000	1,00 %	20.04.2027	240.291	0,00 %
HSH Nordbank AG	€ 200.000	0,13 %	24.02.2021	239.974	0,00 %
Deutsche Apotheker-und Aerztebank eG	€ 200.000	0,15 %	07.03.2023	239.680	0,00 %
LANXESS AG	€ 200.000	1,00 %	07.10.2026	237.746	0,00 %
Deutsche Telekom International Finance BV	\$ 225.000	2,82 %	19.01.2022	225.045	0,00 %
Deutsche Telekom International Finance BV	\$ 225.000	2,23 %	17.01.2020	223.914	0,00 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 200.000	0,38 %	29.04.2030	223.054	0,00 %
Deutsche Telekom International Finance BV	£ 100.000	8,88 %	27.11.2028	218.061	0,00 %
Fresenius Medical Care US Finance, Inc.	\$ 200.000	5,75 %	15.02.2021	216.250	0,00 %
Henkel AG & Co. KGaA	£ 158.000	0,88 %	13.09.2022	211.286	0,00 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 200.000	3,25 %	01.08.2024	203.148	0,00 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 200.000	3,40 %	16.03.2027	203.089	0,00 %
Deutsche Bank AG	\$ 200.000	3,70 %	30.05.2024	201.080	0,00 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 200.000	2,70 %	03.08.2020	200.948	0,00 %
State of North Rhine-Westphalia Germany	\$ 200.000	2,38 %	16.09.2021	199.736	0,00 %
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	\$ 200.000	1,63 %	01.02.2019	199.258	0,00 %
BMW US Capital LLC	\$ 200.000	2,15 %	06.04.2020	199.258	0,00 %
Volkswagen Group of America Finance LLC	\$ 200.000	2,13 %	23.05.2019	199.160	0,00 %
Volkswagen Group of America Finance LLC	\$ 200.000	2,40 %	22.05.2020	199.082	0,00 %
Deutsche Bank AG	\$ 200.000	2,70 %	13.07.2020	199.036	0,00 %
Land Rheinland-Pfalz	€ 150.000	2,38 %	23.02.2022	198.279	0,00 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 200.000	1,50 %	05.07.2019	197.664	0,00 %
KFW	£ 100.000	6,00 %	07.12.2028	195.875	0,00 %
NRW Bank	€ 150.000	3,88 %	27.01.2020	195.844	0,00 %
Land Niedersachsen	€ 150.000	1,63 %	23.07.2021	191.583	0,00 %
Land Hessen	€ 150.000	1,75 %	19.06.2020	189.484	0,00 %
KFW	€ 150.000	3,88 %	21.01.2019	188.586	0,00 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	\$ 200.000	1,75 %	27.07.2026	187.395	0,00 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 150.000	2,13 %	03.06.2019	186.452	0,00 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	€ 150.000	2,00 %	20.02.2019	185.363	0,00 %
KFW	€ 150.000	0,13 %	01.06.2020	182.535	0,00 %
Deutsche Telekom International Finance BV	£ 100.000	6,50 %	08.04.2022	163.642	0,00 %
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen^	£ 100.000	6,63 %	26.05.2042	162.144	0,00 %
Fresenius Finance Ireland plc	€ 127.000	2,13 %	01.02.2027	160.329	0,00 %
Deutsche Bank AG	\$ 150.000	4,10 %	13.01.2026	155.670	0,00 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 150.000	3,45 %	06.01.2027	153.453	0,00 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 125.000	6,13 %	17.08.2026	151.259	0,00 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	£ 100.000	3,13 %	24.07.2026	151.013	0,00 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 150.000	2,45 %	18.05.2020	149.864	0,00 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 150.000	2,30 %	06.01.2020	149.652	0,00 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 150.000	2,20 %	05.05.2020	149.154	0,00 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	\$ 150.000	2,38 %	10.06.2025	148.387	0,00 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	£ 100.000	2,75 %	10.09.2025	146.313	0,00 %
Allianz SE^	€ 100.000	5,63 %	17.10.2042	146.150	0,00 %
Allianz SE^	€ 100.000	4,75 %	24.10.2166	142.617	0,00 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 150.000	3,30 %	15.09.2046	142.145	0,00 %
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen^	€ 100.000	6,00 %	26.05.2041	141.655	0,00 %
BMW Finance NV	£ 100.000	2,38 %	01.12.2021	141.265	0,00 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 150.000	2,35 %	15.10.2026	140.913	0,00 %
Allianz Finance II BV^	€ 100.000	5,75 %	08.07.2041	140.757	0,00 %
BMW US Capital LLC	£ 100.000	2,00 %	20.11.2019	137.778	0,00 %
Volkswagen Financial Services NV	£ 100.000	1,75 %	17.04.2020	136.910	0,00 %
Volkswagen Financial Services NV	£ 100.000	1,50 %	12.04.2021	135.859	0,00 %
Talanx AG	€ 100.000	2,50 %	23.07.2026	135.561	0,00 %
Volkswagen International Finance NV^	€ 100.000	4,63 %	24.03.2166	135.240	0,00 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 100.000	3,38 %	17.06.2021	134.907	0,00 %
Deutsche Postbank AG	€ 100.000	3,63 %	15.02.2021	134.034	0,00 %
German Postal Pensions Securitisation plc	€ 100.000	3,75 %	18.01.2021	133.722	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Merck KGaA^	€ 100.000	3,38 %	12.12.2074	132.679	0,00 %
Deutsche Börse AG	€ 100.000	2,38 %	05.10.2022	132.502	0,00 %
Land Bremen	€ 100.000	1,88 %	18.03.2024	131.673	0,00 %
Bayer AG^	€ 100.000	3,75 %	01.07.2074	131.482	0,00 %
Volkswagen Leasing GmbH	€ 100.000	2,63 %	15.01.2024	131.396	0,00 %
Land Hessen	€ 100.000	2,75 %	22.09.2020	130.106	0,00 %
Robert Bosch GmbH	€ 100.000	1,75 %	08.07.2024	129.476	0,00 %
Allianz Finance II BV	€ 100.000	4,75 %	22.07.2019	129.343	0,00 %
Muenchener Hypothekenbank eG	€ 100.000	1,50 %	25.06.2024	129.243	0,00 %
Bertelsmann SE & Co. KGaA	€ 100.000	1,75 %	14.10.2024	128.402	0,00 %
Eurogrid GmbH	€ 100.000	1,88 %	10.06.2025	128.069	0,00 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 100.000	1,63 %	24.10.2030	127.742	0,00 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 125.000	3,25 %	27.05.2025	126.772	0,00 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	€ 100.000	1,50 %	29.01.2021	126.529	0,00 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	€ 100.000	1,75 %	06.11.2020	126.475	0,00 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	€ 100.000	1,63 %	06.11.2030	126.457	0,00 %
Commerzbank AG	€ 100.000	1,63 %	19.10.2020	126.185	0,00 %
Deutsche Bank AG	\$ 125.000	3,38 %	12.05.2021	126.106	0,00 %
Bayer Capital Corp. BV	€ 100.000	1,25 %	13.11.2023	126.045	0,00 %
Bayer AG^	€ 100.000	3,00 %	01.07.2075	125.934	0,00 %
Land Hessen	€ 100.000	1,13 %	10.12.2021	125.914	0,00 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg^	€ 100.000	2,88 %	27.05.2026	125.780	0,00 %
Vier Gas Transport GmbH	€ 100.000	2,00 %	12.06.2020	125.777	0,00 %
Bund Laender Anleihe	€ 100.000	1,50 %	15.07.2020	125.761	0,00 %
Land Niedersachsen	€ 100.000	1,00 %	18.08.2022	125.578	0,00 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 100.000	1,00 %	16.01.2025	125.403	0,00 %
Deutsche Bank AG	\$ 125.000	2,85 %	10.05.2019	125.339	0,00 %
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	€ 100.000	1,13 %	27.05.2021	125.153	0,00 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 100.000	1,38 %	15.01.2020	124.461	0,00 %
BMW Finance NV	€ 100.000	3,25 %	14.01.2019	124.329	0,00 %
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	€ 100.000	0,88 %	21.07.2021	124.139	0,00 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	€ 100.000	1,13 %	29.05.2020	124.049	0,00 %
Wurth Finance International BV	€ 100.000	1,00 %	19.05.2022	123.905	0,00 %
Deutsche Post AG	€ 100.000	1,25 %	01.04.2026	123.761	0,00 %
Bayer AG^	€ 100.000	2,38 %	02.04.2075	123.687	0,00 %
Volkswagen International Finance NV^	€ 100.000	2,50 %	20.03.2166	123.191	0,00 %
BMW US Capital LLC	\$ 125.000	2,00 %	11.04.2021	123.153	0,00 %
Land Rheinland-Pfalz	€ 100.000	0,50 %	03.09.2021	122.910	0,00 %
Daimler AG	€ 100.000	0,88 %	12.01.2021	122.655	0,00 %
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	€ 100.000	0,63 %	05.06.2024	122.410	0,00 %
Land Hessen	€ 100.000	0,38 %	10.03.2022	122.253	0,00 %
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	€ 100.000	1,00 %	25.02.2019	121.994	0,00 %
Volkswagen International Finance NV	€ 100.000	0,88 %	16.01.2023	121.724	0,00 %
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	€ 100.000	0,25 %	21.01.2021	121.600	0,00 %
Volkswagen International Finance NV^	€ 100.000	3,50 %	20.03.2166	121.456	0,00 %
HSH Nordbank AG	€ 100.000	0,63 %	17.07.2019	121.443	0,00 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 100.000	0,13 %	16.04.2020	121.418	0,00 %
Deutsche Post AG	€ 100.000	0,38 %	01.04.2021	121.127	0,00 %
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	€ 100.000	0,13 %	29.07.2019	121.022	0,00 %
Free & Hanseatic City of Hamburg	€ 100.000	0,38 %	01.04.2025	119.857	0,00 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 125.000	2,00 %	15.09.2023	119.635	0,00 %
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	€ 100.000	0,38 %	31.03.2026	118.427	0,00 %
KFW	\$ 200.000	0,00 %	18.04.2036	116.977	0,00 %
BMW US Capital LLC	\$ 120.000	2,25 %	15.09.2023	116.604	0,00 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	€ 100.000	0,63 %	20.02.2030	116.239	0,00 %
E.ON International Finance BV	£ 50.000	6,75 %	27.01.2039	106.266	0,00 %
KFW	\$ 100.000	4,00 %	27.01.2020	103.886	0,00 %
Fresenius Medical Care US Finance II, Inc.	\$ 100.000	4,13 %	15.10.2020	103.000	0,00 %
KFW	£ 50.000	5,75 %	07.06.2032	102.801	0,00 %
KFW	\$ 100.000	2,75 %	01.10.2020	101.630	0,00 %
EnBW International Finance BV	€ 50.000	6,13 %	07.07.2039	100.239	0,00 %
Volkswagen Group of America Finance LLC	\$ 100.000	2,45 %	20.11.2019	99.901	0,00 %
Deutsche Bank AG	\$ 100.000	2,50 %	13.02.2019	99.897	0,00 %
KFW	\$ 100.000	1,63 %	15.08.2019	99.381	0,00 %
BMW US Capital LLC	\$ 100.000	1,50 %	11.04.2019	99.271	0,00 %
BMW US Capital LLC	\$ 100.000	1,45 %	13.09.2019	98.770	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Landwirtschaftliche Rentenbank	\$ 100.000	1,38 %	23.10.2019	98.768	0,00 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 100.000	2,20 %	30.10.2021	98.328	0,00 %
BMW US Capital LLC	\$ 100.000	1,85 %	15.09.2021	97.422	0,00 %
innogy Finance BV	£ 50.000	6,25 %	03.06.2030	92.573	0,00 %
innogy Finance BV	€ 50.000	5,75 %	14.02.2033	90.842	0,00 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 50.000	4,88 %	22.04.2025	77.488	0,00 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 50.000	4,38 %	29.04.2022	71.467	0,00 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	€ 50.000	2,88 %	10.03.2028	70.957	0,00 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 50.000	4,25 %	13.07.2022	70.636	0,00 %
German Postal Pensions Securitisation 2 plc	€ 50.000	4,38 %	18.01.2022	70.211	0,00 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	€ 50.000	3,38 %	04.11.2022	69.361	0,00 %
Deutsche Post AG	€ 50.000	2,88 %	11.12.2024	68.976	0,00 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 50.000	2,75 %	24.10.2024	68.162	0,00 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	€ 50.000	3,75 %	01.06.2021	67.869	0,00 %
Land Sachsen-Anhalt	€ 50.000	3,75 %	06.04.2021	67.811	0,00 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	€ 50.000	2,50 %	12.09.2023	67.266	0,00 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 50.000	2,00 %	15.10.2025	67.089	0,00 %
Land Hessen	€ 50.000	3,00 %	23.08.2021	66.949	0,00 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	€ 50.000	2,88 %	30.08.2021	66.914	0,00 %
Land Niedersachsen	€ 50.000	2,13 %	16.01.2024	66.875	0,00 %
Land Niedersachsen	€ 50.000	2,75 %	13.09.2021	66.446	0,00 %
Daimler AG	€ 50.000	2,38 %	08.03.2023	66.271	0,00 %
BMW Finance NV	€ 50.000	2,38 %	24.01.2023	66.094	0,00 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 50.000	1,88 %	15.03.2024	66.027	0,00 %
Free & Hanseatic City of Hamburg	€ 50.000	1,88 %	27.02.2024	65.984	0,00 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 50.000	4,25 %	16.03.2020	65.703	0,00 %
Bayerische Landesbank	€ 50.000	1,75 %	08.04.2024	65.484	0,00 %
Bayerische Landesbank	€ 50.000	2,00 %	11.07.2022	65.307	0,00 %
Free & Hanseatic City of Hamburg	€ 50.000	1,88 %	26.09.2022	65.253	0,00 %
Land Berlin	€ 50.000	1,63 %	03.06.2024	65.181	0,00 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	€ 50.000	1,75 %	31.01.2023	65.092	0,00 %
Land Hessen	€ 50.000	1,75 %	20.01.2023	65.089	0,00 %
Land Sachsen-Anhalt	€ 50.000	1,63 %	25.04.2023	64.819	0,00 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	€ 50.000	1,75 %	13.06.2022	64.790	0,00 %
Muenchener Hypothekenbank eG	€ 50.000	1,75 %	03.06.2022	64.565	0,00 %
Vonovia Finance BV	€ 50.000	2,13 %	09.07.2022	64.227	0,00 %
Berlin Hyp AG	€ 50.000	4,50 %	03.05.2019	63.936	0,00 %
BASF SE	€ 50.000	1,88 %	04.02.2021	63.531	0,00 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	€ 50.000	1,75 %	12.03.2021	63.355	0,00 %
Bundesland Berlin Deutschland	€ 50.000	1,50 %	28.08.2020	62.942	0,00 %
Land Baden-Wuerttemberg	€ 50.000	4,00 %	22.01.2019	62.906	0,00 %
Wurth Finance International BV	€ 50.000	1,75 %	21.05.2020	62.611	0,00 %
Land Brandenburg	€ 50.000	1,50 %	12.02.2020	62.433	0,00 %
Volkswagen International Finance NV	€ 50.000	2,00 %	14.01.2020	62.356	0,00 %
Bayerische Landesbank	€ 50.000	1,00 %	09.07.2021	62.348	0,00 %
innogy Finance BV	€ 50.000	1,88 %	30.01.2020	62.331	0,00 %
Land Hessen	€ 50.000	1,38 %	05.02.2020	62.288	0,00 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	€ 50.000	1,50 %	10.03.2020	62.138	0,00 %
Land Rheinland-Pfalz	€ 50.000	1,25 %	16.01.2020	62.082	0,00 %
Land Niedersachsen	€ 50.000	1,25 %	10.01.2020	62.071	0,00 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	€ 50.000	1,38 %	11.10.2019	61.989	0,00 %
Land Niedersachsen	€ 50.000	1,38 %	26.09.2019	61.941	0,00 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 50.000	1,25 %	15.01.2019	61.133	0,00 %
Muenchener Hypothekenbank eG	€ 50.000	0,38 %	10.11.2021	61.012	0,00 %
Deutsche Hypothekenbank AG	€ 50.000	0,63 %	29.07.2019	60.966	0,00 %
Berlin Hyp AG	€ 50.000	0,63 %	24.06.2019	60.937	0,00 %
KFW	€ 50.000	0,38 %	22.07.2019	60.921	0,00 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 50.000	3,30 %	19.05.2025	50.705	0,00 %
BMW US Capital LLC	\$ 50.000	3,30 %	06.04.2027	50.419	0,00 %
BMW US Capital LLC	\$ 50.000	2,70 %	06.04.2022	50.029	0,00 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	\$ 50.000	1,75 %	15.04.2019	49.884	0,00 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	\$ 50.000	1,88 %	17.04.2023	48.633	0,00 %
Volkswagen International Finance NV	\$ 25.000	4,00 %	12.08.2020	25.848	0,00 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 10.000	2,00 %	15.08.2023	13.419	0,00 %
Aareal Bank AG^	€ 10.000	4,25 %	18.03.2026	13.218	0,00 %
				578.462.607	6,08 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Guernsey 0,00 % (2016: 0,00 %)					
States of Guernsey Bond	£ 100.000	3,38 %	12.12.2046	155.269	0,00 %
				155.269	0,00 %
Hongkong 0,09 % (2016: 0,10 %)					
AIA Group Ltd.	\$ 1.800.000	3,20 %	11.03.2025	1.790.282	0,02 %
CK Hutchison International 17 II Ltd.	\$ 1.100.000	2,25 %	29.09.2020	1.086.452	0,01 %
CK Hutchison International 17 II Ltd.	\$ 700.000	2,75 %	29.03.2023	686.069	0,01 %
CK Hutchison Finance 16 II Ltd.	€ 500.000	0,88 %	03.10.2024	594.027	0,01 %
Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd.	€ 500.000	1,00 %	12.12.2024	593.651	0,01 %
CK Hutchison International 16 Ltd.	\$ 400.000	1,88 %	03.10.2021	386.705	0,01 %
Hutchison Whampoa Finance UK plc	£ 200.000	5,63 %	24.11.2026	347.552	0,01 %
CK Hutchison International 17 Ltd.	\$ 300.000	3,50 %	05.04.2027	299.884	0,01 %
CK Hutchison International 17 Ltd.	\$ 300.000	2,88 %	05.04.2022	299.043	0,00 %
CK Hutchison International 16 Ltd.	\$ 300.000	2,75 %	03.10.2026	285.242	0,00 %
CK Hutchison Finance 16 Ltd.	€ 200.000	2,00 %	06.04.2028	249.454	0,00 %
AIA Group Ltd.	\$ 200.000	4,88 %	11.03.2044	232.394	0,00 %
Hutchison Whampoa International 11 Ltd.	\$ 200.000	4,63 %	13.01.2022	212.598	0,00 %
CLP Power Hong Kong Financing Ltd.	\$ 200.000	4,75 %	19.03.2020	208.248	0,00 %
HPHT Finance 15 Ltd.	\$ 200.000	2,88 %	17.03.2020	200.021	0,00 %
CK Hutchison International 17 II Ltd.	\$ 200.000	3,25 %	29.09.2027	195.340	0,00 %
Hutchison Whampoa International 09 Ltd.	\$ 125.000	7,63 %	09.04.2019	132.961	0,00 %
Hutchison Whampoa Finance 14 Ltd.	€ 100.000	1,38 %	31.10.2021	124.354	0,00 %
CK Hutchison Finance 16 Ltd.	€ 100.000	1,25 %	06.04.2023	122.827	0,00 %
Hutchison Whampoa International 09 Ltd.	\$ 100.000	7,63 %	09.04.2019	106.378	0,00 %
				8.153.482	0,09 %
Ungarn 0,20 % (2016: 0,04 %)					
Hungary Government Bond	HUF 999.900.000	3,00 %	27.10.2027	4.218.027	0,05 %
Hungary Government International Bond	\$ 3.300.000	6,38 %	29.03.2021	3.667.125	0,04 %
Hungary Government International Bond	€ 2.500.000	6,00 %	11.01.2019	3.190.994	0,03 %
Hungary Government Bond	HUF 582.570.000	5,50 %	24.06.2025	2.847.542	0,03 %
Hungary Government International Bond	€ 1.500.000	1,75 %	10.10.2027	1.864.242	0,02 %
Hungary Government Bond	HUF 200.000.000	7,00 %	24.06.2022	976.573	0,01 %
Hungary Government International Bond	\$ 600.000	6,25 %	29.01.2020	642.768	0,01 %
Hungary Government Bond	HUF 90.000.000	6,00 %	24.11.2023	440.991	0,01 %
Hungary Government Bond	HUF 100.000.000	1,75 %	26.10.2022	398.333	0,00 %
Hungary Government Bond	HUF 90.000.000	2,50 %	27.10.2021	368.953	0,00 %
Hungary Government International Bond	\$ 50.000	7,63 %	29.03.2041	78.458	0,00 %
				18.694.006	0,20 %
Indien 0,06 % (2016: 0,06 %)					
ICICI Bank Ltd.	\$ 1.700.000	3,80 %	14.12.2027	1.679.926	0,02 %
Reliance Industries Ltd.	\$ 550.000	4,88 %	10.02.2045	608.481	0,01 %
NTPC Ltd.	\$ 500.000	4,38 %	26.11.2024	527.465	0,01 %
ONGC Videsh Ltd.	\$ 500.000	3,25 %	15.07.2019	503.160	0,01 %
Axis Bank Ltd.	\$ 400.000	3,00 %	08.08.2022	395.170	0,01 %
Reliance Industries Ltd.	\$ 350.000	3,67 %	30.11.2027	345.766	0,00 %
State Bank of India	\$ 300.000	4,88 %	17.04.2024	325.169	0,00 %
ICICI Bank Ltd.	\$ 250.000	4,00 %	18.03.2026	252.704	0,00 %
Bank of India	\$ 200.000	6,25 %	16.02.2021	215.734	0,00 %
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	\$ 200.000	3,50 %	29.07.2020	201.988	0,00 %
ICICI Bank Ltd.	\$ 200.000	3,50 %	18.03.2020	201.756	0,00 %
Axis Bank Ltd.	\$ 200.000	3,25 %	21.05.2020	200.752	0,00 %
Export-Import Bank of India	\$ 200.000	3,38 %	05.08.2026	196.342	0,00 %
Bharti Airtel International Netherlands BV	\$ 100.000	5,35 %	20.05.2024	107.750	0,00 %
Adani Transmission Ltd.	\$ 100.000	4,00 %	03.08.2026	99.177	0,00 %
ICICI Bank Ltd.	\$ 25.000	5,75 %	16.11.2020	26.780	0,00 %
				5.888.120	0,06 %
Indonesien 0,21 % (2016: 0,19 %)					
Perusahaan Listrik Negara PT	\$ 1.925.000	4,13 %	15.05.2027	1.920.187	0,02 %
Indonesia Government International Bond	\$ 1.500.000	5,13 %	15.01.2045	1.651.875	0,02 %
Indonesia Government International Bond	€ 1.180.000	2,88 %	08.07.2021	1.540.700	0,02 %
Indonesia Government International Bond	\$ 1.175.000	5,88 %	15.01.2024	1.338.031	0,01 %
Indonesia Government International Bond	\$ 1.150.000	3,75 %	25.04.2022	1.183.063	0,01 %
Indonesia Government International Bond	\$ 1.000.000	4,75 %	08.01.2026	1.085.000	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Indonesia Government International Bond	\$ 1.000.000	3,70 %	08.01.2022	1.027.500	0,01 %
Indonesia Government International Bond	\$ 700.000	5,95 %	08.01.2046	861.875	0,01 %
Indonesia Government International Bond	\$ 800.000	4,75 %	18.07.2047	853.782	0,01 %
Pertamina Persero PT	\$ 700.000	5,63 %	20.05.2043	762.154	0,01 %
Indonesia Government International Bond	\$ 700.000	4,13 %	15.01.2025	726.250	0,01 %
Indonesia Government International Bond	\$ 500.000	11,63 %	04.03.2019	553.750	0,01 %
Indonesia Government International Bond	\$ 500.000	5,88 %	13.03.2020	536.880	0,01 %
Pertamina Persero PT	\$ 500.000	5,25 %	23.05.2021	535.625	0,01 %
Indonesia Government International Bond	\$ 500.000	3,85 %	18.07.2027	513.495	0,01 %
Indonesia Government International Bond	\$ 350.000	6,75 %	15.01.2044	465.062	0,01 %
Indonesia Government International Bond	\$ 400.000	4,75 %	08.01.2026	434.000	0,01 %
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	\$ 400.000	4,35 %	10.09.2024	420.228	0,01 %
Pelabuhan Indonesia II PT	\$ 400.000	4,25 %	05.05.2025	409.000	0,00 %
Indonesia Government International Bond	\$ 325.000	5,88 %	13.03.2020	348.991	0,00 %
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	\$ 300.000	4,55 %	29.03.2026	317.250	0,00 %
Indonesia Government International Bond	\$ 200.000	6,63 %	17.02.2037	255.750	0,00 %
Pertamina Persero PT	\$ 200.000	6,00 %	03.05.2042	227.228	0,00 %
Indonesia Government International Bond	\$ 200.000	5,25 %	17.01.2042	224.000	0,00 %
Indonesia Government International Bond	\$ 200.000	5,13 %	15.01.2045	220.250	0,00 %
Indonesia Government International Bond	\$ 200.000	4,88 %	05.05.2021	213.250	0,00 %
Pertamina Persero PT	\$ 200.000	4,88 %	03.05.2022	212.522	0,00 %
Pelabuhan Indonesia III Persero PT	\$ 200.000	4,88 %	01.10.2024	212.500	0,00 %
Perusahaan Listrik Negara PT	\$ 200.000	5,25 %	24.10.2042	207.541	0,00 %
Indonesia Government International Bond	\$ 125.000	8,50 %	12.10.2035	186.875	0,00 %
Indonesia Government International Bond	\$ 125.000	7,75 %	17.01.2038	178.438	0,00 %
				19.623.052	0,21 %
Irland 0,33 % (2016: 0,38 %)					
Ireland Government Bond	€ 5.420.000	1,00 %	15.05.2026	6.675.340	0,07 %
Ireland Government Bond	€ 2.190.000	2,40 %	15.05.2030	3.025.635	0,03 %
Ireland Government Bond	€ 2.365.000	1,70 %	15.05.2037	2.929.366	0,03 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	\$ 2.000.000	3,50 %	26.05.2022	2.025.000	0,02 %
SMBC Aviation Capital Finance DAC	\$ 2.000.000	2,65 %	15.07.2021	1.965.174	0,02 %
Ireland Government Bond	€ 1.500.000	0,00 %	18.10.2022	1.797.524	0,02 %
Ireland Government Bond	€ 1.200.000	3,40 %	18.03.2024	1.719.123	0,02 %
Ireland Government Bond	€ 1.200.000	5,90 %	18.10.2019	1.605.852	0,02 %
Ireland Government Bond	€ 1.150.000	4,50 %	18.04.2020	1.540.267	0,02 %
Ireland Government Bond	€ 750.000	5,40 %	13.03.2025	1.216.496	0,01 %
Ireland Government Bond	€ 500.000	2,00 %	18.02.2045	629.228	0,01 %
Roadster Finance Designated Activity Co.	€ 500.000	2,38 %	08.12.2027	595.455	0,01 %
CRH Finance Switzerland AG	CHF 500.000	1,38 %	30.09.2022	536.172	0,01 %
CRH America Finance, Inc.	\$ 425.000	4,40 %	09.05.2047	447.136	0,01 %
SMBC Aviation Capital Finance DAC	\$ 400.000	3,00 %	15.07.2022	396.796	0,01 %
ESB Finance DAC	€ 300.000	2,13 %	08.06.2027	389.410	0,01 %
Ireland Government Bond	€ 250.000	5,00 %	18.10.2020	346.180	0,01 %
Ireland Government Bond	€ 250.000	4,40 %	18.06.2019	321.768	0,00 %
AIB Mortgage Bank	€ 200.000	0,88 %	04.02.2023	248.195	0,00 %
Bank of Ireland Mortgage Bank	€ 200.000	0,63 %	19.02.2021	245.423	0,00 %
Johnson Controls International plc	€ 200.000	1,38 %	25.02.2025	244.863	0,00 %
Bank of Ireland Mortgage Bank	€ 200.000	0,50 %	20.01.2020	243.881	0,00 %
Bank of Ireland Mortgage Bank	€ 200.000	0,38 %	07.05.2022	242.850	0,00 %
CRH Finance DAC	€ 200.000	1,38 %	18.10.2028	235.798	0,00 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	\$ 150.000	5,00 %	01.10.2021	159.937	0,00 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	\$ 150.000	4,63 %	01.07.2022	159.000	0,00 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	\$ 150.000	4,50 %	15.05.2021	157.500	0,00 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	\$ 150.000	4,63 %	30.10.2020	157.313	0,00 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	\$ 150.000	3,65 %	21.07.2027	148.500	0,00 %
ESB Finance DAC	€ 100.000	3,49 %	12.01.2024	139.408	0,00 %
AIB Mortgage Bank	€ 100.000	2,25 %	26.03.2021	129.077	0,00 %
Bank of Ireland Mortgage Bank	€ 100.000	1,75 %	19.03.2019	123.118	0,00 %
AIB Mortgage Bank	€ 100.000	0,63 %	27.07.2020	122.591	0,00 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	\$ 120.000	3,75 %	15.05.2019	121.950	0,00 %
Ryanair DAC	€ 100.000	1,13 %	10.03.2023	121.801	0,00 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	\$ 100.000	3,95 %	01.02.2022	103.125	0,00 %
CRH America Finance, Inc.	\$ 100.000	3,40 %	09.05.2027	99.328	0,00 %
				31.365.580	0,33 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Israel 0,24 % (2016: 0,27 %)					
Israel Government Bond-Fixed	ILS 12.000.000	2,00 %	31.03.2027	3.613.498	0,04 %
Israel Government Bond-Fixed	ILS 10.500.000	1,75 %	31.08.2025	3.123.702	0,03 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	\$ 3.175.000	2,80 %	21.07.2023	2.760.717	0,03 %
Israel Government International Bond	€ 1.710.000	1,50 %	18.01.2027	2.114.969	0,02 %
Israel Government Bond-Fixed	ILS 5.000.000	4,25 %	31.03.2023	1.741.823	0,02 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	€ 1.000.000	0,38 %	25.07.2020	1.140.731	0,01 %
Israel Government Bond-Fixed	ILS 3.000.000	6,00 %	28.02.2019	966.370	0,01 %
Israel Government International Bond	\$ 700.000	5,13 %	26.03.2019	724.847	0,01 %
Israel Government Bond-Fixed	ILS 2.000.000	5,50 %	31.01.2022	720.580	0,01 %
Israel Government Bond-Fixed	ILS 2.200.000	2,25 %	31.05.2019	661.080	0,01 %
Israel Government Bond-Fixed	ILS 2.000.000	5,00 %	31.01.2020	659.974	0,01 %
Israel Government Bond-Fixed	ILS 1.500.000	6,25 %	30.10.2026	606.585	0,01 %
Israel Government Bond-Fixed	ILS 1.300.000	5,50 %	31.01.2042	575.211	0,01 %
Israel Government International Bond	\$ 500.000	4,50 %	30.01.2043	547.389	0,01 %
Israel Electric Corp., Ltd.	\$ 500.000	5,00 %	12.11.2024	532.720	0,01 %
Israel Government International Bond	\$ 400.000	3,15 %	30.06.2023	409.745	0,00 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	\$ 375.000	3,15 %	01.10.2026	308.374	0,00 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	\$ 325.000	2,20 %	21.07.2021	297.767	0,00 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	\$ 250.000	1,70 %	19.07.2019	242.621	0,00 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	€ 200.000	1,25 %	31.03.2023	218.633	0,00 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	€ 200.000	1,88 %	31.03.2027	207.484	0,00 %
Israel Government International Bond	€ 150.000	2,88 %	29.01.2024	204.436	0,00 %
Israel Government International Bond	\$ 200.000	2,88 %	16.03.2026	199.568	0,00 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	€ 167.000	1,63 %	15.10.2028	165.737	0,00 %
Teva Pharmaceutical Finance Co. BV	\$ 186.000	2,95 %	18.12.2022	165.696	0,00 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	\$ 175.000	4,10 %	01.10.2046	134.538	0,00 %
Teva Pharmaceutical Finance IV BV	€ 100.000	2,88 %	15.04.2019	121.581	0,00 %
Teva Pharmaceutical Finance Co. LLC	\$ 113.000	6,15 %	01.02.2036	113.690	0,00 %
				23.280.066	0,24 %
Italien 4,47 % (2016: 4,19 %)					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 28.970.000	2,05 %	01.08.2027	34.982.297	0,37 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 20.000.000	0,10 %	15.04.2019	24.125.681	0,25 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 17.000.000	0,70 %	01.05.2020	20.732.828	0,22 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 14.300.000	0,65 %	15.10.2023	16.756.063	0,18 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 11.200.000	2,15 %	15.12.2021	14.315.221	0,15 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 9.850.000	4,75 %	01.09.2021	13.703.782	0,14 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 10.500.000	2,20 %	01.06.2027	12.880.867	0,14 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 8.650.000	4,50 %	01.03.2026	12.614.083	0,13 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 10.000.000	0,35 %	01.11.2021	11.977.764	0,13 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 9.700.000	1,05 %	01.12.2019	11.897.488	0,13 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 10.000.000	2,45 %	01.09.2033	11.773.484	0,12 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 8.300.000	3,50 %	01.03.2030	11.187.942	0,12 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 9.000.000	1,85 %	15.05.2024	11.181.691	0,12 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 7.000.000	2,50 %	01.12.2024	9.009.139	0,10 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 7.500.000	1,50 %	01.06.2025	8.973.200	0,10 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 7.000.000	1,35 %	15.04.2022	8.658.945	0,09 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 5.500.000	5,00 %	01.09.2040	8.632.743	0,09 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 6.250.000	4,50 %	01.03.2019	7.919.358	0,08 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 5.029.000	4,00 %	01.02.2037	7.088.660	0,08 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 4.700.000	5,50 %	01.09.2022	6.882.667	0,07 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 4.050.000	5,75 %	01.02.2033	6.781.302	0,07 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 5.000.000	1,60 %	01.06.2026	5.923.186	0,06 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 4.100.000	3,75 %	01.09.2024	5.674.080	0,06 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 3.300.000	4,75 %	01.09.2044	5.078.044	0,05 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 3.500.000	2,00 %	01.12.2025	4.306.004	0,05 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.850.000	4,75 %	01.09.2028	4.276.269	0,05 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 3.500.000	0,95 %	15.03.2023	4.209.524	0,05 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.600.000	5,00 %	01.08.2034	4.097.293	0,04 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 3.400.000	1,45 %	15.11.2024	4.095.932	0,04 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 3.300.000	3,25 %	01.09.2046	4.035.196	0,04 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.550.000	5,25 %	01.11.2029	4.013.189	0,04 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.300.000	5,00 %	01.08.2039	3.622.487	0,04 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.900.000	2,50 %	01.05.2019	3.609.721	0,04 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 3.410.000	2,80 %	01.03.2067	3.541.710	0,04 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.800.000	1,20 %	01.04.2022	3.443.122	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.250.000	5,00 %	01.03.2022	3.193.879	0,03 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.350.000	3,75 %	01.08.2021	3.160.336	0,03 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.500.000	1,50 %	01.08.2019	3.081.949	0,03 %
Mediobanca SpA	€ 2.500.000	0,75 %	17.02.2020	3.040.008	0,03 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.000.000	3,75 %	01.05.2021	2.673.591	0,03 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.750.000	5,00 %	01.03.2025	2.605.948	0,03 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.700.000	5,50 %	01.11.2022	2.497.616	0,03 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.850.000	3,75 %	01.03.2021	2.464.941	0,03 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.700.000	4,75 %	01.08.2023	2.458.410	0,03 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.850.000	4,00 %	01.09.2020	2.451.634	0,03 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.935.000	3,45 %	01.03.2048	2.410.520	0,03 %
Mediobanca SpA	€ 2.000.000	1,25 %	24.11.2029	2.386.263	0,03 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.650.000	4,50 %	01.03.2024	2.363.853	0,03 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.800.000	4,25 %	01.09.2019	2.320.323	0,03 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.750.000	4,50 %	01.02.2020	2.299.562	0,02 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.500.000	4,50 %	01.05.2023	2.131.518	0,02 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.500.000	4,25 %	01.02.2019	1.889.070	0,02 %
Iren SpA	€ 1.500.000	0,88 %	04.11.2024	1.773.044	0,02 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.000.000	6,00 %	01.05.2031	1.693.700	0,02 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.000.000	1,45 %	15.09.2022	1.239.125	0,01 %
Banco di Desio e della Brianza SpA	€ 1.000.000	0,88 %	12.09.2024	1.225.849	0,01 %
Aeroporti di Roma SpA	€ 1.000.000	1,63 %	08.06.2027	1.225.299	0,01 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 1.000.000	0,88 %	27.06.2022	1.214.613	0,01 %
Credit Agricole Cariparma SpA	€ 1.000.000	0,63 %	13.01.2026	1.175.843	0,01 %
UniCredit SpA	€ 800.000	5,00 %	31.10.2021	1.141.113	0,01 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.000.000	2,25 %	01.09.2036	1.109.546	0,01 %
Republic of Italy Government International Bond	£ 600.000	6,00 %	04.08.2028	1.013.637	0,01 %
Assicurazioni Generali SpA	€ 650.000	5,13 %	16.09.2024	998.729	0,01 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 750.000	4,25 %	01.03.2020	984.066	0,01 %
FCA Bank SpA	€ 800.000	0,25 %	12.10.2020	960.774	0,01 %
Ferrovie dello Stato Italiane SpA	€ 800.000	0,88 %	07.12.2023	955.681	0,01 %
FCA Bank SpA	£ 700.000	1,63 %	29.09.2021	945.550	0,01 %
Enel SpA	€ 550.000	5,63 %	21.06.2027	911.756	0,01 %
Enel Finance International NV	\$ 875.000	3,63 %	25.05.2027	867.446	0,01 %
UniCredit SpA	€ 750.000	0,38 %	31.10.2026	859.208	0,01 %
Atlantia SpA	€ 700.000	1,88 %	13.07.2027	856.703	0,01 %
Enel Finance International NV	\$ 800.000	2,88 %	25.05.2022	795.093	0,01 %
Hera SpA	€ 600.000	2,38 %	04.07.2024	792.658	0,01 %
Enel Finance International NV	\$ 675.000	4,75 %	25.05.2047	732.061	0,01 %
Enel Finance International NV	€ 566.000	1,97 %	27.01.2025	729.306	0,01 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 550.000	4,13 %	14.04.2020	720.244	0,01 %
Enel Finance International NV	€ 545.000	1,38 %	01.06.2026	667.868	0,01 %
Mediobanca SpA	€ 500.000	1,38 %	10.11.2025	622.025	0,01 %
Unione di Banche Italiane SpA	€ 500.000	2,88 %	18.02.2019	619.398	0,01 %
Unione di Banche Italiane SpA	€ 500.000	1,00 %	27.01.2023	618.186	0,01 %
Snam SpA	€ 500.000	1,25 %	25.01.2025	613.342	0,01 %
FCA Bank SpA	€ 500.000	1,00 %	15.11.2021	613.087	0,01 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 500.000	0,63 %	23.03.2023	610.142	0,01 %
Snam SpA	€ 500.000	0,00 %	25.10.2020	599.182	0,01 %
Republic of Italy Government International Bond	\$ 500.000	5,38 %	15.06.2033	587.920	0,01 %
Enel SpA	£ 400.000	6,25 %	20.06.2019	581.223	0,01 %
Enel SpA	£ 300.000	5,75 %	22.06.2037	556.984	0,01 %
Luxottica Group SpA	€ 400.000	2,63 %	10.02.2024	537.830	0,01 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 300.000	7,25 %	01.11.2026	520.916	0,01 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 300.000	9,00 %	01.11.2023	520.763	0,01 %
ENI SpA	€ 400.000	1,63 %	17.05.2028	485.519	0,01 %
Banca Popolare di Sondrio SCPA	€ 400.000	0,75 %	04.04.2023	483.115	0,01 %
Esselunga SpA	€ 400.000	0,88 %	25.10.2023	481.002	0,01 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 450.000	3,88 %	15.01.2019	456.810	0,01 %
ENI SpA	\$ 400.000	5,70 %	01.10.2040	434.676	0,01 %
2i Rete Gas SpA	€ 300.000	3,00 %	16.07.2024	409.939	0,01 %
ENI SpA	€ 304.000	4,25 %	03.02.2020	397.052	0,01 %
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	€ 300.000	2,13 %	26.11.2025	385.548	0,00 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 300.000	3,75 %	25.09.2019	384.969	0,00 %
FCA Bank SpA	€ 300.000	1,38 %	17.04.2020	370.309	0,00 %
Atlantia SpA	€ 300.000	1,63 %	03.02.2025	368.913	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Intesa Sanpaolo SpA	€ 300.000	1,13 %	04.03.2022	368.052	0,00 %
BPER Banca	€ 300.000	0,88 %	22.01.2022	367.883	0,00 %
Italgas SpA	€ 300.000	1,13 %	14.03.2024	366.915	0,00 %
Esselunga SpA	€ 300.000	1,88 %	25.10.2027	366.706	0,00 %
UniCredit SpA	€ 300.000	0,75 %	30.04.2025	362.011	0,00 %
Mediobanca SpA	€ 300.000	0,63 %	27.09.2022	357.002	0,00 %
Enel Finance International NV	\$ 250.000	6,00 %	07.10.2039	309.504	0,00 %
Enel Finance International NV	£ 150.000	5,75 %	14.09.2040	283.158	0,00 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 200.000	3,63 %	05.12.2022	279.785	0,00 %
UniCredit SpA	€ 200.000	2,63 %	31.10.2020	258.302	0,00 %
EXOR NV	€ 200.000	2,13 %	02.12.2022	256.069	0,00 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 200.000	1,38 %	18.12.2025	252.196	0,00 %
Autostrade per l'Italia SpA	€ 200.000	1,75 %	01.02.2027	248.624	0,00 %
Banca Popolare di Milano Scarl	€ 200.000	1,50 %	02.12.2025	248.283	0,00 %
Autostrade per l'Italia SpA	€ 200.000	1,13 %	04.11.2021	248.188	0,00 %
Enel Finance International NV	\$ 200.000	6,00 %	07.10.2039	247.302	0,00 %
Enel Finance International NV	\$ 250.000	2,75 %	06.04.2023	246.319	0,00 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 200.000	1,13 %	14.01.2020	245.154	0,00 %
Autostrade per l'Italia SpA	€ 200.000	1,88 %	26.09.2029	245.129	0,00 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 200.000	0,63 %	20.01.2022	244.987	0,00 %
Enel Finance International NV	\$ 250.000	3,50 %	06.04.2028	244.615	0,00 %
BPER Banca	€ 200.000	0,50 %	22.07.2020	243.269	0,00 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 200.000	0,90 %	01.08.2022	241.954	0,00 %
Intesa Sanpaolo SpA	\$ 200.000	3,88 %	14.07.2027	199.849	0,00 %
Intesa Sanpaolo SpA	\$ 200.000	3,13 %	14.07.2022	198.581	0,00 %
Enel Finance International NV	£ 100.000	5,63 %	14.08.2024	164.726	0,00 %
UniCredit SpA	€ 100.000	5,25 %	30.04.2023	151.172	0,00 %
Assicurazioni Generali SpA^	€ 100.000	5,50 %	27.10.2047	143.978	0,00 %
ENI SpA	€ 100.000	3,75 %	12.09.2025	143.890	0,00 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 100.000	3,25 %	10.02.2026	143.468	0,00 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 100.000	4,00 %	30.10.2023	141.633	0,00 %
Assicurazioni Generali SpA	€ 100.000	4,13 %	04.05.2026	139.560	0,00 %
Unione di Banche Italiane SpA	€ 100.000	3,13 %	05.02.2024	139.240	0,00 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	€ 100.000	4,75 %	15.03.2021	137.686	0,00 %
ENI SpA	€ 100.000	3,25 %	10.07.2023	137.490	0,00 %
Enel Finance International NV	€ 100.000	4,88 %	11.03.2020	132.849	0,00 %
ACEA SpA	€ 100.000	2,63 %	15.07.2024	132.306	0,00 %
Aeroporti di Roma SpA	€ 100.000	3,25 %	20.02.2021	131.532	0,00 %
ENI SpA	€ 100.000	2,63 %	22.11.2021	131.229	0,00 %
Unione di Banche Italiane SpA	€ 100.000	3,13 %	14.10.2020	130.692	0,00 %
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	€ 100.000	2,88 %	16.04.2021	130.124	0,00 %
Eni SpA	\$ 125.000	4,15 %	01.10.2020	129.394	0,00 %
Cassa Depositi e Prestiti SpA	€ 100.000	2,75 %	31.05.2021	129.373	0,00 %
UniCredit SpA	€ 100.000	2,75 %	31.01.2020	127.412	0,00 %
ENI SpA	€ 100.000	1,75 %	18.01.2024	127.272	0,00 %
Assicurazioni Generali SpA	€ 100.000	2,88 %	14.01.2020	127.015	0,00 %
Servizi Assicurativi del Commercio Estero SpA^	€ 100.000	3,88 %	10.02.2166	126.965	0,00 %
Autostrade per l'Italia SpA	€ 100.000	1,88 %	04.11.2025	126.580	0,00 %
Luxottica Group SpA	€ 100.000	3,63 %	19.03.2019	125.385	0,00 %
Autostrade per l'Italia SpA	€ 100.000	1,75 %	26.06.2026	124.292	0,00 %
FCA Bank SpA	€ 100.000	2,63 %	17.04.2019	124.128	0,00 %
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	€ 100.000	1,25 %	20.01.2022	123.722	0,00 %
Cassa Depositi e Prestiti SpA	€ 100.000	2,38 %	12.02.2019	123.449	0,00 %
Credit Agricole Cariparma SpA	€ 100.000	0,88 %	31.01.2022	123.079	0,00 %
Credito Emiliano SpA	€ 100.000	1,88 %	27.02.2019	123.058	0,00 %
ENI SpA	€ 100.000	1,50 %	02.02.2026	123.022	0,00 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	€ 100.000	0,88 %	02.02.2022	122.907	0,00 %
UniCredit SpA	€ 100.000	1,88 %	31.01.2019	122.842	0,00 %
Credit Agricole Cariparma SpA	€ 100.000	0,88 %	16.06.2023	122.736	0,00 %
Intesa Sanpaolo SpA	\$ 100.000	5,25 %	12.01.2024	109.066	0,00 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 75.000	2,70 %	01.03.2047	82.046	0,00 %
Autostrade per l'Italia SpA	€ 50.000	4,38 %	16.09.2025	74.623	0,00 %
ENI SpA	€ 50.000	4,00 %	29.06.2020	65.896	0,00 %
ENI SpA	€ 50.000	4,13 %	16.09.2019	64.312	0,00 %
Intesa Sanpaolo SpA	\$ 25.000	6,50 %	24.02.2021	27.537	0,00 %
				425.115.668	4,47 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Japan 11,35 % (2016: 12,88 %)					
Japanische Staatsanleihe	¥ 3.000.000.000	0,10 %	15.05.2019	26.717.976	0,28 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 2.900.000.000	0,10 %	20.09.2022	25.993.422	0,27 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 2.900.000.000	0,10 %	20.09.2021	25.942.965	0,27 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 2.000.000.000	0,10 %	20.09.2026	17.892.765	0,19 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.900.000.000	0,10 %	20.06.2022	17.020.728	0,18 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.850.000.000	0,10 %	20.03.2022	16.566.081	0,17 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.800.000.000	0,10 %	20.12.2020	16.082.557	0,17 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.810.000.000	0,50 %	20.09.2036	16.050.595	0,17 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.600.000.000	0,10 %	20.06.2021	14.307.253	0,15 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.500.000.000	0,10 %	20.09.2027	13.392.410	0,14 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.177.750.000	1,80 %	20.09.2031	12.646.829	0,13 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.405.000.000	0,10 %	20.09.2020	12.545.471	0,13 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.300.000.000	0,10 %	20.06.2026	11.635.606	0,12 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.060.300.000	1,70 %	20.09.2032	11.315.138	0,12 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.255.000.000	0,10 %	20.03.2020	11.195.625	0,12 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 990.000.000	1,70 %	20.03.2032	10.539.435	0,11 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 905.000.000	1,90 %	20.09.2042	10.197.699	0,11 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 876.100.000	2,00 %	20.09.2041	10.018.415	0,11 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.060.000.000	0,80 %	20.06.2023	9.869.715	0,10 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 920.000.000	1,50 %	20.06.2034	9.616.430	0,10 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.000.000.000	0,60 %	20.12.2023	9.232.934	0,10 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.000.000.000	0,30 %	20.12.2024	9.095.517	0,10 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 974.500.000	0,80 %	20.06.2022	9.000.695	0,10 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 950.000.000	0,80 %	20.09.2023	8.858.318	0,09 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 970.000.000	0,10 %	20.03.2027	8.670.672	0,09 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 754.550.000	2,00 %	20.03.2042	8.649.092	0,09 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 935.000.000	0,70 %	20.03.2037	8.545.809	0,09 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 780.000.000	1,70 %	20.09.2033	8.359.675	0,09 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 920.000.000	0,60 %	20.09.2037	8.223.240	0,09 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 920.000.000	0,20 %	20.06.2019	8.206.171	0,09 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 800.000.000	1,20 %	20.12.2034	8.020.453	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 663.700.000	2,20 %	20.03.2041	7.829.421	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 865.250.000	1,30 %	20.03.2019	7.813.672	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 850.000.000	0,60 %	20.12.2036	7.652.188	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 800.000.000	0,50 %	20.09.2024	7.368.238	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 800.000.000	0,20 %	20.09.2019	7.141.482	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 800.000.000	0,10 %	20.06.2020	7.139.991	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 680.000.000	1,50 %	20.03.2034	7.105.381	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 774.800.000	0,10 %	15.06.2019	6.902.082	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 594.850.000	2,00 %	20.09.2040	6.777.013	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 700.850.000	1,00 %	20.12.2021	6.493.672	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 700.000.000	0,60 %	20.06.2024	6.481.261	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 660.000.000	1,00 %	20.12.2035	6.394.237	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 588.200.000	1,80 %	20.12.2031	6.326.870	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 635.850.000	1,20 %	20.12.2020	5.865.512	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 650.000.000	0,10 %	20.12.2026	5.811.744	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 519.500.000	1,70 %	20.12.2031	5.524.824	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 650.000.000	0,60 %	20.12.2046	5.480.541	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 600.000.000	0,10 %	20.06.2027	5.361.278	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 525.000.000	1,30 %	20.06.2035	5.331.838	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 600.000.000	0,80 %	20.09.2047	5.313.289	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 500.000.000	1,60 %	20.12.2033	5.293.964	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 455.150.000	1,90 %	20.03.2053	5.258.245	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 550.000.000	1,10 %	20.06.2021	5.087.732	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 570.000.000	0,20 %	20.03.2019	5.079.856	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 471.650.000	2,10 %	20.12.2027	5.039.056	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 500.000.000	1,20 %	20.03.2035	5.009.277	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 413.000.000	2,50 %	20.09.2037	4.989.876	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 532.650.000	0,80 %	20.12.2022	4.939.058	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 520.600.000	0,80 %	20.09.2022	4.817.849	0,05 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 440.000.000	2,42 %	20.06.2028	4.771.057	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 464.000.000	2,00 %	20.09.2025	4.762.786	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 432.950.000	1,70 %	20.06.2033	4.636.850	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 438.550.000	1,60 %	20.06.2032	4.620.600	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 420.000.000	1,90 %	20.06.2031	4.553.076	0,05 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Japanische Staatsanleihe	¥ 400.000.000	2,20 %	20.03.2031	4.468.637	0,05 %
Mizuho Bank Ltd.	¥ 500.000.000	0,29 %	25.01.2019	4.450.453	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 416.900.000	1,90 %	20.12.2028	4.426.431	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 470.000.000	0,60 %	20.03.2024	4.346.280	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 553.000.000	0,30 %	20.06.2046	4.307.902	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 400.000.000	1,60 %	20.06.2045	4.288.753	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 490.000.000	0,40 %	20.03.2036	4.287.815	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 355.050.000	2,00 %	20.03.2052	4.188.834	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 386.500.000	1,90 %	20.03.2031	4.185.248	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 370.000.000	1,90 %	20.06.2043	4.184.005	0,04 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 450.000.000	0,89 %	25.05.2022	4.141.538	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 400.000.000	1,40 %	20.09.2034	4.125.060	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 400.000.000	2,00 %	20.12.2024	4.059.370	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 400.000.000	1,20 %	20.09.2035	3.997.443	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 368.650.000	2,10 %	20.09.2028	3.974.155	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 357.000.000	2,10 %	20.12.2030	3.939.233	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 364.000.000	1,90 %	20.03.2029	3.874.136	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 320.000.000	2,40 %	20.03.2037	3.804.435	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 445.000.000	0,20 %	20.06.2036	3.744.241	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 400.000.000	1,30 %	20.03.2021	3.711.993	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 305.500.000	2,50 %	20.03.2038	3.700.550	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 400.000.000	0,40 %	20.06.2025	3.665.726	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 400.000.000	0,10 %	20.12.2019	3.566.445	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 400.000.000	0,80 %	20.06.2047	3.546.489	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 405.000.000	0,90 %	20.03.2057	3.519.599	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 315.000.000	1,80 %	20.03.2043	3.497.968	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 377.050.000	0,60 %	20.03.2023	3.468.090	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 314.000.000	2,40 %	20.03.2028	3.447.366	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 310.000.000	1,70 %	20.03.2044	3.385.205	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 357.200.000	1,20 %	20.06.2021	3.315.158	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 278.000.000	2,30 %	20.03.2040	3.313.271	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 310.000.000	1,50 %	20.03.2045	3.254.959	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 295.000.000	1,70 %	20.06.2044	3.223.422	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 295.300.000	2,10 %	20.09.2029	3.217.499	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 352.000.000	1,50 %	20.06.2019	3.199.185	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 300.000.000	1,70 %	20.09.2031	3.185.992	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 258.450.000	2,20 %	20.03.2051	3.171.880	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 341.300.000	1,00 %	20.09.2021	3.155.078	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 345.850.000	1,40 %	20.09.2019	3.150.566	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 284.000.000	2,10 %	20.06.2029	3.087.444	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 260.000.000	2,40 %	20.03.2034	3.041.619	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 405.000.000	0,40 %	20.03.2056	2.965.146	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 275.000.000	1,80 %	20.06.2031	2.949.225	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 244.150.000	2,50 %	20.09.2035	2.921.066	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 268.000.000	2,00 %	20.06.2030	2.914.860	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 262.000.000	2,20 %	20.12.2029	2.889.745	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 270.000.000	1,60 %	20.06.2030	2.819.097	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 300.000.000	0,90 %	20.03.2022	2.776.112	0,03 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 300.000.000	0,83 %	31.01.2023	2.772.213	0,03 %
Tokyo Metropolitan Government	¥ 300.000.000	0,44 %	19.03.2025	2.725.957	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 248.750.000	2,30 %	20.06.2028	2.719.468	0,03 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 300.000.000	1,40 %	14.12.2018	2.698.389	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 255.750.000	2,10 %	20.12.2026	2.692.946	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 300.000.000	0,20 %	20.12.2018	2.671.851	0,03 %
Metropolitan Expressway Co., Ltd.	¥ 300.000.000	0,21 %	18.09.2020	2.671.667	0,03 %
Shoko Chukin Bank Ltd.	¥ 300.000.000	0,17 %	25.01.2019	2.665.417	0,03 %
Shinkin Central Bank	¥ 300.000.000	0,03 %	27.10.2021	2.654.921	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 240.000.000	1,70 %	20.12.2043	2.618.035	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 290.000.000	0,10 %	20.09.2019	2.584.360	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 230.000.000	1,80 %	20.09.2043	2.556.093	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 310.000.000	0,50 %	20.09.2046	2.548.329	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 230.000.000	1,70 %	20.03.2054	2.534.757	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 273.000.000	1,00 %	20.09.2020	2.496.817	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 211.150.000	2,20 %	20.09.2039	2.472.283	0,03 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 2.500.000	1,75 %	28.05.2020	2.459.447	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 270.050.000	0,80 %	20.09.2020	2.456.796	0,03 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Japanische Staatsanleihe	¥ 200.150.000	2,40 %	20.09.2038	2.399.028	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 209.850.000	2,10 %	20.12.2029	2.292.628	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 250.000.000	0,40 %	20.09.2025	2.291.922	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 250.000.000	0,30 %	20.12.2025	2.275.300	0,02 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 250.000.000	0,45 %	25.02.2025	2.271.960	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 250.000.000	0,60 %	20.06.2037	2.239.902	0,02 %
Shoko Chukin Bank Ltd.	¥ 250.000.000	0,25 %	27.03.2019	2.223.362	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 240.000.000	1,10 %	20.03.2021	2.213.475	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 203.000.000	2,10 %	20.03.2029	2.200.761	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 200.000.000	1,70 %	20.09.2044	2.185.211	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 200.800.000	1,90 %	20.09.2030	2.164.576	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 180.000.000	2,30 %	20.03.2039	2.132.549	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 200.000.000	1,50 %	20.12.2044	2.100.346	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 196.050.000	1,70 %	20.06.2032	2.091.600	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 171.000.000	2,20 %	20.03.2050	2.090.526	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 221.600.000	1,10 %	20.09.2021	2.055.874	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 200.000.000	1,40 %	20.12.2045	2.054.913	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 230.000.000	0,80 %	20.03.2046	2.053.952	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 190.000.000	1,80 %	20.03.2032	2.048.121	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 186.300.000	2,10 %	20.03.2030	2.040.138	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 190.600.000	1,70 %	20.12.2032	2.038.109	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 219.400.000	0,70 %	20.12.2022	2.024.693	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 163.850.000	2,20 %	20.03.2049	1.997.385	0,02 %
Japan International Cooperation Agency	\$ 2.000.000	1,88 %	13.11.2019	1.979.740	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 180.000.000	2,00 %	20.12.2030	1.965.939	0,02 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 200.000.000	1,08 %	27.04.2035	1.941.177	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 190.000.000	1,40 %	20.03.2055	1.934.036	0,02 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 200.000.000	0,91 %	31.07.2023	1.862.521	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 200.000.000	1,10 %	20.12.2021	1.860.204	0,02 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 200.000.000	0,92 %	28.07.2023	1.855.739	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 201.800.000	1,40 %	20.03.2020	1.851.670	0,02 %
Tokyo Metropolitan Government	¥ 200.000.000	0,76 %	20.09.2023	1.845.261	0,02 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 200.000.000	0,80 %	25.10.2022	1.838.585	0,02 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 200.000.000	1,47 %	28.04.2020	1.833.426	0,02 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 202.000.000	1,50 %	14.06.2019	1.831.840	0,02 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 200.000.000	0,50 %	29.11.2024	1.829.527	0,02 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 200.000.000	0,55 %	25.09.2024	1.829.188	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 196.000.000	0,90 %	20.06.2022	1.818.094	0,02 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 200.000.000	0,32 %	30.01.2026	1.808.083	0,02 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 200.000.000	0,32 %	19.01.2026	1.807.876	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 199.900.000	1,30 %	20.12.2018	1.799.135	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 200.000.000	0,10 %	20.03.2026	1.791.265	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 200.000.000	0,10 %	20.03.2021	1.787.803	0,02 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 200.000.000	0,25 %	25.02.2027	1.785.711	0,02 %
Norinchukin Bank	¥ 200.000.000	0,23 %	27.01.2021	1.782.897	0,02 %
Japan Finance Corp.	¥ 200.000.000	0,16 %	16.09.2020	1.782.276	0,02 %
Development Bank of Japan, Inc.	¥ 200.000.000	0,16 %	18.12.2020	1.780.701	0,02 %
Shoko Chukin Bank Ltd.	¥ 200.000.000	0,23 %	27.10.2020	1.780.684	0,02 %
Deposit Insurance Corp. of Japan	¥ 200.000.000	0,10 %	19.10.2021	1.780.657	0,02 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 200.000.000	0,16 %	31.08.2027	1.777.451	0,02 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 200.000.000	0,22 %	25.10.2027	1.777.221	0,02 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 200.000.000	0,14 %	16.04.2027	1.776.916	0,02 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 200.000.000	0,14 %	30.04.2027	1.776.470	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 200.000.000	0,80 %	20.03.2047	1.776.192	0,02 %
West Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 200.000.000	0,09 %	20.09.2022	1.773.996	0,02 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 200.000.000	0,01 %	20.06.2019	1.773.559	0,02 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 200.000.000	0,13 %	14.06.2027	1.773.511	0,02 %
Nissan Motor Co., Ltd.	¥ 200.000.000	0,15 %	19.03.2021	1.773.458	0,02 %
Shinkin Central Bank	¥ 200.000.000	0,04 %	27.05.2021	1.771.766	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 170.000.000	1,40 %	20.09.2045	1.746.118	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 179.450.000	1,00 %	20.03.2022	1.667.316	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 150.000.000	2,20 %	20.06.2029	1.645.752	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 150.000.000	1,80 %	20.12.2032	1.623.103	0,02 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 180.000.000	1,90 %	22.06.2018	1.611.346	0,02 %
Shinkin Central Bank	¥ 180.000.000	0,06 %	27.04.2021	1.595.899	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 150.000.000	1,50 %	20.06.2032	1.561.851	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Japanische Staatsanleihe	¥ 168.300.000	1,30 %	20.12.2019	1.535.840	0,02 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 170.000.000	0,31 %	28.07.2023	1.532.353	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 144.000.000	1,60 %	20.03.2033	1.521.070	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 137.000.000	2,10 %	20.12.2028	1.480.986	0,02 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 1.450.000	2,13 %	07.02.2019	1.448.303	0,02 %
Japan Expressway Holding and Debt Repayment Agency	¥ 160.000.000	1,30 %	27.02.2019	1.441.368	0,02 %
Tokyo Metropolitan Government	\$ 1.450.000	2,50 %	08.06.2022	1.435.877	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 154.000.000	0,80 %	20.06.2023	1.433.738	0,02 %
Tokyo Metropolitan Government	¥ 150.000.000	1,35 %	18.12.2020	1.383.613	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 123.000.000	2,20 %	20.03.2030	1.360.043	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 127.900.000	2,30 %	20.06.2026	1.356.058	0,01 %
Development Bank of Japan, Inc.	¥ 150.000.000	1,40 %	15.04.2019	1.355.272	0,01 %
Shinkin Central Bank	¥ 150.000.000	0,25 %	26.06.2020	1.337.920	0,01 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 150.000.000	0,26 %	19.06.2020	1.337.240	0,01 %
Central Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 150.000.000	0,26 %	02.06.2020	1.336.856	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 150.000.000	0,10 %	20.06.2019	1.336.019	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 137.900.000	1,40 %	20.12.2022	1.315.369	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 120.000.000	2,00 %	20.03.2031	1.313.150	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 138.000.000	1,90 %	22.03.2021	1.304.611	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 123.450.000	1,60 %	20.03.2032	1.299.200	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 118.000.000	1,80 %	20.06.2030	1.257.808	0,01 %
Tokyo Metropolitan Government	¥ 135.000.000	0,99 %	20.12.2021	1.243.480	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 113.850.000	2,20 %	20.03.2028	1.229.449	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 125.000.000	1,90 %	20.09.2022	1.214.581	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 125.000.000	2,20 %	20.12.2021	1.211.418	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 125.000.000	2,10 %	20.12.2021	1.207.013	0,01 %
Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.	\$ 1.200.000	2,65 %	19.10.2020	1.201.616	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 101.000.000	2,40 %	20.12.2034	1.188.178	0,01 %
Asahi Group Holdings Ltd.	€ 986.000	0,32 %	19.09.2021	1.181.898	0,01 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 130.000.000	0,18 %	19.03.2020	1.156.371	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 109.000.000	2,00 %	20.03.2027	1.144.098	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	£ 800.000	2,63 %	15.12.2020	1.131.673	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 100.000.000	1,80 %	20.09.2030	1.066.942	0,01 %
Japan Finance Organization for Municipalities	\$ 1.100.000	2,38 %	13.02.2025	1.063.498	0,01 %
Nomura Holdings, Inc.	\$ 1.055.000	2,75 %	19.03.2019	1.059.826	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 89.650.000	2,30 %	20.12.2036	1.050.270	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 107.700.000	1,00 %	20.03.2023	1.010.583	0,01 %
Mizuho Financial Group, Inc.	\$ 1.000.000	3,48 %	12.04.2026	1.007.315	0,01 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	\$ 1.000.000	1,97 %	11.01.2019	997.716	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 100.000.000	1,90 %	20.03.2024	996.698	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 1.000.000	2,75 %	16.11.2027	994.462	0,01 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 1.000.000	2,78 %	12.07.2022	992.815	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 102.000.000	1,10 %	20.06.2020	932.668	0,01 %
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.	¥ 100.000.000	1,39 %	31.05.2022	931.845	0,01 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	¥ 100.000.000	1,60 %	01.06.2021	928.421	0,01 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 100.000.000	0,80 %	29.09.2023	926.747	0,01 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 102.000.000	0,38 %	26.12.2025	926.432	0,01 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 100.000.000	0,81 %	25.09.2023	924.984	0,01 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$ 950.000	2,53 %	13.09.2023	922.989	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 100.000.000	0,50 %	20.12.2024	922.077	0,01 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 100.000.000	0,66 %	29.02.2024	921.627	0,01 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 100.000.000	0,69 %	25.04.2024	921.126	0,01 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 100.000.000	0,90 %	15.02.2022	919.515	0,01 %
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	¥ 100.000.000	1,31 %	18.12.2020	919.057	0,01 %
Tokyo Metropolitan Government	¥ 100.000.000	0,64 %	19.03.2024	918.209	0,01 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 100.000.000	0,66 %	24.11.2023	918.000	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 100.000.000	0,40 %	20.03.2025	916.192	0,01 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 100.000.000	1,42 %	24.01.2020	913.048	0,01 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 100.000.000	0,51 %	25.11.2024	912.035	0,01 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 100.000.000	0,54 %	21.04.2023	911.715	0,01 %
Tokyo Metropolitan Government	¥ 100.000.000	0,48 %	19.09.2025	911.486	0,01 %
Tokyo Metropolitan Government	¥ 100.000.000	1,33 %	20.12.2019	910.485	0,01 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 100.000.000	0,41 %	28.02.2025	910.085	0,01 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 100.000.000	0,41 %	23.01.2026	906.181	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 75.650.000	2,90 %	20.11.2030	902.146	0,01 %
Panasonic Corp.	¥ 100.000.000	0,57 %	18.03.2022	900.287	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Norinchukin Bank	¥ 100.000.000	0,35 %	25.01.2019	890.706	0,01 %
Shinkin Central Bank	¥ 100.000.000	0,20 %	25.10.2019	890.179	0,01 %
Shinkin Central Bank	¥ 100.000.000	0,40 %	27.07.2018	889.618	0,01 %
Deposit Insurance Corp. of Japan	¥ 100.000.000	0,10 %	17.01.2020	889.224	0,01 %
Norinchukin Bank	¥ 100.000.000	0,30 %	26.01.2018	887.844	0,01 %
Deposit Insurance Corp. of Japan	¥ 100.000.000	0,20 %	23.01.2018	887.775	0,01 %
Shinkin Central Bank	¥ 100.000.000	0,07 %	26.03.2021	886.900	0,01 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 100.000.000	0,09 %	20.06.2022	886.699	0,01 %
Central Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 100.000.000	0,07 %	18.03.2022	885.594	0,01 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 97.500.000	1,62 %	24.08.2018	874.229	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 69.100.000	2,40 %	20.03.2048	872.310	0,01 %
Asahi Group Holdings Ltd.	€ 712.000	1,15 %	19.09.2025	855.671	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 850.000	2,13 %	01.06.2020	844.766	0,01 %
Kyushu Electric Power Co., Inc.	¥ 90.000.000	1,06 %	23.02.2024	834.463	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 830.000	2,13 %	16.11.2020	823.266	0,01 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 90.000.000	0,31 %	20.06.2019	801.957	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 800.000	2,10 %	17.01.2019	800.540	0,01 %
Kansai Electric Power Co., Inc.	¥ 90.000.000	0,49 %	23.07.2027	800.032	0,01 %
Japan Finance Organization for Municipalities	\$ 800.000	2,63 %	20.04.2022	796.448	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 78.900.000	1,80 %	20.12.2023	778.795	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 800.000	2,13 %	10.02.2025	767.706	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 74.000.000	2,40 %	20.06.2024	761.862	0,01 %
American Honda Finance Corp.	\$ 750.000	2,25 %	15.08.2019	750.897	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 725.000	1,40 %	20.05.2019	717.895	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 79.000.000	1,40 %	20.12.2018	711.694	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 68.000.000	2,10 %	20.09.2025	702.661	0,01 %
American Honda Finance Corp.	\$ 700.000	2,45 %	24.09.2020	701.660	0,01 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$ 700.000	2,19 %	13.09.2021	686.193	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 75.250.000	1,50 %	20.03.2019	681.164	0,01 %
Dai-ichi Life Insurance Co., Ltd.^	\$ 700.000	4,00 %	24.01.2166	679.875	0,01 %
American Honda Finance Corp.	£ 500.000	1,30 %	21.03.2022	674.588	0,01 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	€ 560.000	0,93 %	11.10.2024	671.334	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	£ 500.000	1,00 %	27.09.2022	669.110	0,01 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 72.000.000	1,54 %	23.08.2019	654.968	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 660.000	2,38 %	16.11.2022	651.610	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 58.100.000	2,30 %	20.06.2027	626.252	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 60.000.000	1,50 %	20.03.2033	626.029	0,01 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 67.000.000	1,10 %	28.12.2021	620.177	0,01 %
Central Japan Railway Co.	\$ 550.000	4,25 %	24.11.2045	612.190	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 58.000.000	2,10 %	20.06.2025	597.006	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 65.000.000	1,40 %	20.06.2019	589.916	0,01 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 65.300.000	1,40 %	25.12.2018	587.579	0,01 %
Sumitomo Life Insurance Co.^	\$ 600.000	4,00 %	14.09.2077	586.500	0,01 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$ 550.000	3,00 %	22.02.2022	553.471	0,01 %
Mizuho Financial Group, Inc.	\$ 550.000	2,63 %	12.04.2021	547.376	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 57.150.000	2,40 %	20.03.2020	535.581	0,01 %
Norinchukin Bank	¥ 60.000.000	0,28 %	26.06.2020	535.539	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 49.000.000	2,20 %	20.09.2028	532.854	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 50.000.000	2,30 %	20.09.2026	532.277	0,01 %
Development Bank of Japan, Inc.	¥ 54.000.000	1,70 %	20.09.2022	516.916	0,01 %
Nippon Life Insurance Co.^	\$ 500.000	4,70 %	20.01.2046	515.380	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 500.000	3,00 %	29.05.2024	508.464	0,01 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 500.000	3,36 %	12.07.2027	497.960	0,01 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$ 500.000	2,67 %	25.07.2022	493.856	0,01 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 500.000	3,01 %	19.10.2026	485.475	0,01 %
American Honda Finance Corp.	€ 400.000	0,75 %	17.01.2024	480.698	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 52.000.000	1,30 %	20.06.2020	477.754	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 44.000.000	2,10 %	20.09.2027	468.521	0,01 %
Tokyo Metropolitan Government	¥ 50.000.000	1,38 %	20.12.2019	455.684	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 38.650.000	2,30 %	20.03.2035	449.417	0,01 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 50.000.000	1,57 %	23.02.2018	444.761	0,01 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 50.000.000	0,06 %	18.06.2021	443.242	0,01 %
Metropolitan Expressway Co., Ltd.	¥ 50.000.000	0,03 %	17.09.2021	442.634	0,01 %
West Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 50.000.000	0,17 %	22.05.2026	441.297	0,01 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 45.000.000	1,30 %	30.01.2019	405.077	0,00 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$ 400.000	2,95 %	01.03.2021	403.551	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	AUD 500.000	3,66 %	29.03.2022	395.392	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 400.000	1,90 %	08.04.2021	393.478	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 38.800.000	1,90 %	20.03.2025	392.595	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 42.000.000	2,90 %	20.09.2019	392.183	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 36.000.000	2,10 %	20.06.2028	386.934	0,00 %
Nomura Europe Finance NV	€ 300.000	1,50 %	12.05.2021	374.006	0,00 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 41.800.000	1,70 %	22.05.2018	373.497	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 30.450.000	2,50 %	20.06.2034	361.029	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 350.000	2,90 %	17.04.2024	353.325	0,00 %
East Japan Railway Co.	£ 200.000	4,50 %	25.01.2036	351.946	0,00 %
Japan Finance Organization for Municipalities	\$ 350.000	2,13 %	06.03.2019	348.754	0,00 %
ORIX Corp.	\$ 350.000	2,90 %	18.07.2022	347.864	0,00 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 350.000	2,44 %	19.10.2021	345.702	0,00 %
Japan Expressway Holding and Debt Repayment Agency	¥ 38.000.000	1,30 %	30.09.2019	344.955	0,00 %
Development Bank of Japan, Inc.	\$ 350.000	2,00 %	19.10.2021	341.695	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 32.000.000	2,10 %	20.03.2027	338.461	0,00 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$ 325.000	3,29 %	25.07.2027	320.857	0,00 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$ 300.000	3,85 %	01.03.2026	310.310	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 300.000	3,30 %	12.01.2022	308.877	0,00 %
American Honda Finance Corp.	\$ 300.000	2,90 %	16.02.2024	300.427	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 300.000	2,25 %	13.01.2020	299.415	0,00 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 300.000	1,88 %	20.04.2021	293.308	0,00 %
Mizuho Financial Group, Inc.	\$ 300.000	2,84 %	13.09.2026	288.194	0,00 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$ 300.000	2,76 %	13.09.2026	286.353	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 25.150.000	2,20 %	20.05.2031	281.457	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 29.000.000	1,30 %	20.09.2019	263.739	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 26.900.000	1,80 %	20.06.2023	263.541	0,00 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	\$ 250.000	3,65 %	23.07.2025	258.267	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 24.000.000	2,20 %	20.09.2027	257.568	0,00 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	\$ 250.000	3,40 %	11.07.2024	256.114	0,00 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	€ 200.000	2,25 %	16.12.2020	255.268	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 25.950.000	2,00 %	20.06.2022	252.020	0,00 %
Development Bank of Japan, Inc.	\$ 250.000	2,88 %	19.09.2024	250.600	0,00 %
Suntory Holdings Ltd.	\$ 250.000	2,55 %	29.09.2019	250.278	0,00 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	\$ 250.000	3,00 %	18.01.2023	250.060	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 250.000	2,55 %	08.03.2021	249.297	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 250.000	1,70 %	19.02.2019	249.100	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 250.000	1,95 %	17.04.2020	248.338	0,00 %
Tokyo Metropolitan Government	¥ 27.000.000	1,30 %	19.06.2020	247.190	0,00 %
Japan Finance Organization for Municipalities	€ 200.000	0,88 %	22.09.2021	244.229	0,00 %
Development Bank of Japan, Inc.	€ 200.000	0,38 %	21.10.2019	241.061	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 20.000.000	2,50 %	20.03.2036	239.837	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 21.000.000	2,00 %	20.12.2025	216.260	0,00 %
Nippon Life Insurance Co.^	\$ 200.000	5,00 %	18.10.2042	211.090	0,00 %
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.	\$ 200.000	4,10 %	09.09.2023	210.825	0,00 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 23.000.000	1,44 %	24.04.2020	210.779	0,00 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 200.000	3,78 %	09.03.2026	206.096	0,00 %
Mizuho Financial Group Cayman 2 Ltd.	\$ 200.000	4,20 %	18.07.2022	205.228	0,00 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$ 200.000	3,68 %	22.02.2027	204.717	0,00 %
Osaka Prefecture	¥ 20.000.000	1,45 %	26.09.2034	202.990	0,00 %
Daiwa Securities Group, Inc.	\$ 200.000	3,13 %	19.04.2022	200.829	0,00 %
ORIX Corp.	\$ 200.000	3,70 %	18.07.2027	200.086	0,00 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	\$ 200.000	2,09 %	18.10.2019	199.052	0,00 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 200.000	2,50 %	01.06.2022	199.048	0,00 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 200.000	2,78 %	18.10.2022	198.515	0,00 %
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	\$ 200.000	2,45 %	18.01.2022	198.029	0,00 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 200.000	2,50 %	28.05.2025	197.271	0,00 %
Nippon Life Insurance Co.^	\$ 200.000	4,00 %	19.09.2047	196.500	0,00 %
Japan Finance Organization for Municipalities	\$ 200.000	2,13 %	13.04.2021	195.788	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 200.000	2,25 %	18.10.2023	195.283	0,00 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 200.000	2,06 %	14.07.2021	195.276	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 18.000.000	2,10 %	20.06.2027	191.005	0,00 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 20.000.000	1,30 %	29.05.2020	183.025	0,00 %
Mizuho Bank Ltd.	\$ 175.000	2,65 %	25.09.2019	175.694	0,00 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 175.000	1,50 %	21.07.2021	168.889	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 16.000.000	2,10 %	20.12.2024	163.368	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 150.000	2,60 %	11.01.2022	150.501	0,00 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 16.300.000	0,67 %	17.03.2023	149.506	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 150.000	1,70 %	09.01.2019	149.409	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 150.000	2,15 %	13.07.2020	148.834	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 150.000	2,15 %	08.09.2022	147.417	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 14.000.000	2,10 %	20.03.2026	145.786	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 11.000.000	2,50 %	20.09.2036	132.308	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 12.000.000	2,30 %	20.03.2026	126.721	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	€ 100.000	1,80 %	23.07.2020	125.429	0,00 %
American Honda Finance Corp.	\$ 125.000	2,60 %	16.11.2022	125.099	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 125.000	2,15 %	28.09.2020	123.917	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	€ 100.000	1,00 %	10.09.2021	123.603	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 125.000	2,60 %	28.09.2022	123.501	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 12.000.000	2,20 %	20.06.2024	122.164	0,00 %
American Honda Finance Corp.	\$ 125.000	1,70 %	09.09.2021	121.448	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 12.000.000	1,90 %	20.09.2023	118.597	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	€ 10.000.000	2,30 %	20.12.2035	116.660	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	€ 10.000.000	2,30 %	20.06.2035	116.428	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 11.000.000	2,00 %	20.03.2025	112.009	0,00 %
Japan Finance Organization for Municipalities	€ 10.000.000	2,29 %	25.04.2028	107.196	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 100.000	3,40 %	15.09.2021	103.366	0,00 %
Mizuho Bank Ltd.	\$ 100.000	3,60 %	25.09.2024	102.740	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 100.000	3,20 %	11.01.2027	101.377	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	€ 10.000.000	2,20 %	20.03.2024	101.330	0,00 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 100.000	2,93 %	09.03.2021	100.784	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 100.000	2,80 %	13.01.2022	100.067	0,00 %
American Honda Finance Corp.	\$ 100.000	2,00 %	13.11.2019	99.667	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 100.000	2,65 %	13.07.2022	99.230	0,00 %
American Honda Finance Corp.	\$ 100.000	1,20 %	12.07.2019	98.562	0,00 %
American Honda Finance Corp.	\$ 100.000	1,65 %	12.07.2021	97.472	0,00 %
Development Bank of Japan, Inc.	\$ 100.000	1,63 %	01.09.2021	96.022	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 9.000.000	2,10 %	20.03.2025	92.221	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 8.000.000	1,90 %	20.06.2025	81.284	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 8.000.000	1,90 %	20.12.2023	79.393	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 7.000.000	2,00 %	20.06.2025	71.588	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 70.000	1,55 %	13.09.2019	69.070	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	€ 50.000	2,38 %	01.02.2023	65.923	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 60.000	1,90 %	14.09.2021	58.337	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 5.000.000	2,10 %	20.03.2024	50.388	0,00 %
ORIX Corp.	\$ 50.000	3,25 %	04.12.2024	49.687	0,00 %
American Honda Finance Corp.	\$ 50.000	2,30 %	09.09.2026	47.141	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 5.000.000	1,50 %	20.03.2019	45.263	0,00 %
				1.079.694.495	11,35 %
Jersey 0,01 % (2016: 0,01 %)					
UBS Group Funding Switzerland AG	\$ 500.000	2,65 %	01.02.2022	494.561	0,01 %
HSBC Bank Middle East Ltd.	\$ 200.000	2,75 %	01.10.2019	200.248	0,00 %
Aptiv plc	\$ 150.000	3,15 %	19.11.2020	152.150	0,00 %
Atrium European Real Estate Ltd.	€ 100.000	3,63 %	17.10.2022	132.868	0,00 %
Aptiv plc	\$ 50.000	4,40 %	01.10.2046	50.625	0,00 %
				1.030.452	0,01 %
Kasachstan 0,05 % (2016: 0,07 %)					
Kazakhstan Government International Bond	\$ 1.200.000	5,13 %	21.07.2025	1.336.500	0,01 %
Development Bank of Kazakhstan JSC	\$ 950.000	4,13 %	10.12.2022	977.313	0,01 %
Kazakhstan Government International Bond	\$ 500.000	6,50 %	21.07.2045	641.250	0,01 %
Kazakhstan Government International Bond	\$ 500.000	3,88 %	14.10.2024	519.375	0,01 %
KazMunayGas National Co. JSC	\$ 500.000	4,40 %	30.04.2023	517.750	0,01 %
KazMunayGas National Co. JSC	\$ 400.000	4,75 %	19.04.2027	421.500	0,00 %
Kazakhstan Government International Bond	\$ 350.000	4,88 %	14.10.2044	376.250	0,00 %
KazMunayGas National Co. JSC	\$ 125.000	7,00 %	05.05.2020	135.312	0,00 %
				4.925.250	0,05 %
Kuwait 0,02 % (2016: 0,00 %)					
Kuwait International Government Bond	\$ 1.100.000	3,50 %	20.03.2027	1.118.681	0,01 %
Kuwait International Government Bond	\$ 400.000	2,75 %	20.03.2022	399.024	0,01 %
Kuwait Projects Co. SPC Ltd.	\$ 200.000	5,00 %	15.03.2023	208.578	0,00 %
				1.726.283	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Lettland 0,00 % (2016: 0,00 %)					
Latvia Government International Bond	€ 100.000	2,88 %	30.04.2024	140.133	0,00 %
				140.133	0,00 %
Litauen 0,02 % (2016: 0,03 %)					
Lithuania Government International Bond	€ 500.000	1,25 %	22.10.2025	633.427	0,01 %
Lithuania Government International Bond	\$ 500.000	6,13 %	09.03.2021	555.575	0,01 %
Lithuania Government International Bond	€ 200.000	2,13 %	29.10.2026	270.468	0,00 %
Lithuania Government International Bond	\$ 200.000	6,63 %	01.02.2022	231.773	0,00 %
Lithuania Government International Bond	\$ 125.000	6,13 %	09.03.2021	138.920	0,00 %
Lithuania Government International Bond	\$ 125.000	7,38 %	11.02.2020	138.123	0,00 %
				1.968.286	0,02 %
Luxemburg 0,03 % (2016: 0,03 %)					
Aroundtown SA	€ 1.000.000	1,00 %	07.01.2025	1.168.422	0,01 %
SES Global Americas Holdings GP	\$ 750.000	2,50 %	25.03.2019	748.248	0,01 %
NORD/LB Luxembourg SA Covered Bond Bank	€ 500.000	0,38 %	15.06.2023	597.186	0,01 %
Luxembourg Government Bond	€ 100.000	3,38 %	18.05.2020	130.914	0,00 %
Luxembourg Government Bond	€ 50.000	2,13 %	10.07.2023	66.999	0,00 %
				2.711.769	0,03 %
Malaysia 0,32 % (2016: 0,32 %)					
Malaysia Government Bond	RM 25.000.000	3,96 %	15.09.2025	6.136.317	0,06 %
Malaysia Government Bond	RM 17.000.000	3,65 %	31.10.2019	4.240.565	0,05 %
Malaysia Government Bond	RM 10.000.000	3,80 %	17.08.2023	2.472.515	0,03 %
Malaysia Government Bond	RM 10.000.000	3,48 %	15.03.2023	2.432.758	0,03 %
Malaysia Government Bond	RM 10.500.000	3,84 %	15.04.2033	2.428.232	0,03 %
Malaysia Government Bond	RM 9.500.000	4,23 %	30.06.2031	2.312.202	0,02 %
Malaysia Government Bond	RM 8.000.000	3,89 %	31.07.2020	2.006.525	0,02 %
Malaysia Government Bond	RM 7.500.000	3,90 %	30.11.2026	1.829.390	0,02 %
Malaysia Government Bond	RM 5.500.000	3,42 %	15.08.2022	1.342.155	0,01 %
Malaysia Government Bond	RM 4.500.000	4,18 %	15.07.2024	1.126.307	0,01 %
Malaysia Sovereign Sukuk Bhd	\$ 700.000	4,24 %	22.04.2045	762.356	0,01 %
Petronas Global Sukuk Ltd.	\$ 750.000	2,71 %	18.03.2020	750.878	0,01 %
Malaysia Government Bond	RM 3.000.000	4,50 %	15.04.2030	742.077	0,01 %
Petronas Capital Ltd.	\$ 600.000	3,50 %	18.03.2025	614.514	0,01 %
Petronas Capital Ltd.	\$ 300.000	4,50 %	18.03.2045	337.431	0,00 %
Malaysia Government Bond	RM 1.000.000	5,25 %	15.09.2028	264.717	0,00 %
Malaysia Sukuk Global Bhd	\$ 250.000	3,18 %	27.04.2026	251.850	0,00 %
Malaysia Government Bond	RM 1.000.000	4,94 %	30.09.2043	248.869	0,00 %
Malaysia Sovereign Sukuk Bhd	\$ 200.000	3,04 %	22.04.2025	200.790	0,00 %
Petronas Capital Ltd.	\$ 100.000	5,25 %	12.08.2019	104.259	0,00 %
Petronas Capital Ltd.	\$ 100.000	5,25 %	12.08.2019	104.251	0,00 %
SSG Resources Ltd.	\$ 100.000	4,25 %	04.10.2022	103.643	0,00 %
				30.812.601	0,32 %
Mexiko 0,80 % (2016: 0,77 %)					
Mexican Bonos	MXN 134.000.000	8,00 %	11.06.2020	6.904.265	0,07 %
Mexican Bonos	MXN 121.000.000	6,50 %	10.06.2021	5.973.159	0,06 %
Mexican Bonos	MXN 73.500.000	10,00 %	05.12.2024	4.234.378	0,05 %
Mexico Government International Bond	\$ 3.600.000	4,15 %	28.03.2027	3.738.614	0,04 %
Mexican Bonos	MXN 60.000.000	6,50 %	09.06.2022	2.935.402	0,03 %
Mexican Bonos	MXN 47.200.000	8,50 %	18.11.2038	2.586.103	0,03 %
Mexican Bonos	MXN 50.000.000	7,75 %	13.11.2042	2.540.186	0,03 %
Petroleos Mexicanos	\$ 2.000.000	6,50 %	13.03.2027	2.185.716	0,02 %
Mexico Government International Bond	€ 1.730.000	1,38 %	15.01.2025	2.105.983	0,02 %
Petroleos Mexicanos	\$ 1.964.000	6,75 %	21.09.2047	2.056.314	0,02 %
Petroleos Mexicanos	\$ 1.600.000	6,75 %	21.09.2047	1.675.205	0,02 %
Mexican Bonos	MXN 32.500.000	5,00 %	11.12.2019	1.581.122	0,02 %
Mexico Government International Bond	€ 1.000.000	3,38 %	23.02.2031	1.361.527	0,02 %
Mexico City Airport Trust	\$ 1.300.000	5,50 %	31.07.2047	1.286.159	0,01 %
Petroleos Mexicanos	€ 1.000.000	2,50 %	21.08.2021	1.260.128	0,01 %
Banco Nacional de Comercio Exterior SNC	\$ 1.150.000	4,38 %	14.10.2025	1.190.825	0,01 %
Mexico Government International Bond	\$ 1.150.000	3,50 %	21.01.2021	1.189.565	0,01 %
Mexico City Airport Trust	\$ 1.100.000	4,25 %	31.10.2026	1.131.408	0,01 %
Mexican Bonos	MXN 25.000.000	5,75 %	05.03.2026	1.129.488	0,01 %
Petroleos Mexicanos	\$ 1.050.000	5,50 %	21.01.2021	1.119.166	0,01 %
Mexico Government International Bond	\$ 1.050.000	4,00 %	02.10.2023	1.099.672	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Mexican Bonos	MXN 20.000.000	8,50 %	31.05.2029	1.082.579	0,01 %
Petroleos Mexicanos	\$ 1.000.000	5,50 %	04.02.2019	1.031.936	0,01 %
Petroleos Mexicanos	\$ 1.100.000	5,63 %	23.01.2046	1.015.819	0,01 %
Mexico Government International Bond	\$ 775.000	6,05 %	11.01.2040	923.010	0,01 %
Mexico Government International Bond	\$ 800.000	5,75 %	12.10.2110	844.621	0,01 %
Mexico Government International Bond	\$ 800.000	4,75 %	08.03.2044	807.898	0,01 %
Petroleos Mexicanos	\$ 674.000	4,63 %	21.09.2023	692.362	0,01 %
Petroleos Mexicanos	£ 400.000	8,25 %	02.06.2022	670.964	0,01 %
America Movil SAB de CV	\$ 625.000	5,00 %	30.03.2020	657.229	0,01 %
Petroleos Mexicanos	€ 500.000	3,13 %	27.11.2020	643.911	0,01 %
Mexico Government International Bond	€ 500.000	2,38 %	09.04.2021	641.538	0,01 %
Mexican Bonos	MXN 12.500.000	7,75 %	29.05.2031	639.231	0,01 %
Alfa SAB de CV	\$ 600.000	5,25 %	25.03.2024	635.250	0,01 %
Mexichem SAB de CV	\$ 600.000	5,50 %	15.01.2048	587.589	0,01 %
Mexico Government International Bond	\$ 500.000	5,55 %	21.01.2045	565.195	0,01 %
Petroleos Mexicanos	\$ 500.000	6,38 %	23.01.2045	502.629	0,01 %
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	€ 400.000	1,75 %	20.03.2023	502.155	0,01 %
Mexico Government International Bond	\$ 500.000	4,60 %	23.01.2046	494.256	0,01 %
Grupo Televisa SAB	\$ 400.000	6,13 %	31.01.2046	471.913	0,01 %
Mexican Bonos	MXN 9.000.000	7,75 %	23.11.2034	459.773	0,01 %
America Movil SAB de CV	\$ 350.000	6,38 %	01.03.2035	443.712	0,01 %
Petroleos Mexicanos	\$ 400.000	6,50 %	13.03.2027	437.143	0,01 %
Petroleos Mexicanos	\$ 400.000	6,38 %	04.02.2021	435.615	0,01 %
Comision Federal de Electricidad	\$ 400.000	4,75 %	23.02.2027	418.872	0,01 %
America Movil SAB de CV	\$ 400.000	3,13 %	16.07.2022	404.227	0,01 %
Mexico Government International Bond	\$ 400.000	4,35 %	15.01.2047	383.210	0,01 %
Mexican Bonos	MXN 7.500.000	7,50 %	03.06.2027	378.900	0,01 %
BBVA Bancomer SA	\$ 350.000	4,38 %	10.04.2024	364.997	0,01 %
Mexico Government International Bond	\$ 350.000	3,63 %	15.03.2022	362.979	0,01 %
America Movil SAB de CV	£ 200.000	4,38 %	07.08.2041	322.921	0,00 %
Mexican Bonos	MXN 5.000.000	10,00 %	20.11.2036	311.881	0,00 %
Mexichem SAB de CV	\$ 300.000	5,88 %	17.09.2044	309.000	0,00 %
Grupo Bimbo SAB de CV	\$ 300.000	3,88 %	27.06.2024	307.798	0,00 %
Grupo Bimbo SAB de CV	\$ 300.000	4,70 %	10.11.2047	302.694	0,00 %
Mexico Government International Bond	£ 200.000	5,63 %	19.03.2114	295.677	0,00 %
America Movil SAB de CV	\$ 225.000	6,13 %	30.03.2040	286.288	0,00 %
BBVA Bancomer SA	\$ 250.000	6,75 %	30.09.2022	281.926	0,00 %
Petroleos Mexicanos	€ 200.000	4,88 %	21.02.2028	266.492	0,00 %
Petroleos Mexicanos	\$ 250.000	5,38 %	13.03.2022	265.770	0,00 %
America Movil SAB de CV	\$ 250.000	4,38 %	16.07.2042	264.010	0,00 %
Petroleos Mexicanos	\$ 250.000	4,88 %	24.01.2022	260.733	0,00 %
Mexican Bonos	MXN 5.000.000	8,00 %	07.12.2023	259.682	0,00 %
Petroleos Mexicanos	€ 200.000	3,75 %	15.03.2019	250.076	0,00 %
Comision Federal de Electricidad	\$ 200.000	6,13 %	16.06.2045	221.500	0,00 %
Mexichem SAB de CV	\$ 200.000	4,88 %	19.09.2022	213.000	0,00 %
Grupo Televisa SAB	\$ 200.000	4,63 %	30.01.2026	211.883	0,00 %
Comision Federal de Electricidad	\$ 200.000	4,88 %	26.05.2021	211.500	0,00 %
America Movil SAB de CV	\$ 200.000	5,00 %	16.10.2019	209.343	0,00 %
Grupo Bimbo SAB de CV	\$ 200.000	3,88 %	27.06.2024	205.110	0,00 %
Banco Inbursa SA Institucion de Banca Multiple	\$ 200.000	4,13 %	06.06.2024	201.123	0,00 %
Fermaca Enterprises S de RL de CV	\$ 185.600	6,38 %	30.03.2038	199.520	0,00 %
Infraestructura Energética Nova SAB de CV	\$ 200.000	3,75 %	14.01.2028	197.773	0,00 %
Infraestructura Energética Nova SAB de CV	\$ 200.000	4,88 %	14.01.2048	192.398	0,00 %
Petroleos Mexicanos	\$ 208.000	5,50 %	27.06.2044	192.121	0,00 %
America Movil SAB de CV	\$ 150.000	6,13 %	15.11.2037	188.080	0,00 %
Grupo Televisa SAB	\$ 150.000	6,63 %	18.03.2025	177.481	0,00 %
Coca-Cola Femsa SAB de CV	\$ 150.000	5,25 %	26.11.2043	176.992	0,00 %
America Movil SAB de CV	£ 100.000	4,95 %	22.07.2033	168.720	0,00 %
Mexichem SAB de CV	\$ 150.000	4,88 %	19.09.2022	159.750	0,00 %
Coca-Cola Femsa SAB de CV	\$ 150.000	3,88 %	26.11.2023	155.725	0,00 %
Becele SAB de CV	\$ 150.000	3,75 %	13.05.2025	150.359	0,00 %
Petroleos Mexicanos	€ 100.000	5,13 %	15.03.2023	139.731	0,00 %
Mexico Government International Bond	€ 100.000	2,75 %	22.04.2023	132.284	0,00 %
America Movil SAB de CV	€ 100.000	3,00 %	12.07.2021	131.204	0,00 %
America Movil SAB de CV	€ 100.000	4,13 %	25.10.2019	128.979	0,00 %
Petroleos Mexicanos	€ 100.000	3,75 %	16.04.2026	125.316	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Mexico Government International Bond	€ 100.000	4,00 %	15.03.2115	115.217	0,00 %
Petroleos Mexicanos	\$ 100.000	6,63 %	15.06.2035	107.107	0,00 %
Petroleos Mexicanos	\$ 100.000	6,00 %	05.03.2020	106.335	0,00 %
Petroleos Mexicanos	\$ 100.000	6,50 %	02.06.2041	103.375	0,00 %
Petroleos Mexicanos	\$ 100.000	3,50 %	30.01.2023	98.151	0,00 %
America Movil SAB de CV	£ 50.000	5,75 %	28.06.2030	88.169	0,00 %
Petroleos Mexicanos	€ 50.000	5,50 %	24.02.2025	70.852	0,00 %
Grupo Televisa SAB	\$ 50.000	8,50 %	11.03.2032	66.382	0,00 %
Coca-Cola Femsa SAB de CV	\$ 66.000	2,38 %	26.11.2018	66.100	0,00 %
Grupo Televisa SAB	\$ 50.000	6,63 %	15.01.2040	61.436	0,00 %
				75.741.862	0,80 %
Marokko 0,02 % (2016: 0,03 %)					
OCP SA	\$ 650.000	4,50 %	22.10.2025	650.000	0,01 %
OCP SA	\$ 600.000	5,63 %	25.04.2024	642.000	0,01 %
Internationale Staatsanleihe von Marokko	\$ 600.000	4,25 %	11.12.2022	633.000	0,00 %
OCP SA	\$ 200.000	5,63 %	25.04.2024	214.000	0,00 %
Internationale Staatsanleihe von Marokko	€ 100.000	3,50 %	19.06.2024	134.194	0,00 %
				2.273.194	0,02 %
Niederlande 1,84 % (2016: 2,00 %)					
Netherlands Government Bond	€ 5.550.000	2,50 %	15.01.2033	8.174.602	0,09 %
Netherlands Government Bond	€ 6.000.000	0,75 %	15.07.2027	7.348.384	0,08 %
Netherlands Government Bond	€ 6.000.000	0,25 %	15.07.2025	7.202.941	0,08 %
Netherlands Government Bond	€ 4.900.000	3,25 %	15.07.2021	6.647.559	0,07 %
Netherlands Government Bond	€ 5.000.000	1,75 %	15.07.2023	6.598.330	0,07 %
Netherlands Government Bond	€ 5.000.000	0,50 %	15.07.2026	6.065.475	0,06 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	€ 5.000.000	0,75 %	04.10.2041	5.073.608	0,05 %
Netherlands Government Bond	€ 3.450.000	2,25 %	15.07.2022	4.607.482	0,05 %
Netherlands Government Bond	€ 3.650.000	1,25 %	15.01.2019	4.470.210	0,05 %
Netherlands Government Bond	€ 2.450.000	5,50 %	15.01.2028	4.372.929	0,05 %
Netherlands Government Bond	€ 2.600.000	2,00 %	15.07.2024	3.508.094	0,04 %
Netherlands Government Bond	€ 2.000.000	2,75 %	15.01.2047	3.267.492	0,04 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 2.350.000	3,75 %	09.11.2020	3.102.081	0,03 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 2.100.000	4,13 %	14.09.2022	2.926.952	0,03 %
Netherlands Government Bond	€ 2.200.000	3,50 %	15.07.2020	2.912.989	0,03 %
Netherlands Government Bond	€ 1.450.000	4,00 %	15.01.2037	2.650.303	0,03 %
Netherlands Government Bond	€ 2.000.000	0,25 %	15.01.2020	2.443.354	0,03 %
Shell International Finance BV	\$ 2.400.000	2,00 %	15.11.2018	2.400.737	0,03 %
Aegon Bank NV	€ 2.000.000	0,75 %	27.06.2027	2.377.841	0,03 %
Netherlands Government Bond	€ 1.450.000	1,75 %	15.07.2023	1.913.516	0,02 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	\$ 1.900.000	1,50 %	23.01.2019	1.890.671	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 1.500.000	0,13 %	03.11.2020	1.823.117	0,02 %
ABN AMRO Bank NV	€ 1.500.000	1,38 %	12.01.2037	1.807.216	0,02 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	€ 1.400.000	0,50 %	27.10.2022	1.716.208	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	\$ 1.700.000	1,50 %	15.02.2019	1.690.220	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 1.150.000	3,75 %	14.01.2020	1.499.359	0,02 %
Netherlands Government Bond	€ 1.150.000	4,00 %	15.07.2019	1.479.950	0,02 %
Shell International Finance BV	\$ 1.350.000	4,00 %	10.05.2046	1.432.053	0,02 %
Aegon Bank NV	€ 1.200.000	0,38 %	21.11.2024	1.429.876	0,02 %
ING Bank NV	€ 1.150.000	1,25 %	13.12.2019	1.417.795	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	£ 1.000.000	2,25 %	23.03.2022	1.405.166	0,02 %
NN Group NV^	€ 1.000.000	4,63 %	13.01.2048	1.397.431	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	AUD 1.750.000	7,25 %	20.04.2018	1.390.520	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	£ 1.000.000	1,13 %	24.05.2021	1.363.132	0,02 %
NN Group NV	€ 1.084.000	0,25 %	01.06.2020	1.307.053	0,01 %
ING Groep NV^	€ 1.000.000	2,50 %	15.02.2029	1.276.422	0,01 %
Unilever NV	€ 1.000.000	1,38 %	31.07.2029	1.224.677	0,01 %
ABN AMRO Bank NV	€ 1.000.000	0,75 %	09.06.2020	1.222.199	0,01 %
ING Groep NV	€ 1.000.000	0,75 %	09.03.2022	1.216.712	0,01 %
Netherlands Government Bond	€ 1.000.000	0,00 %	15.01.2022	1.213.661	0,01 %
Stedin Holding NV	€ 1.000.000	0,88 %	24.10.2025	1.202.611	0,01 %
PostNL NV	€ 1.000.000	1,00 %	21.11.2024	1.200.327	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 1.000.000	0,63 %	19.06.2027	1.197.285	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 900.000	4,13 %	14.01.2020	1.172.434	0,01 %
ABN AMRO Bank NV	\$ 1.075.000	4,75 %	28.07.2025	1.140.556	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	CHF 1.000.000	2,25 %	14.10.2020	1.105.182	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Cooperatieve Rabobank UA	€ 900.000	1,75 %	22.01.2019	1.103.143	0,01 %
ING Groep NV^	€ 900.000	1,63 %	26.09.2029	1.083.102	0,01 %
Heineken NV	€ 900.000	1,50 %	03.10.2029	1.082.545	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 1.000.000	3,75 %	21.07.2026	1.010.613	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	\$ 980.000	1,75 %	30.10.2019	974.002	0,01 %
Shell International Finance BV	€ 700.000	1,88 %	15.09.2025	913.799	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 900.000	2,50 %	19.01.2021	902.498	0,01 %
ABN AMRO Bank NV	€ 700.000	1,88 %	31.07.2019	870.576	0,01 %
ING Bank NV	€ 600.000	3,38 %	10.01.2022	818.503	0,01 %
ING Bank NV	€ 600.000	3,63 %	31.08.2021	817.923	0,01 %
Shell International Finance BV	\$ 800.000	3,75 %	12.09.2046	816.454	0,01 %
ASML Holding NV	€ 650.000	1,63 %	28.05.2027	808.119	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	\$ 800.000	2,38 %	16.03.2026	780.712	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	\$ 750.000	1,63 %	25.11.2019	742.682	0,01 %
Shell International Finance BV	\$ 725.000	2,38 %	21.08.2022	718.078	0,01 %
LeasePlan Corp.NV	€ 586.000	0,75 %	03.10.2022	704.179	0,01 %
ING Bank NV	\$ 700.000	2,50 %	01.10.2019	701.021	0,01 %
Enexis Holding NV	€ 500.000	3,38 %	26.01.2022	676.874	0,01 %
Unilever plc	£ 500.000	1,13 %	03.02.2022	676.057	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 500.000	5,25 %	24.05.2041	632.094	0,01 %
ABN AMRO Bank NV^	\$ 600.000	4,40 %	27.03.2028	618.024	0,01 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	€ 500.000	0,50 %	19.01.2023	613.226	0,01 %
Nederlandse Gasunie NV	€ 500.000	1,00 %	11.05.2026	610.751	0,01 %
F van Lanschot Bankiers NV	€ 500.000	0,88 %	15.02.2027	601.257	0,01 %
ABN AMRO Bank NV	€ 500.000	1,00 %	13.04.2031	591.178	0,01 %
TenneT Holding BV	€ 500.000	1,25 %	24.10.2033	575.829	0,01 %
ING Bank NV	\$ 500.000	5,80 %	25.09.2023	560.714	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 550.000	2,25 %	14.01.2020	549.359	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	CHF 500.000	2,00 %	06.02.2019	526.629	0,01 %
ABN AMRO Bank NV^	€ 400.000	2,88 %	18.01.2028	522.660	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 500.000	3,38 %	21.05.2025	512.843	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 500.000	2,75 %	10.01.2022	503.897	0,01 %
Netherlands Government Bond	€ 350.000	3,75 %	15.01.2023	502.683	0,01 %
ABN AMRO Bank NV	\$ 500.000	2,10 %	18.01.2019	499.471	0,01 %
ING Bank NV	\$ 500.000	2,00 %	26.11.2018	499.408	0,01 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	€ 500.000	1,75 %	05.09.2019	496.947	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 400.000	1,25 %	23.03.2026	494.912	0,01 %
NN Group NV	€ 400.000	1,00 %	18.03.2022	493.026	0,01 %
Shell International Finance BV	\$ 500.000	2,50 %	12.09.2026	484.180	0,01 %
TenneT Holding BV	€ 400.000	1,00 %	13.06.2026	483.985	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 400.000	0,13 %	11.10.2021	480.413	0,01 %
Koninklijke DSM NV	€ 400.000	0,75 %	28.09.2026	472.429	0,01 %
Koninklijke KPN NV	€ 400.000	0,63 %	09.04.2025	467.966	0,01 %
Shell International Finance BV	\$ 400.000	4,55 %	12.08.2043	457.112	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA^	\$ 400.000	11,00 %	31.12.2166	447.000	0,01 %
Shell International Finance BV	\$ 425.000	4,38 %	25.03.2020	444.798	0,01 %
Shell International Finance BV	\$ 400.000	4,13 %	11.05.2035	437.562	0,01 %
Shell International Finance BV	\$ 300.000	6,38 %	15.12.2038	419.330	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 300.000	2,25 %	17.07.2023	403.043	0,00 %
ING Bank NV	\$ 400.000	2,75 %	22.03.2021	402.022	0,00 %
ING Bank NV	\$ 400.000	2,30 %	22.03.2019	400.075	0,00 %
Shell International Finance BV	\$ 400.000	2,88 %	10.05.2026	398.066	0,00 %
ABN AMRO Bank NV	\$ 400.000	1,80 %	20.09.2019	396.484	0,00 %
Unilever Capital Corp.	\$ 400.000	2,60 %	05.05.2024	394.686	0,00 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 300.000	1,00 %	12.01.2026	374.717	0,00 %
Heineken NV	€ 300.000	1,38 %	29.01.2027	368.950	0,00 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 300.000	0,38 %	14.01.2022	366.847	0,00 %
F van Lanschot Bankiers NV	€ 300.000	0,38 %	31.03.2023	362.149	0,00 %
Heineken NV	\$ 350.000	3,40 %	01.04.2022	360.112	0,00 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 300.000	0,25 %	07.05.2025	356.760	0,00 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	€ 300.000	1,25 %	27.05.2036	352.955	0,00 %
ABN AMRO Bank NV	\$ 350.000	2,45 %	04.06.2020	350.005	0,00 %
ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG^	€ 267.000	3,38 %	29.09.2047	343.108	0,00 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	€ 250.000	3,88 %	17.02.2020	327.614	0,00 %
UPP Bond 1 Issuer plc	£ 191.505	4,90 %	28.02.2040	319.078	0,00 %
Cooperatieve Rabobank UA	£ 200.000	4,63 %	23.05.2029	319.057	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 250.000	5,75 %	01.12.2043	318.092	0,00 %
Cooperatieve Rabobank UA^	€ 250.000	2,50 %	26.05.2026	317.734	0,00 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	\$ 300.000	2,38 %	01.02.2022	299.653	0,00 %
Koninklijke Philips NV	\$ 275.000	3,75 %	15.03.2022	285.999	0,00 %
NN Group NV^	€ 200.000	4,63 %	08.04.2044	278.313	0,00 %
Heineken NV	\$ 250.000	4,35 %	29.03.2047	273.026	0,00 %
ABN AMRO Bank NV	€ 200.000	2,38 %	23.01.2024	270.310	0,00 %
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 250.000	4,38 %	04.08.2025	263.699	0,00 %
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 250.000	3,95 %	09.11.2022	260.355	0,00 %
TenneT Holding BV	€ 200.000	2,13 %	01.11.2020	254.386	0,00 %
ABN AMRO Bank NV^	€ 200.000	2,88 %	30.06.2025	254.183	0,00 %
ING Bank NV	\$ 250.000	2,63 %	05.12.2022	250.460	0,00 %
Unilever Capital Corp.	\$ 250.000	2,10 %	30.07.2020	249.134	0,00 %
TenneT Holding BV	€ 200.000	0,88 %	04.06.2021	246.332	0,00 %
Achmea Bank NV	€ 200.000	1,13 %	25.04.2022	246.224	0,00 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	€ 200.000	0,05 %	10.02.2021	242.396	0,00 %
ING Groep NV	\$ 200.000	3,95 %	29.03.2027	208.418	0,00 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 150.000	4,00 %	11.01.2022	207.560	0,00 %
Heineken NV	\$ 200.000	3,50 %	29.01.2028	202.638	0,00 %
ING Groep NV	\$ 200.000	3,15 %	29.03.2022	201.779	0,00 %
ING Bank NV	\$ 200.000	2,70 %	17.08.2020	201.011	0,00 %
Shell International Finance BV	\$ 200.000	3,63 %	21.08.2042	200.034	0,00 %
Shell International Finance BV	\$ 200.000	1,38 %	10.05.2019	198.067	0,00 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	\$ 200.000	1,25 %	09.09.2019	197.028	0,00 %
Shell International Finance BV	\$ 200.000	1,88 %	10.05.2021	196.832	0,00 %
Shell International Finance BV	\$ 200.000	2,25 %	06.01.2023	196.412	0,00 %
Netherlands Government Bond	€ 100.000	3,75 %	15.01.2042	186.319	0,00 %
Unilever Capital Corp.	\$ 175.000	3,10 %	30.07.2025	176.952	0,00 %
Koninklijke KPN NV	£ 100.000	5,75 %	17.09.2029	173.198	0,00 %
Netherlands Government Bond	€ 100.000	7,50 %	15.01.2023	166.151	0,00 %
Koninklijke KPN NV	£ 100.000	5,00 %	18.11.2026	160.754	0,00 %
ABN AMRO Bank NV	€ 100.000	7,13 %	06.07.2022	153.430	0,00 %
Shell International Finance BV	\$ 150.000	2,13 %	11.05.2020	149.677	0,00 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	€ 100.000	3,25 %	09.03.2027	147.804	0,00 %
TenneT Holding BV	€ 100.000	4,63 %	21.02.2023	146.033	0,00 %
ASR Nederland NV^	€ 100.000	5,13 %	29.09.2045	145.753	0,00 %
ABN AMRO Bank NV	€ 100.000	6,38 %	27.04.2021	142.972	0,00 %
ABN AMRO Bank NV	£ 100.000	2,38 %	07.12.2021	141.373	0,00 %
ING Bank NV	€ 100.000	4,50 %	21.02.2022	140.760	0,00 %
ABN AMRO Bank NV	€ 100.000	4,13 %	28.03.2022	139.365	0,00 %
ABN AMRO Bank NV	€ 100.000	3,50 %	18.01.2022	137.056	0,00 %
Royal Schiphol Group NV	€ 100.000	4,43 %	28.04.2021	136.814	0,00 %
Heineken NV	€ 100.000	2,88 %	04.08.2025	136.813	0,00 %
Shell International Finance BV	€ 100.000	2,50 %	24.03.2026	136.196	0,00 %
Nederlandse Gasunie NV	€ 100.000	3,63 %	13.10.2021	136.164	0,00 %
ABN AMRO Bank NV	€ 100.000	2,50 %	05.09.2023	135.460	0,00 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 100.000	2,38 %	22.05.2023	132.481	0,00 %
Wolters Kluwer NV	€ 100.000	2,50 %	13.05.2024	131.978	0,00 %
Alliander NV	€ 100.000	2,25 %	14.11.2022	131.742	0,00 %
ING Groep NV^	€ 100.000	3,00 %	11.04.2028	131.393	0,00 %
ING Bank NV^	€ 100.000	3,63 %	25.02.2026	131.211	0,00 %
ING Bank NV	€ 100.000	2,00 %	28.08.2020	127.213	0,00 %
Akzo Nobel NV	€ 100.000	1,75 %	07.11.2024	126.761	0,00 %
Shell International Finance BV	€ 100.000	1,63 %	24.03.2021	126.213	0,00 %
ABN AMRO Bank NV	€ 100.000	4,75 %	11.01.2019	126.154	0,00 %
Heineken NV	€ 100.000	1,50 %	07.12.2024	125.641	0,00 %
Shell International Finance BV	€ 100.000	1,00 %	06.04.2022	124.351	0,00 %
JAB Holdings BV	€ 100.000	1,63 %	30.04.2025	124.345	0,00 %
ING Bank NV	€ 100.000	0,75 %	24.11.2020	122.436	0,00 %
LeasePlan Corp.NV	€ 100.000	1,00 %	08.04.2020	122.402	0,00 %
ABN AMRO Bank NV	€ 100.000	1,00 %	16.04.2025	122.275	0,00 %
ING Bank NV	€ 100.000	0,70 %	16.04.2020	122.041	0,00 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 100.000	0,38 %	14.10.2019	121.905	0,00 %
F van Lanschot Bankiers NV	€ 100.000	0,28 %	28.04.2022	120.750	0,00 %
Enexis Holding NV	€ 100.000	0,88 %	28.04.2026	119.491	0,00 %
Shell International Finance BV	\$ 100.000	4,38 %	11.05.2045	112.405	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens	
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 100.000	3,88 %	08.02.2022	105.024	0,00 %	
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 100.000	4,75 %	15.01.2020	104.760	0,00 %	
Bank Nederlandse Gemeenten NV	\$ 100.000	2,63 %	28.04.2021	101.016	0,00 %	
Unilever Capital Corp.	\$ 100.000	2,00 %	28.07.2026	92.245	0,00 %	
Rabobank Capital Funding Trust IV^	£ 50.000	5,56 %	31.12.2166	72.277	0,00 %	
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 50.000	3,88 %	26.05.2023	72.225	0,00 %	
TenneT Holding BV	€ 50.000	4,50 %	09.02.2022	70.580	0,00 %	
Cooperatieve Rabobank UA	€ 50.000	4,38 %	07.06.2021	68.820	0,00 %	
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 50.000	2,25 %	30.08.2022	66.320	0,00 %	
Alliander NV	€ 50.000	4,50 %	17.12.2019	65.508	0,00 %	
ING Bank NV	€ 50.000	4,00 %	17.01.2020	65.357	0,00 %	
Cooperatieve Rabobank UA	€ 50.000	5,88 %	20.05.2019	64.868	0,00 %	
ING Bank NV	€ 50.000	4,75 %	27.05.2019	64.374	0,00 %	
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 50.000	1,50 %	15.04.2020	62.651	0,00 %	
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 50.000	1,00 %	19.03.2019	61.113	0,00 %	
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 50.000	4,50 %	11.01.2021	53.006	0,00 %	
				175.085.454	1,84 %	
Neuseeland 0,15 % (2016: 0,18 %)						
New Zealand Government Bond	NZ(\$)	3.000.000	2,75 %	15.04.2025	2.161.744	0,02 %
New Zealand Government Bond	NZ(\$)	2.500.000	4,50 %	15.04.2027	2.032.892	0,02 %
New Zealand Government Bond	NZ(\$)	2.000.000	5,00 %	15.03.2019	1.475.814	0,02 %
New Zealand Government Bond	NZ(\$)	1.800.000	6,00 %	15.05.2021	1.443.938	0,02 %
BNZ International Funding Ltd.	€	1.000.000	0,13 %	17.06.2021	1.201.904	0,01 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	\$	900.000	2,88 %	25.01.2022	900.344	0,01 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	€	737.000	0,40 %	01.03.2022	885.338	0,01 %
New Zealand Government Bond	NZ(\$)	1.000.000	3,50 %	14.04.2033	747.355	0,01 %
BNZ International Funding Ltd.	€	625.000	0,50 %	13.05.2023	744.046	0,01 %
New Zealand Government Bond	NZ(\$)	1.000.000	3,00 %	15.04.2020	728.565	0,01 %
BNZ International Funding Ltd.	\$	500.000	2,65 %	03.11.2022	493.175	0,01 %
BNZ International Funding Ltd.	\$	250.000	2,40 %	21.02.2020	249.692	0,00 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	€	200.000	0,63 %	27.01.2022	244.605	0,00 %
BNZ International Funding Ltd.	\$	250.000	2,10 %	14.09.2021	243.163	0,00 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	\$	200.000	3,45 %	17.07.2027	201.384	0,00 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	\$	200.000	2,75 %	03.02.2021	200.558	0,00 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	\$	200.000	2,20 %	17.07.2020	198.537	0,00 %
Westpac Securities NZ Ltd.	€	100.000	0,88 %	24.06.2019	122.138	0,00 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	\$	100.000	2,85 %	06.08.2020	100.899	0,00 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	\$	100.000	2,13 %	28.07.2021	97.772	0,00 %
				14.473.863	0,15 %	
Nigeria 0,00 % (2016: 0,00 %)						
Africa Finance Corp.	\$	200.000	3,88 %	13.04.2024	201.326	0,00 %
				201.326	0,00 %	
Norwegen 0,49 % (2016: 0,51 %)						
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	€	3.800.000	1,50 %	20.01.2020	4.727.273	0,05 %
Norway Government Bond	NOK	27.000.000	4,50 %	22.05.2019	3.484.723	0,04 %
Statoil A.S.A	€	2.800.000	1,63 %	09.11.2036	3.279.441	0,04 %
Kommunalbanken A.S.	AUD	3.000.000	4,25 %	16.07.2025	2.524.447	0,03 %
Norway Government Bond	NOK(kr)	18.000.000	3,00 %	14.03.2024	2.422.570	0,03 %
Norway Government Bond	NOK(kr)	15.000.000	3,75 %	25.05.2021	2.007.922	0,02 %
Statoil A.S.A	\$	1.400.000	7,25 %	23.09.2027	1.850.534	0,02 %
Statoil A.S.A	\$	1.855.000	2,65 %	15.01.2024	1.845.309	0,02 %
DNB Boligkreditt A.S.	€	1.200.000	0,05 %	11.01.2022	1.440.708	0,02 %
DNB Boligkreditt A.S.	€	1.000.000	3,88 %	16.06.2021	1.362.973	0,02 %
DNB Boligkreditt A.S.	€	1.050.000	1,88 %	18.06.2019	1.301.935	0,02 %
DNB Boligkreditt A.S.	NOK(kr)	9.000.000	5,00 %	25.05.2021	1.229.960	0,02 %
Norway Government Bond	NOK(kr)	10.000.000	1,50 %	19.02.2026	1.222.498	0,02 %
Kommunalbanken A.S.	€	1.000.000	0,63 %	20.04.2026	1.197.238	0,01 %
Statoil A.S.A	€	1.000.000	0,75 %	09.11.2026	1.184.918	0,01 %
DNB Bank A.S.A^	€	950.000	1,25 %	01.03.2027	1.159.457	0,01 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	€	1.000.000	0,25 %	30.08.2026	1.157.727	0,01 %
Santander Consumer Bank A.S.	€	900.000	0,38 %	17.02.2020	1.086.691	0,01 %
Norway Government Bond	NOK(kr)	8.000.000	2,00 %	24.05.2023	1.019.357	0,01 %
Eika Boligkreditt A.S.	€	800.000	0,38 %	20.04.2023	965.770	0,01 %
Statoil A.S.A	\$	700.000	5,10 %	17.08.2040	847.602	0,01 %
Norway Government Bond	NOK(kr)	6.000.000	1,75 %	17.02.2027	743.834	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
SR-Boligkreditt A.S.	€ 500.000	0,75 %	18.01.2023	615.087	0,01 %
DNB Boligkreditt A.S.	€ 500.000	0,38 %	07.10.2019	607.712	0,01 %
DNB Bank A.S.A	\$ 500.000	2,38 %	02.06.2021	496.428	0,01 %
Kommunalbanken A.S.	\$ 450.000	1,50 %	31.08.2021	437.109	0,01 %
DNB Boligkreditt A.S.	\$ 300.000	2,50 %	28.03.2022	298.146	0,01 %
Kommunalbanken A.S.	\$ 250.000	2,25 %	25.01.2022	248.798	0,00 %
Kommunalbanken A.S.	\$ 250.000	1,50 %	22.10.2019	247.257	0,00 %
Statoil A.S.A	€ 200.000	0,88 %	17.02.2023	245.477	0,00 %
SpareBank 1 SMN	€ 200.000	1,50 %	20.05.2019	245.297	0,00 %
DNB Boligkreditt A.S.	€ 200.000	0,38 %	20.10.2020	243.691	0,00 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	€ 200.000	0,38 %	09.03.2023	241.735	0,00 %
Sparebanken Vest Boligkreditt A.S.	€ 200.000	0,13 %	02.03.2021	241.455	0,00 %
Sparebanken Vest Boligkreditt A.S.	€ 200.000	0,25 %	29.04.2022	241.309	0,00 %
Statoil A.S.A	£ 100.000	6,88 %	11.03.2031	203.458	0,00 %
DNB Bank A.S.A	\$ 200.000	2,13 %	02.10.2020	198.286	0,00 %
Kommunalbanken A.S.	\$ 200.000	1,50 %	09.09.2019	198.046	0,00 %
Kommunalbanken A.S.	\$ 200.000	1,63 %	15.01.2020	198.004	0,00 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	\$ 200.000	1,75 %	15.11.2019	197.844	0,00 %
Kommunalbanken A.S.	\$ 200.000	2,13 %	11.02.2025	193.686	0,00 %
Statoil A.S.A	£ 100.000	4,25 %	10.04.2041	171.294	0,00 %
Kommunalbanken A.S.	£ 100.000	0,88 %	08.12.2020	135.546	0,00 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	€ 100.000	4,00 %	03.02.2021	135.209	0,00 %
Telenor A.S.A	€ 100.000	2,50 %	22.05.2025	134.000	0,00 %
Statkraft A.S.	€ 100.000	2,50 %	28.11.2022	131.777	0,00 %
DNB Boligkreditt A.S.	€ 100.000	1,88 %	21.11.2022	129.979	0,00 %
Statoil A.S.A	€ 100.000	2,00 %	10.09.2020	126.461	0,00 %
Eika Boligkreditt A.S.	€ 100.000	1,50 %	12.03.2021	125.968	0,00 %
Statkraft A.S.	€ 100.000	1,50 %	21.09.2023	125.677	0,00 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	€ 100.000	2,75 %	01.02.2019	124.127	0,00 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	€ 100.000	0,75 %	05.09.2022	123.338	0,00 %
Sparebanken Vest Boligkreditt A.S.	€ 100.000	1,25 %	16.01.2019	122.077	0,00 %
Sparebanken Soer Boligkreditt A.S.	€ 100.000	0,25 %	22.03.2021	121.077	0,00 %
Statkraft A.S.	€ 100.000	1,50 %	26.03.2030	120.198	0,00 %
Statoil A.S.A	€ 100.000	1,63 %	17.02.2035	119.147	0,00 %
Statoil A.S.A	\$ 100.000	3,70 %	01.03.2024	104.974	0,00 %
Statoil A.S.A	\$ 100.000	2,90 %	08.11.2020	101.397	0,00 %
Kommunalbanken A.S.	\$ 100.000	1,75 %	28.05.2019	99.637	0,00 %
Statoil A.S.A	\$ 100.000	2,45 %	17.01.2023	99.180	0,00 %
DNB Boligkreditt A.S.	\$ 100.000	2,00 %	28.05.2020	99.142	0,00 %
Statoil A.S.A	€ 50.000	5,63 %	11.03.2021	70.555	0,00 %
Telenor A.S.A	€ 50.000	4,13 %	26.03.2020	65.527	0,00 %
				46.247.999	0,49 %
Oman 0,02 % (2016: 0,01 %)					
Oman Government International Bond	\$ 500.000	4,75 %	15.06.2026	485.625	0,01 %
Oman Government International Bond	\$ 400.000	5,38 %	08.03.2027	403.512	0,01 %
Oman Government International Bond	\$ 400.000	6,50 %	08.03.2047	400.836	0,00 %
Oman Government International Bond	\$ 300.000	4,75 %	15.06.2026	291.375	0,00 %
				1.581.348	0,02 %
Panama 0,08 % (2016: 0,05 %)					
Panama Government International Bond	\$ 2.400.000	3,75 %	16.03.2025	2.492.640	0,03 %
Panama Government International Bond	\$ 1.000.000	4,30 %	29.04.2053	1.041.600	0,01 %
Panama Government International Bond	\$ 500.000	9,38 %	01.04.2029	757.000	0,01 %
Panama Government International Bond	\$ 675.000	5,20 %	30.01.2020	711.281	0,01 %
Panama Government International Bond	\$ 650.000	4,00 %	22.09.2024	689.715	0,01 %
Global Bank Corp.	\$ 500.000	4,50 %	20.10.2021	510.031	0,01 %
Panama Government International Bond	\$ 300.000	6,70 %	26.01.2036	401.088	0,00 %
Panama Government International Bond	\$ 275.000	7,13 %	29.01.2026	350.350	0,00 %
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	\$ 300.000	5,63 %	18.05.2036	323.332	0,00 %
Panama Government International Bond	\$ 200.000	3,88 %	17.03.2028	209.167	0,00 %
Panama Government International Bond	\$ 200.000	3,88 %	17.03.2028	209.103	0,00 %
Global Bank Corp.	\$ 200.000	5,13 %	30.10.2019	207.500	0,00 %
				7.902.807	0,08 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Peru 0,04 % (2016: 0,06 %)					
Corp. Financiera de Desarrollo SA	\$ 600.000	4,75 %	15.07.2025	637.872	0,01 %
Peruanischen Regierung International Bond	\$ 363.000	8,75 %	21.11.2033	573.807	0,01 %
Petroleos del Peru SA	\$ 500.000	5,63 %	19.06.2047	525.332	0,01 %
Corp. Financiera de Desarrollo SA	\$ 450.000	3,25 %	15.07.2019	452.250	0,01 %
Peruanischen Regierung International Bond	€ 200.000	3,75 %	01.03.2030	292.395	0,00 %
Fondo MIVIVIENDA SA	\$ 250.000	3,38 %	02.04.2019	251.250	0,00 %
BBVA Banco Continental SA^	\$ 200.000	5,25 %	22.09.2029	215.251	0,00 %
Banco de Credito del Peru^	\$ 150.000	6,13 %	24.04.2027	164.467	0,00 %
Peruanischen Regierung International Bond	\$ 100.000	6,55 %	14.03.2037	135.644	0,00 %
Peruanischen Regierung International Bond	\$ 100.000	5,63 %	18.11.2050	129.049	0,00 %
				3.377.317	0,04 %
Philippinen 0,04 % (2016: 0,05 %)					
Philippine Government International Bond	\$ 1.000.000	4,20 %	21.01.2024	1.086.250	0,01 %
Philippine Government International Bond	\$ 450.000	5,50 %	30.03.2026	531.562	0,01 %
Philippine Government International Bond	\$ 500.000	3,95 %	20.01.2040	515.625	0,01 %
Philippine Government International Bond	\$ 325.000	7,75 %	14.01.2031	463.125	0,01 %
Philippine Government International Bond	\$ 200.000	8,38 %	17.06.2019	218.500	0,00 %
Philippine Government International Bond	\$ 200.000	6,50 %	20.01.2020	217.750	0,00 %
Philippine Government International Bond	\$ 100.000	9,50 %	02.02.2030	158.000	0,00 %
Philippine Government International Bond	\$ 100.000	10,63 %	16.03.2025	151.125	0,00 %
Philippine Government International Bond	\$ 100.000	6,38 %	23.10.2034	133.625	0,00 %
Philippine Government International Bond	\$ 125.000	4,00 %	15.01.2021	131.120	0,00 %
				3.606.682	0,04 %
Polen 0,39 % (2016: 0,39 %)					
Republic of Poland Government Bond	zł 21.000.000	2,25 %	25.04.2022	5.985.496	0,06 %
Republic of Poland Government Bond	zł 20.000.000	1,75 %	25.07.2021	5.652.124	0,06 %
Republic of Poland Government Bond	zł 8.000.000	2,50 %	25.07.2026	2.177.507	0,02 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 1.600.000	4,20 %	15.04.2020	2.107.106	0,02 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 1.500.000	0,50 %	20.12.2021	1.832.721	0,02 %
Republic of Poland Government Bond	zł 6.500.000	2,50 %	25.07.2027	1.750.077	0,02 %
Republic of Poland Government Bond	zł 6.000.000	1,50 %	25.04.2020	1.710.832	0,02 %
Republic of Poland Government Bond	zł 5.500.000	4,00 %	25.10.2023	1.686.183	0,02 %
Republic of Poland Government International Bond	\$ 1.500.000	5,13 %	21.04.2021	1.623.750	0,02 %
Republic of Poland Government Bond	zł 5.000.000	2,50 %	25.01.2023	1.426.557	0,02 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 1.000.000	4,68 %	15.10.2019	1.307.738	0,01 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 1.000.000	2,38 %	18.01.2036	1.296.864	0,01 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 1.000.000	1,50 %	19.01.2026	1.269.546	0,01 %
Republic of Poland Government Bond	zł 3.500.000	5,75 %	23.09.2022	1.149.778	0,01 %
Republic of Poland Government International Bond	\$ 800.000	6,38 %	15.07.2019	848.168	0,01 %
Republic of Poland Government Bond	zł 2.500.000	3,25 %	25.07.2019	737.107	0,01 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 500.000	4,50 %	18.01.2022	709.072	0,01 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 400.000	5,25 %	20.01.2025	629.219	0,01 %
Republic of Poland Government Bond	zł 2.000.000	5,50 %	25.10.2019	613.560	0,01 %
Republic of Poland Government Bond	zł 2.000.000	3,25 %	25.07.2025	580.408	0,01 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 400.000	1,63 %	15.01.2019	489.231	0,01 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 300.000	3,00 %	15.01.2024	414.816	0,00 %
Republic of Poland Government International Bond	\$ 150.000	3,25 %	06.04.2026	153.188	0,00 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 100.000	3,38 %	09.07.2024	141.443	0,00 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 100.000	4,00 %	23.03.2021	135.630	0,00 %
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA Via PKO Finance AB	€ 100.000	2,32 %	23.01.2019	122.936	0,00 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 100.000	0,88 %	10.05.2027	118.733	0,00 %
Republic of Poland Government International Bond	\$ 100.000	3,00 %	17.03.2023	101.625	0,00 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 50.000	3,75 %	19.01.2023	70.574	0,00 %
				36.841.989	0,39 %
Portugal 0,38 % (2016: 0,03 %)					
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT	€ 5.000.000	4,13 %	14.04.2027	7.116.409	0,08 %
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT	€ 5.000.000	2,88 %	15.10.2025	6.615.327	0,07 %
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT	€ 3.000.000	3,85 %	15.04.2021	4.046.385	0,04 %
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT	€ 2.000.000	4,10 %	15.02.2045	2.807.024	0,03 %
EDP Finance BV	€ 2.200.000	2,00 %	22.04.2025	2.790.573	0,03 %
EDP Finance BV	€ 2.200.000	1,13 %	12.02.2024	2.669.335	0,03 %
Banco Comercial Portugues SA	€ 1.700.000	0,75 %	31.05.2022	2.064.878	0,02 %
Banco Santander Totta SA	€ 1.500.000	0,88 %	25.04.2024	1.826.525	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeitsdatum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
EDP Finance BV	\$ 1.275.000	3,63 %	15.07.2024	1.285.376	0,02 %
Banco Santander Totta SA	€ 1.000.000	1,25 %	26.09.2027	1.215.990	0,01 %
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT	€ 800.000	4,10 %	15.04.2037	1.143.190	0,01 %
Caixa Economica Montepio Geral	€ 700.000	0,88 %	17.10.2022	844.604	0,01 %
EDP Finance BV	€ 400.000	2,38 %	23.03.2023	522.024	0,01 %
Brisa Concessao Rodoviaria SA	€ 200.000	2,00 %	22.03.2023	255.179	0,00 %
Brisa Concessao Rodoviaria SA	€ 200.000	2,38 %	10.05.2027	254.787	0,00 %
EDP Finance BV	£ 100.000	8,63 %	04.01.2024	182.389	0,00 %
EDP Finance BV	€ 100.000	4,13 %	29.06.2020	132.227	0,00 %
EDP Finance BV	€ 100.000	2,63 %	18.01.2022	130.946	0,00 %
Brisa Concessao Rodoviaria SA	€ 100.000	1,88 %	30.04.2025	124.668	0,00 %
Caixa Geral de Depositos SA	€ 100.000	3,00 %	15.01.2019	123.937	0,00 %
Banco Santander Totta SA	€ 100.000	0,88 %	27.10.2020	122.816	0,00 %
Caixa Geral de Depositos SA	€ 100.000	1,00 %	27.01.2022	122.312	0,00 %
				36.396.901	0,38 %
Katar 0,07 % (2016: 0,08 %)					
Qatar Government International Bond	\$ 1.075.000	3,25 %	02.06.2026	1.046.953	0,01 %
Qatar Government International Bond	\$ 1.000.000	2,38 %	02.06.2021	981.090	0,01 %
Qatar Government International Bond	\$ 500.000	6,40 %	20.01.2040	640.780	0,01 %
Qatari Diar Finance Co.	\$ 600.000	5,00 %	21.07.2020	628.500	0,01 %
Ooredoo International Finance Ltd.	\$ 500.000	3,75 %	22.06.2026	495.895	0,01 %
Qatar Government International Bond	\$ 400.000	5,75 %	20.01.2042	480.042	0,01 %
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co., Ltd. III	\$ 300.000	5,84 %	30.09.2027	337.275	0,01 %
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co., Ltd. II	\$ 325.700	5,30 %	30.09.2020	335.926	0,00 %
Qatar Government International Bond	\$ 200.000	9,75 %	15.06.2030	310.768	0,00 %
Ooredoo International Finance Ltd.	\$ 250.000	7,88 %	10.06.2019	268.513	0,00 %
Qatar Government International Bond	\$ 250.000	4,63 %	02.06.2046	259.352	0,00 %
Qatar Government International Bond	\$ 200.000	4,50 %	20.01.2022	210.768	0,00 %
Ooredoo International Finance Ltd.	\$ 200.000	4,75 %	16.02.2021	210.072	0,00 %
Ooredoo International Finance Ltd.	\$ 200.000	3,88 %	31.01.2028	198.663	0,00 %
SoQ Sukuk A QSC	\$ 200.000	3,24 %	18.01.2023	198.500	0,00 %
CBQ Finance Ltd.	\$ 200.000	3,25 %	13.06.2021	197.000	0,00 %
				6.800.097	0,07 %
Rumänien 0,06 % (2016: 0,06 %)					
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	€ 2.500.000	2,38 %	19.04.2027	3.075.768	0,03 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	€ 700.000	6,75 %	07.02.2022	802.375	0,01 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	€ 585.000	2,75 %	29.10.2025	762.248	0,01 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	€ 500.000	2,88 %	26.05.2028	635.644	0,01 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	\$ 400.000	4,38 %	22.08.2023	429.000	0,00 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	\$ 150.000	6,75 %	07.02.2022	171.938	0,00 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	€ 100.000	4,88 %	07.11.2019	131.217	0,00 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	\$ 100.000	6,13 %	22.01.2044	129.000	0,00 %
				6.137.190	0,06 %
Russische Föderation 0,24 % (2016: 0,09 %)					
Russian Federal Bond-OFZ	py 585.000.000	6,70 %	15.05.2019	10.163.456	0,11 %
Russian Federal Bond-OFZ	py 225.000.000	7,60 %	20.07.2022	4.021.538	0,04 %
Russian Federal Bond-OFZ	py 150.000.000	7,00 %	25.01.2023	2.606.509	0,03 %
Russian Federal Bond-OFZ	py 135.000.000	7,05 %	19.01.2028	2.279.732	0,02 %
Russian Federal Bond-OFZ	py 110.000.000	7,00 %	16.08.2023	1.910.676	0,02 %
Russian Federal Bond-OFZ	py 50.000.000	8,15 %	03.02.2027	914.519	0,01 %
MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC	\$ 800.000	6,63 %	14.10.2022	901.000	0,01 %
Russian Federal Bond-OFZ	py 14.285.000	6,80 %	11.12.2019	248.400	0,00 %
Lukoil International Finance BV	\$ 200.000	6,13 %	09.11.2020	215.750	0,00 %
				23.261.580	0,24 %
Saudi-Arabien 0,09 % (2016: 0,07 %)					
Saudi Government International Bond	\$ 2.150.000	3,25 %	26.10.2026	2.108.754	0,02 %
Saudi Government International Bond	\$ 1.875.000	2,38 %	26.10.2021	1.828.747	0,02 %
KSA Sukuk Ltd.	\$ 1.100.000	2,89 %	20.04.2022	1.093.342	0,01 %
Saudi Government International Bond	\$ 850.000	4,63 %	04.10.2047	869.669	0,01 %
Saudi Government International Bond	\$ 650.000	3,63 %	04.03.2028	644.150	0,01 %
KSA Sukuk Ltd.	\$ 600.000	2,89 %	20.04.2022	596.214	0,01 %
Saudi Government International Bond	\$ 600.000	3,63 %	04.03.2028	595.098	0,01 %
Saudi Electricity Global Sukuk Co. 3	\$ 400.000	4,00 %	08.04.2024	412.180	0,00 %
SABIC Capital I BV	€ 200.000	2,75 %	20.11.2020	256.856	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Saudi Electricity Global Sukuk Co.	\$ 200.000	4,21 %	03.04.2022	208.516	0,00 %
Saudi Electricity Global Sukuk Co. 3	\$ 200.000	4,00 %	08.04.2024	206.004	0,00 %
				8.819.530	0,09 %
Singapur 0,21 % (2016: 0,21 %)					
Housing & Development Board	SG(\$)	3,10 %	24.07.2024	2.376.871	0,03 %
Singapore Government Bond	SG(\$)	2,00 %	01.07.2020	2.262.796	0,02 %
Singapore Government Bond	SG(\$)	3,38 %	01.09.2033	2.120.660	0,02 %
Singapore Government Bond	SG(\$)	2,38 %	01.06.2025	1.923.077	0,02 %
Singapore Government Bond	SG(\$)	2,25 %	01.06.2021	1.524.244	0,02 %
Singapore Government Bond	SG(\$)	1,63 %	01.10.2019	1.495.959	0,02 %
Singapore Government Bond	SG(\$)	2,88 %	01.09.2030	1.439.838	0,02 %
Singapore Government Bond	SG(\$)	3,00 %	01.09.2024	1.197.059	0,01 %
Singapore Government Bond	SG(\$)	2,25 %	01.08.2036	1.102.260	0,01 %
Singapore Government Bond	SG(\$)	2,75 %	01.07.2023	783.822	0,01 %
United Overseas Bank Ltd.^	\$	3,50 %	16.09.2026	503.770	0,01 %
Singapore Government Bond	SG(\$)	3,25 %	01.09.2020	486.709	0,01 %
Singapore Government Bond	SG(\$)	2,75 %	01.04.2042	472.314	0,01 %
DBS Group Holdings Ltd.	\$	2,25 %	16.07.2019	398.578	0,00 %
Temasek Financial I Ltd.	\$	5,38 %	23.11.2039	368.415	0,00 %
Flex Ltd.	\$	5,00 %	15.02.2023	353.717	0,00 %
Temasek Financial I Ltd.	\$	4,30 %	25.10.2019	258.745	0,00 %
Temasek Financial I Ltd.	\$	2,38 %	23.01.2023	246.998	0,00 %
DBS Bank Ltd.	€	0,38 %	23.01.2024	239.032	0,00 %
SP PowerAssets Ltd.	\$	3,25 %	24.11.2025	203.565	0,00 %
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.^	\$	3,15 %	11.03.2023	150.187	0,00 %
				19.908.616	0,21 %
Slowakei 0,07 % (2016: 0,06 %)					
Slovakia Government Bond	€	0,63 %	22.05.2026	1.805.703	0,02 %
Slovakia Government Bond	€	3,00 %	28.02.2023	1.393.419	0,02 %
Slovakia Government Bond	€	1,88 %	09.03.2037	877.442	0,01 %
Slovakia Government Bond	€	0,00 %	13.11.2023	474.256	0,01 %
Slovakia Government Bond	€	4,00 %	27.04.2020	396.704	0,01 %
Slovakia Government Bond	€	4,35 %	14.10.2025	396.099	0,00 %
Slovakia Government Bond	€	2,00 %	17.10.2047	375.301	0,00 %
Slovakia Government Bond	€	1,63 %	21.01.2031	251.509	0,00 %
Slovakia Government International Bond	\$	4,38 %	21.05.2022	215.750	0,00 %
SPP Infrastructure Financing BV	€	2,63 %	12.02.2025	192.386	0,00 %
Slovakia Government International Bond	€	4,00 %	26.03.2021	137.666	0,00 %
Granvia A.S.	€	4,78 %	30.09.2039	135.817	0,00 %
Slovakia Government Bond	€	1,38 %	21.01.2027	127.049	0,00 %
				6.779.101	0,07 %
Slowenien 0,07 % (2016: 0,07 %)					
Staatsanleihe von Slowenien	€	1,75 %	03.11.2040	3.216.625	0,04 %
Slovenia Government International Bond	\$	5,50 %	26.10.2022	728.329	0,01 %
Staatsanleihe von Slowenien	€	1,25 %	22.03.2027	621.089	0,01 %
Slovenia Government International Bond	\$	5,25 %	18.02.2024	457.213	0,01 %
Staatsanleihe von Slowenien	€	2,25 %	25.03.2022	283.295	0,00 %
Slovenia Government International Bond	\$	4,13 %	18.02.2019	255.626	0,00 %
Staatsanleihe von Slowenien	€	1,50 %	25.03.2035	236.921	0,00 %
Staatsanleihe von Slowenien	€	4,63 %	09.09.2024	233.921	0,00 %
Slovenia Government International Bond	\$	5,85 %	10.05.2023	231.087	0,00 %
Staatsanleihe von Slowenien	€	5,13 %	30.03.2026	82.165	0,00 %
Staatsanleihe von Slowenien	€	4,13 %	26.01.2020	65.595	0,00 %
				6.411.866	0,07 %
Südafrika 0,00 % (2016: 0,24 %)					
Myriad International Holdings BV	\$	5,50 %	21.07.2025	217.990	0,00 %
Africa Finance Corp.	\$	4,38 %	29.04.2020	205.250	0,00 %
				423.240	0,00 %
Südkorea 1,57 % (2016: 1,54 %)					
Korea Treasury Bond	₩	2,13 %	10.06.2027	10.420.425	0,11 %
Korea National Housing Bond I	₩	1,75 %	30.04.2022	9.079.511	0,10 %
Korea Treasury Bond	₩	1,50 %	10.12.2026	8.168.021	0,09 %
Korea Treasury Bond	₩	1,50 %	10.09.2036	7.999.514	0,09 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeitsdatum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Korea Treasury Bond	₩ 8.000.000.000	1,75 %	10.06.2020	7.400.876	0,08 %
Korea Treasury Bond	₩ 6.000.000.000	4,25 %	10.06.2021	5.966.361	0,06 %
Korea Treasury Bond	₩ 5.800.000.000	5,00 %	10.06.2020	5.777.765	0,06 %
Korea Treasury Bond	₩ 6.000.000.000	1,75 %	10.12.2018	5.598.481	0,06 %
Korea Treasury Bond	₩ 5.300.000.000	2,63 %	10.09.2035	5.065.380	0,05 %
Korea Treasury Bond	₩ 5.500.000.000	2,25 %	10.06.2025	5.063.257	0,05 %
Korea Treasury Bond	₩ 5.300.000.000	2,00 %	10.03.2021	4.913.130	0,05 %
Korea Treasury Bond	₩ 5.000.000.000	1,50 %	10.06.2019	4.636.533	0,05 %
Korea Treasury Bond	₩ 5.000.000.000	2,25 %	10.12.2025	4.596.021	0,05 %
Korea Treasury Bond	₩ 5.000.000.000	1,88 %	10.03.2022	4.583.583	0,05 %
Korea Treasury Bond	₩ 4.300.000.000	3,00 %	10.09.2024	4.154.763	0,05 %
Korea Treasury Bond	₩ 3.100.000.000	3,00 %	10.12.2042	3.174.463	0,03 %
Korea Treasury Bond	₩ 3.400.000.000	2,00 %	10.03.2020	3.166.607	0,03 %
Korea Treasury Bond	₩ 2.850.000.000	3,75 %	10.12.2033	3.110.311	0,03 %
Korea Treasury Bond	₩ 3.100.000.000	2,25 %	10.09.2037	2.805.382	0,03 %
Korea Treasury Bond	₩ 3.000.000.000	1,38 %	10.09.2021	2.711.389	0,03 %
Korea Treasury Bond	₩ 2.950.000.000	2,00 %	10.03.2046	2.504.379	0,03 %
Korea Treasury Bond	₩ 1.800.000.000	4,00 %	10.12.2031	1.983.079	0,02 %
Koreanische Entwicklungsbank	\$ 2.000.000	2,63 %	27.02.2022	1.970.538	0,02 %
Korea Treasury Bond	₩ 2.000.000.000	3,13 %	10.03.2019	1.893.821	0,02 %
Korea Monetary Stabilization Bond	₩ 2.000.000.000	1,49 %	02.02.2018	1.868.100	0,02 %
Korea Treasury Bond	₩ 1.900.000.000	2,75 %	10.09.2019	1.795.021	0,02 %
Korea Treasury Bond	₩ 2.000.000.000	1,88 %	10.06.2026	1.784.029	0,02 %
Korea Treasury Bond	₩ 1.800.000.000	3,00 %	10.03.2023	1.729.865	0,02 %
Korea Treasury Bond	₩ 1.200.000.000	5,50 %	10.03.2028	1.425.159	0,02 %
Korea National Housing Bond I	₩ 1.500.000.000	2,50 %	31.12.2017	1.401.149	0,02 %
NongHyup Bank	\$ 1.400.000	1,88 %	12.09.2021	1.342.730	0,02 %
Korea Housing Finance Corp.	\$ 1.250.000	2,50 %	15.11.2020	1.231.100	0,01 %
Korea Treasury Bond	₩ 1.000.000.000	4,75 %	10.12.2030	1.168.662	0,01 %
Korea International Bond	\$ 1.100.000	2,75 %	19.01.2027	1.074.551	0,01 %
Korea Treasury Bond	₩ 1.000.000.000	3,75 %	10.06.2022	988.192	0,01 %
Korea Treasury Bond	₩ 1.000.000.000	3,38 %	10.09.2023	980.391	0,01 %
Korea Treasury Bond	₩ 700.000.000	5,50 %	10.12.2029	857.557	0,01 %
Koreanische Entwicklungsbank	\$ 750.000	4,63 %	16.11.2021	794.338	0,01 %
KT Corp.	\$ 800.000	2,50 %	18.07.2026	746.754	0,01 %
Korea Gas Corp.	\$ 700.000	1,88 %	18.07.2021	674.073	0,01 %
Korea Treasury Bond	₩ 550.000.000	2,75 %	10.03.2018	514.916	0,01 %
KT Corp.	\$ 500.000	2,63 %	22.04.2019	498.725	0,01 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 500.000	3,25 %	10.11.2025	498.459	0,01 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 500.000	3,00 %	01.11.2022	497.657	0,01 %
Koreanische Entwicklungsbank	\$ 400.000	3,00 %	17.03.2019	402.100	0,01 %
Korea National Oil Corp.	\$ 400.000	2,88 %	27.03.2022	395.588	0,01 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 400.000	2,50 %	01.11.2020	395.582	0,01 %
Hyundai Capital Services, Inc.	\$ 400.000	3,00 %	06.03.2022	394.658	0,01 %
Korea Gas Corp.	\$ 400.000	2,75 %	20.07.2022	394.190	0,01 %
Shinhan Bank Co., Ltd.	\$ 400.000	2,25 %	15.04.2020	393.515	0,01 %
Woori Bank	\$ 350.000	2,63 %	20.07.2021	344.788	0,00 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 300.000	5,13 %	29.06.2020	316.145	0,00 %
Koreanische Entwicklungsbank	\$ 300.000	3,75 %	22.01.2024	310.608	0,00 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 300.000	2,38 %	12.08.2019	298.514	0,00 %
Hyundai Capital Services, Inc.	\$ 300.000	2,63 %	29.09.2020	296.946	0,00 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 300.000	2,88 %	21.01.2025	292.692	0,00 %
Korea National Oil Corp.	\$ 300.000	2,13 %	14.04.2021	291.259	0,00 %
Korea National Oil Corp.	\$ 300.000	2,00 %	24.10.2021	288.177	0,00 %
GS Caltex Corp.	\$ 250.000	3,00 %	18.06.2019	250.037	0,00 %
NongHyup Bank	\$ 250.000	2,75 %	29.09.2019	249.678	0,00 %
KEB Hana Bank	\$ 250.000	2,50 %	12.06.2019	249.110	0,00 %
Korea Housing Finance Corp.	\$ 250.000	1,63 %	15.09.2018	248.222	0,00 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 250.000	1,88 %	21.10.2021	239.751	0,00 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 200.000	5,00 %	11.04.2022	215.297	0,00 %
POSCO	\$ 200.000	5,25 %	14.04.2021	213.082	0,00 %
Korea International Bond	\$ 200.000	3,88 %	11.09.2023	209.142	0,00 %
KEB Hana Bank	\$ 200.000	4,38 %	30.09.2024	207.322	0,00 %
Korea Gas Corp.	\$ 200.000	3,50 %	21.07.2025	201.925	0,00 %
Minera y Metalurgica del Boleo SA de CV	\$ 200.000	2,88 %	07.05.2019	200.038	0,00 %
Korea National Oil Corp.	\$ 200.000	2,75 %	23.01.2019	199.889	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeitsdatum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Export-Import Bank von Korea	\$ 200.000	1,75 %	27.02.2018	199.842	0,00 %
Hyundai Capital America	\$ 200.000	3,00 %	18.03.2021	199.435	0,00 %
Export-Import Bank von Korea	CAD 250.000	2,71 %	05.12.2019	198.901	0,00 %
Korea Hydro & Nuclear Power Co., Ltd.	\$ 200.000	2,38 %	28.10.2019	198.257	0,00 %
Korea Resources Corp.	\$ 200.000	3,00 %	24.04.2022	197.803	0,00 %
Korea East-West Power Co., Ltd.	\$ 200.000	2,50 %	02.06.2020	197.496	0,00 %
Korea Gas Corp.	\$ 200.000	3,13 %	20.07.2027	196.115	0,00 %
Korea East-West Power Co., Ltd.	\$ 200.000	2,63 %	19.06.2022	195.541	0,00 %
Doosan Heavy Industries & Construction Co., Ltd.	\$ 200.000	2,13 %	27.04.2020	195.506	0,00 %
Hyundai Capital America	\$ 150.000	2,55 %	03.04.2020	148.671	0,00 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 150.000	1,50 %	21.10.2019	146.849	0,00 %
Korea International Bond	€ 100.000	2,13 %	10.06.2024	128.824	0,00 %
Export-Import Bank von Korea	€ 100.000	2,00 %	30.04.2020	124.935	0,00 %
Korea International Bond	\$ 100.000	7,13 %	16.04.2019	105.887	0,00 %
Woori Bank	\$ 100.000	4,75 %	30.04.2024	104.693	0,00 %
Hyundai Capital America	\$ 100.000	3,10 %	05.04.2022	99.712	0,00 %
Hyundai Capital Services, Inc.	\$ 100.000	2,88 %	16.03.2021	99.189	0,00 %
Hyundai Capital America	\$ 100.000	2,45 %	15.06.2021	97.849	0,00 %
KT Corp.	\$ 100.000	2,63 %	07.08.2022	97.540	0,00 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 50.000	2,63 %	30.12.2020	49.511	0,00 %
Hyundai Capital America	\$ 50.000	2,00 %	01.07.2019	49.394	0,00 %
				149.145.223	1,57 %
Spanien 2,90 % (2016: 2,77 %)					
Spain Government Bond	€ 12.200.000	2,75 %	30.04.2019	15.251.147	0,16 %
Spain Government Bond	€ 10.000.000	0,45 %	31.10.2022	12.045.957	0,13 %
Spain Government Bond	€ 9.400.000	1,95 %	30.04.2026	11.905.207	0,13 %
Spain Government Bond	€ 9.500.000	1,40 %	31.01.2020	11.794.888	0,13 %
Spain Government Bond	€ 9.700.000	0,40 %	30.04.2022	11.725.218	0,12 %
Spain Government Bond	€ 7.000.000	3,80 %	30.04.2024	10.000.806	0,11 %
Spain Government Bond	€ 6.350.000	4,40 %	31.10.2023	9.278.464	0,10 %
Spain Government Bond	€ 7.100.000	2,35 %	30.07.2033	8.662.091	0,09 %
Spain Government Bond	€ 5.200.000	5,15 %	31.10.2028	8.364.052	0,09 %
Spain Government Bond	€ 6.300.000	4,30 %	31.10.2019	8.204.240	0,09 %
Spain Government Bond	€ 5.050.000	5,40 %	31.01.2023	7.576.642	0,08 %
Spain Government Bond	€ 6.000.000	1,15 %	30.07.2020	7.442.285	0,08 %
Spain Government Bond	€ 5.200.000	2,75 %	31.10.2024	7.038.417	0,08 %
Spain Government Bond	€ 4.900.000	2,15 %	31.10.2025	6.332.887	0,07 %
Spain Government Bond	€ 3.800.000	5,90 %	30.07.2026	6.273.327	0,07 %
Spain Government Bond	€ 3.500.000	6,00 %	31.01.2029	6.014.947	0,06 %
Spain Government Bond	€ 3.550.000	4,80 %	31.01.2024	5.310.245	0,06 %
Spain Government Bond	€ 4.300.000	2,90 %	31.10.2046	5.232.754	0,06 %
Spain Government Bond	€ 4.000.000	1,60 %	30.04.2025	5.022.255	0,05 %
Spain Government Bond	€ 4.000.000	0,25 %	31.01.2019	4.834.454	0,05 %
Spain Government Bond	€ 2.750.000	5,15 %	31.10.2044	4.788.903	0,05 %
Spain Government Bond	€ 3.700.000	3,45 %	30.07.2066	4.758.197	0,05 %
Spain Government Bond	€ 3.100.000	5,85 %	31.01.2022	4.579.272	0,05 %
Spain Government Bond	€ 2.700.000	4,90 %	30.07.2040	4.542.817	0,05 %
Spain Government Bond	€ 3.700.000	1,95 %	30.07.2030	4.453.072	0,05 %
Spain Government Bond	€ 3.300.000	0,75 %	30.07.2021	4.057.541	0,04 %
Spain Government Bond	€ 2.250.000	5,75 %	30.07.2032	3.965.705	0,04 %
Spain Government Bond	€ 2.500.000	4,65 %	30.07.2025	3.797.386	0,04 %
Spain Government Bond	€ 3.033.000	1,50 %	30.04.2027	3.658.976	0,04 %
Autonomous Community of Madrid Spain	€ 3.000.000	0,75 %	30.04.2022	3.656.137	0,04 %
Spain Government Bond	€ 1.900.000	4,20 %	31.01.2037	2.925.557	0,03 %
Spain Government Bond	€ 1.700.000	4,00 %	30.04.2020	2.239.780	0,02 %
Spain Government Bond	€ 1.600.000	4,60 %	30.07.2019	2.070.594	0,02 %
Bankia SA	€ 1.500.000	1,13 %	05.08.2022	1.867.016	0,02 %
Spain Government Bond	€ 1.300.000	4,85 %	31.10.2020	1.778.757	0,02 %
Spain Government Bond	€ 1.000.000	5,75 %	30.07.2032	1.762.535	0,02 %
Programa Cedula TDA Fondo de Titulizacion de Activos	€ 1.100.000	4,25 %	10.04.2031	1.704.482	0,02 %
FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico	€ 1.400.000	0,03 %	17.06.2020	1.683.484	0,02 %
Banco Santander SA	€ 1.200.000	1,38 %	09.02.2022	1.485.048	0,02 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 1.100.000	1,46 %	13.04.2026	1.340.292	0,02 %
Iberdrola International BV	€ 1.000.000	3,50 %	01.02.2021	1.324.723	0,01 %
Gas Natural Fenosa Finance BV	€ 1.100.000	1,38 %	19.01.2027	1.322.448	0,01 %
Banco Santander SA	€ 1.000.000	0,75 %	09.09.2022	1.231.396	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
CaixaBank SA	€ 1.000.000	0,63 %	12.11.2020	1.222.988	0,01 %
NorteGas Energia Distribucion SAU	€ 1.000.000	2,07 %	28.09.2027	1.219.252	0,01 %
Santander Consumer Finance SA	€ 1.000.000	0,88 %	24.01.2022	1.217.259	0,01 %
Iberdrola Finanzas SA	€ 1.000.000	1,62 %	29.11.2029	1.198.421	0,01 %
Inmobiliaria Colonial Socimi SA	€ 1.000.000	1,63 %	28.11.2025	1.188.413	0,01 %
Autonomous Community of Madrid Spain	€ 900.000	2,15 %	30.04.2027	1.131.421	0,01 %
Autonomous Community of Madrid Spain	€ 900.000	2,88 %	06.04.2019	1.121.664	0,01 %
Santander Issuances SAU	€ 800.000	3,13 %	19.01.2027	1.047.381	0,01 %
CaixaBank SA	€ 800.000	1,25 %	11.01.2027	984.011	0,01 %
Autonomous Community of Madrid Spain	€ 769.000	1,00 %	30.09.2024	928.356	0,01 %
Bankia SA	€ 700.000	1,00 %	14.03.2023	866.606	0,01 %
Autonomous Community of Madrid Spain	€ 700.000	0,73 %	19.05.2021	854.969	0,01 %
Repsol International Finance BV	€ 700.000	0,50 %	23.05.2022	843.833	0,01 %
Telefonica Emisiones SAU	\$ 725.000	5,21 %	08.03.2047	820.807	0,01 %
Telefonica Emisiones SAU	\$ 750.000	4,57 %	27.04.2023	806.879	0,01 %
Iberdrola Finanzas SA	£ 500.000	6,00 %	01.07.2022	805.383	0,01 %
Programa Cedula TDA Fondo de Titulacion de Activos	€ 500.000	4,25 %	28.03.2027	761.165	0,01 %
Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	€ 600.000	0,88 %	06.04.2023	719.471	0,01 %
Prosegur Cash SA	€ 600.000	1,38 %	04.02.2026	706.320	0,01 %
Ayt Cedula Cajas Global	€ 500.000	4,00 %	24.03.2021	675.840	0,01 %
Bankia SA	€ 500.000	5,00 %	28.06.2019	646.689	0,01 %
Banco Santander SA	€ 500.000	1,50 %	25.01.2026	641.135	0,01 %
Kutxabank SA	€ 500.000	1,25 %	22.09.2025	621.328	0,01 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	€ 500.000	1,00 %	20.01.2021	614.913	0,01 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	€ 500.000	0,63 %	17.05.2021	613.328	0,01 %
FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico	€ 500.000	0,85 %	17.09.2019	611.088	0,01 %
Bankinter SA	€ 500.000	1,00 %	05.02.2025	610.065	0,01 %
NorteGas Energia Distribucion SAU	€ 500.000	0,92 %	28.09.2022	603.639	0,01 %
Santander Consumer Finance SA	€ 500.000	0,50 %	04.10.2021	602.839	0,01 %
Iberdrola International BV	€ 500.000	1,13 %	21.04.2026	601.585	0,01 %
Iberdrola International BV^	€ 500.000	1,88 %	22.05.2166	601.534	0,01 %
Inmobiliaria Colonial Socimi SA	€ 500.000	1,45 %	28.10.2024	598.272	0,01 %
Banco Popular Espanol SA	€ 400.000	1,00 %	03.03.2022	494.855	0,01 %
Banco de Sabadell SA	€ 400.000	0,88 %	12.11.2021	492.963	0,01 %
Ayt Cedula Cajas Global	€ 300.000	4,75 %	25.05.2027	472.487	0,01 %
Cedula TDA 6 Fondo de Titulacion de Activos	€ 300.000	3,88 %	23.05.2025	440.623	0,01 %
Telefonica Emisiones SAU	\$ 400.000	4,10 %	08.03.2027	412.294	0,01 %
Autonomous Community of Madrid Spain	€ 300.000	1,83 %	30.04.2025	379.284	0,01 %
Adif-Alta Velocidad	€ 300.000	1,88 %	28.01.2025	377.066	0,01 %
Banco Popular Espanol SA	€ 300.000	3,75 %	22.01.2019	375.265	0,01 %
Cajamar Caja Rural SCC	€ 300.000	1,25 %	26.01.2022	369.953	0,00 %
Bankia SA	€ 300.000	0,88 %	21.01.2021	369.022	0,00 %
Enagas Financiaciones SAU	€ 300.000	1,00 %	25.03.2023	368.848	0,00 %
Iberdrola International BV	€ 300.000	0,38 %	15.09.2025	343.327	0,00 %
Telefonica Emisiones SAU	\$ 250.000	7,05 %	20.06.2036	334.378	0,00 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	\$ 300.000	3,00 %	20.10.2020	302.653	0,00 %
CaixaBank SA	€ 200.000	3,88 %	17.02.2025	293.332	0,00 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 200.000	3,99 %	23.01.2023	280.418	0,00 %
Telefonica Emisiones SAU	\$ 250.000	5,46 %	16.02.2021	270.402	0,00 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	€ 200.000	2,25 %	12.06.2024	268.261	0,00 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 200.000	2,93 %	17.10.2029	266.606	0,00 %
Iberdrola Finanzas SA	£ 150.000	7,38 %	29.01.2024	265.834	0,00 %
AyT Cedula Cajas IX FTA	€ 200.000	4,00 %	31.03.2020	262.017	0,00 %
Iberdrola International BV	€ 200.000	1,75 %	17.09.2023	255.096	0,00 %
Adif-Alta Velocidad	€ 200.000	1,88 %	22.09.2022	253.803	0,00 %
CaixaBank SA	€ 200.000	1,00 %	08.02.2023	247.758	0,00 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	€ 200.000	0,75 %	20.01.2022	246.709	0,00 %
Banco Popular Espanol SA	€ 200.000	0,88 %	28.09.2021	246.463	0,00 %
Criteria Caixa SAU	€ 200.000	1,63 %	21.04.2022	246.454	0,00 %
Enagas Financiaciones SAU	€ 200.000	1,25 %	06.02.2025	246.452	0,00 %
Cajamar Caja Rural SCC	€ 200.000	1,00 %	22.10.2020	245.430	0,00 %
Gas Natural Fenosa Finance BV	€ 200.000	1,38 %	21.01.2025	245.399	0,00 %
Banco Popular Espanol SA	€ 200.000	0,75 %	29.09.2020	245.217	0,00 %
Banco Popular Espanol SA	€ 200.000	1,00 %	07.04.2025	244.546	0,00 %
Bankinter SA	€ 200.000	0,63 %	09.10.2020	244.411	0,00 %
Banco de Sabadell SA	€ 200.000	0,38 %	10.06.2020	242.809	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Caja Rural de Navarra SCC	€ 200.000	0,50 %	16.03.2022	241.637	0,00 %
Enagas Financiaciones SAU	€ 200.000	1,38 %	05.05.2028	240.829	0,00 %
Gas Natural Fenosa Finance BV	€ 200.000	1,25 %	19.04.2026	240.654	0,00 %
Red Electrica Financiaciones SAU	€ 200.000	1,00 %	21.04.2026	240.041	0,00 %
Abertis Infraestructuras SA	€ 200.000	1,38 %	20.05.2026	239.247	0,00 %
Santander Issuances SAU	\$ 200.000	5,18 %	19.11.2025	215.308	0,00 %
Telefonica Emisiones SAU	£ 100.000	5,38 %	02.02.2026	163.083	0,00 %
Banco Santander SA	€ 100.000	4,63 %	04.05.2027	160.774	0,00 %
Telefonica Emisiones SAU	£ 100.000	5,29 %	09.12.2022	157.875	0,00 %
Bankia SA	€ 100.000	4,13 %	24.03.2036	154.801	0,00 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	€ 100.000	4,00 %	25.02.2025	149.223	0,00 %
Autonomous Community of Madrid Spain	€ 100.000	4,30 %	15.09.2026	147.909	0,00 %
Instituto de Credito Oficial	€ 100.000	6,00 %	08.03.2021	142.523	0,00 %
FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico	€ 100.000	5,90 %	17.03.2021	141.975	0,00 %
Bankia SA	€ 100.000	4,50 %	26.04.2022	141.842	0,00 %
CaixaBank SA	€ 100.000	2,63 %	21.03.2024	135.972	0,00 %
Programa Cedula TDA Fondo de Titulizacion de Activos	€ 100.000	4,13 %	10.04.2021	135.952	0,00 %
Gas Natural Fenosa Finance BV	€ 100.000	2,88 %	11.03.2024	134.522	0,00 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	€ 100.000	3,50 %	24.01.2021	133.200	0,00 %
Gas Natural Fenosa Finance BV	€ 100.000	3,50 %	15.04.2021	133.023	0,00 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	€ 100.000	3,50 %	07.10.2020	132.118	0,00 %
Abertis Infraestructuras SA	€ 100.000	2,50 %	27.02.2025	130.671	0,00 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 100.000	4,69 %	11.11.2019	130.640	0,00 %
Red Electrica Financiaciones SAU	€ 100.000	2,13 %	01.07.2023	130.366	0,00 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 100.000	2,24 %	27.05.2022	129.486	0,00 %
Banco Santander SA	€ 100.000	2,00 %	27.11.2034	129.337	0,00 %
CaixaBank SA	€ 100.000	4,63 %	04.06.2019	128.282	0,00 %
Iberdrola International BV	€ 100.000	1,88 %	08.10.2024	128.206	0,00 %
Repsol International Finance BV	€ 100.000	2,63 %	28.05.2020	127.231	0,00 %
Banco Mare Nostrum SA	€ 100.000	3,13 %	21.01.2019	124.274	0,00 %
Criteria Caixa SAU	€ 100.000	2,38 %	09.05.2019	123.534	0,00 %
BBVA Senior Finance SAU	€ 100.000	2,38 %	22.01.2019	123.212	0,00 %
Inmobiliaria Colonial Socimi SA	€ 100.000	1,86 %	05.06.2019	123.060	0,00 %
Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	€ 100.000	1,00 %	28.04.2021	122.430	0,00 %
Banco de Sabadell SA	€ 100.000	0,63 %	03.11.2020	122.212	0,00 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 100.000	0,75 %	13.04.2022	121.662	0,00 %
Autonomous Community of Madrid Spain	€ 50.000	4,13 %	21.05.2024	72.134	0,00 %
Autonomous Community of Madrid Spain	€ 50.000	2,88 %	17.07.2023	67.242	0,00 %
Instituto de Credito Oficial	€ 50.000	4,75 %	30.04.2020	66.809	0,00 %
CaixaBank SA	€ 50.000	3,63 %	18.01.2021	66.595	0,00 %
Autonomous Community of Madrid Spain	€ 50.000	4,69 %	12.03.2020	66.160	0,00 %
Iberdrola Finanzas SA	€ 50.000	4,13 %	23.03.2020	65.491	0,00 %
Instituto de Credito Oficial	€ 50.000	4,38 %	20.05.2019	63.892	0,00 %
				276.387.124	2,90 %
Supranational 2,43 % (2016: 2,49 %)					
European Financial Stability Facility	€ 10.000.000	0,00 %	29.03.2021	12.117.177	0,13 %
European Stability Mechanism	€ 6.100.000	0,13 %	22.04.2024	7.293.507	0,08 %
Europäische Investitionsbank	€ 5.000.000	2,75 %	15.09.2021	6.685.430	0,07 %
Europäische Investitionsbank	€ 5.000.000	0,50 %	15.01.2027	5.987.789	0,06 %
European Financial Stability Facility	€ 4.300.000	1,45 %	05.09.2040	5.253.232	0,06 %
Europäische Investitionsbank	€ 4.000.000	0,25 %	14.10.2024	4.832.019	0,05 %
European Financial Stability Facility	€ 3.800.000	0,75 %	03.05.2027	4.617.879	0,05 %
Europäische Investitionsbank	€ 3.200.000	1,38 %	15.09.2021	4.074.931	0,04 %
Europäische Investitionsbank	€ 3.000.000	1,50 %	15.04.2021	3.821.094	0,04 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 3.600.000	1,88 %	15.03.2019	3.595.669	0,04 %
Europäische Investitionsbank	€ 3.000.000	0,00 %	16.10.2023	3.582.003	0,04 %
Europäische Investitionsbank	\$ 3.600.000	2,00 %	15.03.2021	3.577.939	0,04 %
Europäische Investitionsbank	\$ 3.500.000	2,25 %	15.03.2022	3.488.153	0,04 %
Europäische Investitionsbank	€ 2.500.000	0,25 %	15.10.2020	3.057.096	0,03 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 3.050.000	1,88 %	21.04.2020	3.039.938	0,03 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 3.000.000	1,63 %	09.03.2021	2.948.313	0,03 %
Nordic Investment Bank	£ 2.000.000	0,63 %	02.11.2021	2.681.164	0,03 %
Europäische Union	€ 2.000.000	2,75 %	21.09.2021	2.669.522	0,03 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	£ 2.000.000	0,38 %	15.06.2021	2.666.055	0,03 %
European Financial Stability Facility	€ 2.000.000	2,00 %	28.02.2056	2.629.317	0,03 %
Europäische Investitionsbank	\$ 2.350.000	1,63 %	14.08.2020	2.321.208	0,03 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Inter-American Development Bank	\$ 2.250.000	3,88 %	17.09.2019	2.320.994	0,03 %
International Finance Corp.	AUD 2.750.000	4,25 %	21.08.2023	2.317.412	0,03 %
Europäische Investitionsbank	€ 2.000.000	0,00 %	13.03.2026	2.316.725	0,03 %
Europäische Investitionsbank	€ 1.700.000	1,00 %	14.04.2032	2.042.526	0,02 %
Europäische Investitionsbank	\$ 2.000.000	1,75 %	15.05.2020	1.985.324	0,02 %
Europäische Union	€ 1.600.000	0,63 %	04.11.2023	1.979.679	0,02 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	\$ 1.975.000	1,75 %	14.06.2019	1.968.178	0,02 %
Europäische Investitionsbank	€ 1.500.000	1,75 %	15.09.2045	1.950.674	0,02 %
Europäische Investitionsbank	€ 1.450.000	4,25 %	15.04.2019	1.848.342	0,02 %
European Financial Stability Facility	€ 1.500.000	0,10 %	19.01.2021	1.823.139	0,02 %
African Development Bank	€ 1.500.000	0,25 %	21.11.2024	1.783.404	0,02 %
Europäische Investitionsbank	\$ 1.750.000	1,25 %	15.05.2019	1.732.896	0,02 %
Inter-American Development Bank	\$ 1.750.000	1,63 %	12.05.2020	1.732.591	0,02 %
Europäische Investitionsbank	€ 1.260.000	1,63 %	15.03.2023	1.639.750	0,02 %
Europäische Investitionsbank	€ 1.500.000	0,50 %	13.11.2037	1.600.370	0,02 %
European Financial Stability Facility	€ 1.200.000	2,25 %	05.09.2022	1.598.425	0,02 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	AUD 2.000.000	3,75 %	23.01.2019	1.592.101	0,02 %
European Financial Stability Facility	€ 1.200.000	1,75 %	27.06.2024	1.586.641	0,02 %
Europäische Investitionsbank	AUD 2.000.000	2,50 %	30.04.2020	1.572.303	0,02 %
Europäische Investitionsbank	\$ 1.550.000	1,38 %	15.06.2020	1.522.970	0,02 %
Europäische Investitionsbank	\$ 1.500.000	2,38 %	15.06.2022	1.500.641	0,02 %
Inter-American Development Bank	\$ 1.500.000	2,13 %	18.01.2022	1.491.371	0,02 %
Europäische Investitionsbank	£ 850.000	4,50 %	07.06.2029	1.487.386	0,02 %
Asian Development Bank	\$ 1.500.000	1,63 %	16.03.2021	1.473.957	0,02 %
European Financial Stability Facility	€ 1.200.000	1,25 %	24.05.2033	1.468.534	0,02 %
European Financial Stability Facility	€ 1.200.000	0,13 %	04.11.2019	1.456.373	0,02 %
European Financial Stability Facility	€ 1.150.000	1,50 %	22.01.2020	1.435.879	0,02 %
Nordic Investment Bank	€ 1.200.000	0,13 %	10.06.2024	1.434.568	0,02 %
Asian Development Bank	\$ 1.425.000	1,63 %	05.05.2020	1.410.938	0,02 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	£ 1.000.000	0,63 %	15.12.2023	1.318.396	0,01 %
Europäische Investitionsbank	£ 1.000.000	1,00 %	21.09.2026	1.311.464	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 1.300.000	2,50 %	25.11.2024	1.301.616	0,01 %
European Stability Mechanism	€ 1.050.000	0,88 %	15.10.2019	1.292.095	0,01 %
Asian Development Bank	\$ 1.300.000	2,00 %	16.02.2022	1.286.021	0,01 %
European Financial Stability Facility	€ 1.000.000	1,75 %	29.10.2020	1.271.584	0,01 %
European Financial Stability Facility	€ 760.000	3,88 %	30.03.2032	1.264.708	0,01 %
Inter-American Development Bank	AUD 1.500.000	3,75 %	25.07.2022	1.229.583	0,01 %
European Financial Stability Facility	€ 1.000.000	0,88 %	26.07.2027	1.226.861	0,01 %
European Stability Mechanism	€ 1.000.000	1,13 %	03.05.2032	1.220.587	0,01 %
Europäische Investitionsbank	\$ 1.250.000	1,88 %	10.02.2025	1.196.270	0,01 %
IDB Trust Services Ltd.	\$ 1.200.000	2,11 %	25.09.2019	1.195.464	0,01 %
Europäische Investitionsbank	€ 1.000.000	0,38 %	14.04.2026	1.193.435	0,01 %
Council Of Europe Development Bank	€ 1.000.000	0,38 %	08.06.2026	1.182.852	0,01 %
Inter-American Development Bank	\$ 1.200.000	2,38 %	07.07.2027	1.178.924	0,01 %
European Financial Stability Facility	€ 800.000	2,35 %	29.07.2044	1.158.394	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	€ 1.000.000	0,63 %	12.01.2033	1.114.632	0,01 %
Asian Development Bank	\$ 1.125.000	1,75 %	08.06.2021	1.106.927	0,01 %
Inter-American Development Bank	£ 800.000	1,13 %	17.12.2019	1.092.415	0,01 %
European Stability Mechanism	€ 1.000.000	0,88 %	18.07.2042	1.091.958	0,01 %
Europäische Investitionsbank	€ 700.000	3,00 %	14.10.2033	1.090.230	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	NZ(\$) 1.500.000	3,38 %	25.01.2022	1.088.197	0,01 %
European Financial Stability Facility	€ 800.000	3,38 %	05.07.2021	1.083.541	0,01 %
Asian Development Bank	NZ(\$) 1.500.000	3,50 %	30.05.2024	1.081.719	0,01 %
Asian Development Bank	\$ 1.100.000	1,75 %	13.09.2022	1.067.959	0,01 %
Inter-American Development Bank	\$ 1.100.000	2,00 %	02.06.2026	1.049.237	0,01 %
Corp.Andina de Fomento	\$ 1.000.000	2,00 %	10.05.2019	995.315	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 1.000.000	2,00 %	26.01.2022	989.005	0,01 %
European Financial Stability Facility	€ 800.000	1,25 %	22.01.2019	978.528	0,01 %
Inter-American Development Bank	\$ 1.000.000	1,75 %	14.04.2022	977.901	0,01 %
African Development Bank	\$ 985.000	2,13 %	16.11.2022	970.615	0,01 %
Asian Development Bank	\$ 950.000	1,75 %	10.01.2020	944.333	0,01 %
Europäische Investitionsbank	€ 700.000	2,13 %	15.01.2024	941.441	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 950.000	1,63 %	04.09.2020	938.140	0,01 %
Corp.Andina de Fomento	\$ 898.000	2,20 %	18.07.2020	891.424	0,01 %
Inter-American Development Bank	\$ 900.000	1,00 %	13.05.2019	888.889	0,01 %
Europäische Investitionsbank	€ 700.000	1,38 %	15.11.2019	869.874	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Asian Development Bank	\$ 870.000	2,50 %	02.11.2027	861.402	0,01 %
Europäische Investitionsbank	AUD 1.000.000	5,00 %	22.08.2022	861.228	0,01 %
Corp.Andina de Fomento	\$ 800.000	4,38 %	15.06.2022	850.478	0,01 %
Europäische Investitionsbank	\$ 850.000	1,75 %	17.06.2019	847.048	0,01 %
Europäische Investitionsbank	€ 500.000	4,00 %	15.04.2030	830.401	0,01 %
Europäische Union	€ 600.000	2,75 %	04.04.2022	810.363	0,01 %
African Development Bank	\$ 800.000	1,00 %	15.05.2019	789.126	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 800.000	1,63 %	10.02.2022	780.390	0,01 %
Europäische Investitionsbank	£ 500.000	5,38 %	07.06.2021	779.279	0,01 %
European Financial Stability Facility	€ 600.000	1,80 %	10.07.2048	761.397	0,01 %
Europäische Union	€ 600.000	3,38 %	10.05.2019	758.556	0,01 %
Council Of Europe Development Bank	€ 550.000	1,75 %	24.04.2024	722.884	0,01 %
Europäische Union	€ 600.000	0,75 %	04.04.2031	711.279	0,01 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	\$ 700.000	2,00 %	01.02.2021	695.666	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 700.000	1,38 %	24.05.2021	680.819	0,01 %
Council Of Europe Development Bank	£ 500.000	1,13 %	07.03.2019	680.478	0,01 %
Nordic Investment Bank	£ 500.000	1,00 %	07.03.2019	679.738	0,01 %
Europäische Investitionsbank	€ 450.000	2,63 %	15.03.2035	678.845	0,01 %
Europäische Investitionsbank	\$ 700.000	2,13 %	13.04.2026	677.177	0,01 %
European Financial Stability Facility	€ 500.000	2,13 %	19.02.2024	672.116	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	CAD 800.000	1,88 %	30.05.2019	639.598	0,01 %
Banque Ouest Africaine de Developpement	\$ 600.000	5,50 %	06.05.2021	637.608	0,01 %
European Financial Stability Facility	€ 500.000	1,38 %	07.06.2021	634.227	0,01 %
European Stability Mechanism	\$ 640.000	2,13 %	03.11.2022	632.445	0,01 %
European Stability Mechanism	€ 500.000	1,00 %	23.09.2025	628.017	0,01 %
Corp.Andina de Fomento	CHF 600.000	0,50 %	26.02.2026	623.704	0,01 %
Europäische Investitionsbank	£ 350.000	3,88 %	08.06.2037	622.299	0,01 %
Europäische Investitionsbank	€ 500.000	1,00 %	14.03.2031	608.621	0,01 %
European Stability Mechanism	€ 500.000	0,50 %	02.03.2026	603.422	0,01 %
International Finance Corp.	\$ 600.000	1,75 %	30.03.2020	596.421	0,01 %
Europäische Investitionsbank	€ 400.000	2,75 %	13.09.2030	591.932	0,01 %
Inter-American Development Bank	\$ 600.000	1,13 %	12.09.2019	591.178	0,01 %
European Financial Stability Facility	€ 500.000	1,38 %	31.05.2047	583.744	0,01 %
Europäische Investitionsbank	CHF 500.000	2,38 %	10.07.2020	552.078	0,01 %
Europäische Investitionsbank	€ 350.000	2,75 %	15.03.2040	549.314	0,01 %
Europäische Investitionsbank	£ 400.000	1,50 %	01.02.2019	546.810	0,01 %
European Financial Stability Facility	€ 400.000	1,63 %	17.07.2020	504.628	0,01 %
Europäische Investitionsbank	\$ 500.000	2,50 %	15.10.2024	501.231	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 400.000	7,63 %	19.01.2023	498.632	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 500.000	1,38 %	20.09.2021	484.527	0,01 %
African Development Bank	\$ 475.000	1,88 %	16.03.2020	473.386	0,01 %
Europäische Investitionsbank	£ 200.000	4,63 %	12.10.2054	459.751	0,01 %
African Development Bank	€ 400.000	0,13 %	07.10.2026	456.640	0,01 %
European Stability Mechanism	€ 370.000	0,10 %	03.11.2020	450.577	0,01 %
Inter-American Development Bank	AUD 500.000	4,75 %	27.08.2024	434.975	0,01 %
Council Of Europe Development Bank	AUD 500.000	6,00 %	08.10.2020	427.360	0,01 %
Europäische Investitionsbank	CHF 400.000	2,50 %	08.02.2019	425.244	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 400.000	1,38 %	30.03.2020	394.171	0,00 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 395.000	2,13 %	13.12.2021	393.234	0,00 %
Europäische Investitionsbank	CAD 500.000	1,13 %	18.02.2020	392.007	0,00 %
Europäische Investitionsbank	£ 200.000	6,00 %	07.12.2028	389.000	0,00 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	AUD 500.000	3,00 %	19.10.2026	388.191	0,00 %
Council Of Europe Development Bank	\$ 390.000	1,50 %	17.05.2019	387.669	0,00 %
Europäische Investitionsbank	\$ 400.000	1,38 %	15.09.2021	387.156	0,00 %
Europäische Investitionsbank	€ 250.000	3,50 %	15.04.2027	384.608	0,00 %
International Finance Corp.	\$ 396.000	1,13 %	20.07.2021	381.356	0,00 %
Entwicklungsbank des Europarates	\$ 370.000	1,63 %	10.03.2020	366.393	0,00 %
International Finance Corp.	NZ(\$) 500.000	3,63 %	20.05.2020	364.941	0,00 %
EUROFIMA	€ 300.000	0,25 %	25.04.2023	358.914	0,00 %
Europäische Investitionsbank	€ 250.000	3,00 %	28.09.2022	344.831	0,00 %
Asian Development Bank	\$ 350.000	1,88 %	18.02.2022	342.825	0,00 %
Inter-American Development Bank	\$ 350.000	2,13 %	15.01.2025	342.023	0,00 %
Asian Development Bank	AUD 400.000	6,25 %	05.03.2020	339.198	0,00 %
Nordic Investment Bank	\$ 350.000	1,25 %	02.08.2021	338.270	0,00 %
Europäische Investitionsbank	\$ 340.000	1,63 %	16.03.2020	336.733	0,00 %
European Financial Stability Facility	€ 250.000	1,88 %	23.05.2023	329.661	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	€ 250.000	3,88 %	20.05.2019	318.454	0,00 %
Europäische Investitionsbank	€ 250.000	1,50 %	15.07.2020	314.976	0,00 %
Europäische Investitionsbank	\$ 300.000	3,25 %	29.01.2024	312.943	0,00 %
Asian Development Bank	\$ 300.000	1,88 %	12.04.2019	299.613	0,00 %
Inter-American Development Bank	\$ 300.000	1,75 %	15.10.2019	298.569	0,00 %
Inter-American Development Bank	\$ 300.000	1,88 %	15.03.2021	297.009	0,00 %
Europäische Investitionsbank	\$ 300.000	2,00 %	15.12.2022	294.296	0,00 %
Europäische Investitionsbank	€ 200.000	2,75 %	15.09.2025	284.309	0,00 %
Europäische Investitionsbank	£ 200.000	2,25 %	07.03.2020	279.808	0,00 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	£ 200.000	1,38 %	15.12.2020	275.424	0,00 %
Corp.Andina de Fomento	\$ 250.000	8,13 %	04.06.2019	269.655	0,00 %
European Stability Mechanism	€ 200.000	1,85 %	01.12.2055	262.093	0,00 %
Europäische Investitionsbank	AUD 300.000	4,75 %	07.08.2024	259.965	0,00 %
European Stability Mechanism	€ 200.000	1,38 %	04.03.2021	253.451	0,00 %
African Development Bank	\$ 250.000	2,38 %	23.09.2021	251.073	0,00 %
European Financial Stability Facility	€ 150.000	3,38 %	03.04.2037	247.794	0,00 %
European Financial Stability Facility	€ 200.000	0,50 %	20.01.2023	246.439	0,00 %
Europäische Investitionsbank	\$ 250.000	2,38 %	24.05.2027	245.040	0,00 %
Europäische Union	€ 200.000	0,25 %	04.07.2020	244.103	0,00 %
Asian Development Bank	\$ 250.000	2,00 %	22.01.2025	242.118	0,00 %
International Finance Corp.	\$ 250.000	2,13 %	07.04.2026	241.882	0,00 %
Europäische Investitionsbank	€ 200.000	0,00 %	15.01.2019	241.502	0,00 %
Europäische Investitionsbank	AUD 300.000	3,25 %	30.05.2018	235.955	0,00 %
European Financial Stability Facility	€ 150.000	3,00 %	04.09.2034	231.538	0,00 %
European Financial Stability Facility	€ 200.000	1,20 %	17.02.2045	225.910	0,00 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 220.000	1,38 %	22.04.2019	218.108	0,00 %
Europäische Union	€ 150.000	2,50 %	04.11.2027	213.871	0,00 %
Banque Ouest Africaine de Developpement	\$ 200.000	5,00 %	27.07.2027	208.260	0,00 %
Asian Development Bank	\$ 200.000	2,63 %	12.01.2027	200.809	0,00 %
Corp.Andina de Fomento	\$ 200.000	2,75 %	06.01.2023	198.199	0,00 %
African Development Bank	\$ 200.000	1,38 %	12.02.2020	197.300	0,00 %
Nordic Investment Bank	\$ 200.000	1,63 %	20.11.2020	197.027	0,00 %
Nordic Investment Bank	\$ 200.000	1,50 %	29.09.2020	196.773	0,00 %
Entwicklungsbank des Europarates	\$ 200.000	1,63 %	16.03.2021	196.284	0,00 %
Asian Development Bank	\$ 200.000	1,88 %	10.08.2022	195.408	0,00 %
Europäische Investitionsbank	CAD 250.000	1,13 %	16.09.2021	192.806	0,00 %
Asian Development Bank	\$ 200.000	2,00 %	24.04.2026	192.034	0,00 %
Europäische Investitionsbank	€ 150.000	2,50 %	15.03.2019	186.670	0,00 %
Europäische Investitionsbank	€ 100.000	3,63 %	14.03.2042	180.579	0,00 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	AUD 200.000	5,00 %	07.03.2022	171.328	0,00 %
Europäische Union	€ 100.000	3,38 %	04.04.2038	169.422	0,00 %
Inter-American Development Bank	CAD 200.000	1,88 %	20.03.2020	159.175	0,00 %
Europäische Investitionsbank	\$ 160.000	1,63 %	15.12.2020	157.616	0,00 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 150.000	2,13 %	01.11.2020	150.023	0,00 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	\$ 150.000	1,50 %	02.11.2021	145.736	0,00 %
African Development Bank	\$ 150.000	1,25 %	26.07.2021	144.795	0,00 %
Europäische Investitionsbank	£ 100.000	2,50 %	31.10.2022	144.501	0,00 %
European Financial Stability Facility	€ 100.000	3,50 %	04.02.2022	138.290	0,00 %
Council Of Europe Development Bank	£ 100.000	1,25 %	23.12.2019	136.742	0,00 %
Europäische Investitionsbank	\$ 100.000	4,88 %	15.02.2036	130.935	0,00 %
Council Of Europe Development Bank	€ 100.000	0,75 %	09.06.2025	123.142	0,00 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	\$ 125.000	0,88 %	22.07.2019	122.423	0,00 %
Asian Development Bank	\$ 110.000	2,38 %	10.08.2027	108.050	0,00 %
Europäische Investitionsbank	\$ 100.000	4,00 %	16.02.2021	105.399	0,00 %
Europäische Investitionsbank	\$ 100.000	2,88 %	15.09.2020	101.893	0,00 %
Europäische Investitionsbank	\$ 100.000	2,13 %	15.03.2019	99.961	0,00 %
Europäische Investitionsbank	\$ 100.000	1,88 %	15.03.2019	99.879	0,00 %
Europäische Investitionsbank	\$ 100.000	1,88 %	15.10.2019	99.754	0,00 %
International Finance Corp.	\$ 100.000	1,75 %	16.09.2019	99.544	0,00 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	\$ 100.000	1,75 %	26.11.2019	99.401	0,00 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	\$ 100.000	1,50 %	16.03.2020	98.793	0,00 %
Asian Development Bank	CAD 50.000	1,38 %	11.06.2020	39.272	0,00 %
Council Of Europe Development Bank	\$ 30.000	1,75 %	14.11.2019	29.823	0,00 %
				231.266.224	2,43 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Schweden 0,88 % (2016: 0,80 %)					
Swedbank Hypotek AB	SEK(kr) 48.000.000	1,00 %	16.12.2020	5.996.931	0,06 %
Sweden Government Bond	SEK(kr) 30.200.000	5,00 %	01.12.2020	4.273.185	0,05 %
Swedbank Hypotek AB	SEK(kr) 34.000.000	1,00 %	15.06.2022	4.211.004	0,05 %
Sweden Government Bond	SEK(kr) 26.000.000	1,00 %	12.11.2026	3.300.554	0,04 %
Kommuninvest I Sverige AB	SEK(kr) 25.000.000	0,75 %	22.02.2023	3.072.278	0,03 %
Sweden Government Bond	SEK(kr) 22.000.000	1,50 %	13.11.2023	2.894.902	0,03 %
Stadshypotek AB	€ 2.000.000	0,63 %	10.11.2021	2.456.969	0,03 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	SEK(kr) 19.000.000	1,50 %	15.12.2021	2.405.875	0,03 %
Sveriges Sakerställda Obligationer AB	SEK(kr) 19.000.000	1,00 %	17.03.2021	2.369.949	0,03 %
Nordea Hypotek AB	SEK(kr) 17.000.000	1,00 %	08.04.2022	2.107.539	0,02 %
Nordea Hypotek AB	SEK(kr) 13.000.000	2,25 %	19.06.2019	1.644.988	0,02 %
Sweden Government International Bond	\$ 1.585.000	1,50 %	25.07.2019	1.573.282	0,02 %
Swedbank AB	£ 1.000.000	1,25 %	29.12.2021	1.353.683	0,02 %
Svensk Exportkredit AB	£ 1.000.000	0,63 %	07.12.2020	1.344.696	0,01 %
Akelius Residential Property AB	€ 1.128.000	1,13 %	14.03.2024	1.337.181	0,01 %
Lansforsakringar Hypotek AB	SEK(kr) 10.000.000	3,25 %	16.09.2020	1.326.920	0,01 %
Nordea Hypotek AB	SEK(kr) 10.000.000	3,25 %	17.06.2020	1.318.711	0,01 %
Sweden Government International Bond	\$ 1.300.000	1,63 %	06.04.2020	1.288.737	0,01 %
Telia Co. AB^	€ 1.000.000	3,00 %	04.04.2078	1.268.645	0,01 %
Stadshypotek AB	SEK(kr) 10.000.000	1,50 %	15.12.2021	1.266.250	0,01 %
Stadshypotek AB	SEK(kr) 10.000.000	1,50 %	01.06.2023	1.251.746	0,01 %
Sweden Government International Bond	\$ 1.255.000	1,88 %	02.11.2020	1.245.412	0,01 %
Lansforsakringar Hypotek AB	SEK(kr) 10.000.000	1,25 %	20.09.2023	1.232.541	0,01 %
Fastighets AB Balder	€ 1.000.000	1,88 %	14.03.2025	1.222.010	0,01 %
Nordea Bank AB	€ 1.000.000	1,13 %	27.09.2027	1.210.495	0,01 %
Svenska Handelsbanken AB	€ 1.000.000	0,25 %	28.02.2022	1.200.291	0,01 %
Sweden Government Bond	SEK(kr) 8.000.000	2,50 %	12.05.2025	1.128.659	0,01 %
Swedbank AB	\$ 1.050.000	2,80 %	14.03.2022	1.054.338	0,01 %
Stadshypotek AB	\$ 1.050.000	1,75 %	09.04.2020	1.035.634	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB^	€ 833.000	1,38 %	31.10.2028	1.006.262	0,01 %
Sweden Government Bond	SEK(kr) 7.000.000	3,50 %	01.06.2022	991.527	0,01 %
Danske Hypotek AB	SEK(kr) 8.000.000	1,00 %	21.12.2022	985.366	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	\$ 1.000.000	1,88 %	13.09.2021	975.133	0,01 %
Sweden Government Bond	SEK(kr) 5.500.000	3,50 %	30.03.2039	921.756	0,01 %
Sweden Government International Bond	\$ 800.000	1,13 %	15.03.2019	792.026	0,01 %
Svenska Handelsbanken AB	€ 600.000	2,25 %	27.08.2020	763.336	0,01 %
Svensk Exportkredit AB	\$ 765.000	2,00 %	30.08.2022	749.785	0,01 %
Kommuninvest I Sverige AB	\$ 700.000	1,13 %	17.09.2019	688.631	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	€ 571.000	0,30 %	17.02.2022	687.725	0,01 %
Stadshypotek AB	SEK(kr) 5.000.000	4,25 %	17.06.2020	672.715	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	€ 500.000	1,50 %	25.02.2020	622.869	0,01 %
Essity AB	€ 500.000	0,50 %	05.03.2020	605.448	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	€ 500.000	0,15 %	11.02.2021	605.079	0,01 %
Swedbank Hypotek AB	€ 500.000	0,15 %	10.02.2021	605.038	0,01 %
Securitas AB	€ 500.000	1,13 %	20.02.2024	603.125	0,01 %
Nordea Bank AB	\$ 600.000	2,50 %	17.09.2020	600.005	0,01 %
Svensk Exportkredit AB	\$ 600.000	1,75 %	28.08.2020	592.544	0,01 %
Stadshypotek AB	€ 500.000	0,13 %	05.10.2026	571.158	0,01 %
Sweden Government Bond	SEK(kr) 4.000.000	2,25 %	01.06.2032	560.195	0,01 %
Svensk Exportkredit AB	\$ 550.000	1,13 %	28.08.2019	541.128	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	\$ 500.000	2,63 %	15.03.2021	501.983	0,01 %
SKF AB	€ 400.000	1,63 %	02.12.2022	500.213	0,01 %
Atlas Copco AB	€ 370.000	0,63 %	30.08.2026	430.169	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	\$ 425.000	2,45 %	27.05.2020	425.597	0,01 %
Svenska Handelsbanken AB	\$ 425.000	1,50 %	06.09.2019	419.764	0,01 %
Svenska Handelsbanken AB	\$ 425.000	1,88 %	07.09.2021	415.062	0,01 %
Kommuninvest I Sverige AB	£ 300.000	1,13 %	06.09.2019	408.613	0,01 %
Kommuninvest I Sverige AB	\$ 400.000	2,00 %	12.11.2019	398.988	0,01 %
Nordea Bank AB^	€ 300.000	1,88 %	10.11.2025	374.073	0,00 %
Svenska Handelsbanken AB	€ 300.000	1,13 %	14.12.2022	373.322	0,00 %
Sweden Government International Bond	€ 300.000	0,05 %	12.02.2020	363.642	0,00 %
SBAB Bank AB	€ 300.000	0,50 %	11.05.2021	363.158	0,00 %
Stadshypotek AB	€ 300.000	0,38 %	22.02.2023	362.941	0,00 %
Swedbank AB	\$ 350.000	2,65 %	10.03.2021	350.901	0,00 %
Telia Co. AB	€ 300.000	1,63 %	23.02.2035	331.315	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Lansforsakringar Hypotek AB	€ 250.000	0,25 %	12.04.2023	299.584	0,00 %
Nordea Bank AB	\$ 300.000	1,63 %	30.09.2019	296.695	0,00 %
Svenska Handelsbanken AB	\$ 250.000	2,45 %	30.03.2021	249.727	0,00 %
Svensk Exportkredit AB	\$ 250.000	1,88 %	17.06.2019	249.435	0,00 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	\$ 250.000	2,30 %	11.03.2020	249.419	0,00 %
Alfa Laval Treasury International AB	€ 200.000	1,38 %	12.09.2022	248.758	0,00 %
Nordea Bank AB	€ 200.000	1,13 %	12.02.2025	247.561	0,00 %
Svenska Handelsbanken AB	\$ 250.000	1,95 %	08.09.2020	247.228	0,00 %
Kommuninvest I Sverige AB	\$ 250.000	1,63 %	01.09.2020	246.564	0,00 %
Svenska Handelsbanken AB^	€ 200.000	2,66 %	15.01.2024	246.211	0,00 %
Sveriges Sakerställda Obligationer AB	€ 200.000	0,25 %	20.01.2021	242.707	0,00 %
Vattenfall AB	£ 100.000	6,88 %	15.04.2039	218.985	0,00 %
Nordea Bank AB	\$ 200.000	4,88 %	13.05.2021	212.262	0,00 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	\$ 200.000	2,63 %	17.11.2020	200.802	0,00 %
Svenska Handelsbanken AB	\$ 200.000	2,25 %	17.06.2019	200.276	0,00 %
Nordea Bank AB	£ 100.000	2,38 %	02.06.2022	141.822	0,00 %
Telia Co. AB	€ 100.000	3,63 %	14.02.2024	140.332	0,00 %
Svenska Handelsbanken AB	€ 100.000	4,38 %	20.10.2021	139.241	0,00 %
Swedbank AB	£ 100.000	1,63 %	15.04.2019	136.553	0,00 %
Securitas AB	€ 100.000	2,63 %	22.02.2021	128.516	0,00 %
Stadshypotek AB	€ 100.000	1,63 %	30.10.2020	126.108	0,00 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	€ 100.000	1,88 %	14.11.2019	124.635	0,00 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	€ 100.000	0,75 %	16.06.2022	123.521	0,00 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	€ 100.000	0,63 %	30.01.2023	122.658	0,00 %
Sweden Government International Bond	€ 100.000	0,75 %	02.05.2019	122.047	0,00 %
Swedbank Hypotek AB	€ 100.000	0,38 %	11.03.2022	121.648	0,00 %
Svenska Handelsbanken AB	\$ 100.000	5,13 %	30.03.2020	106.001	0,00 %
Svensk Exportkredit AB	\$ 100.000	1,75 %	10.03.2021	98.395	0,00 %
Vattenfall AB	€ 50.000	6,25 %	17.03.2021	71.656	0,00 %
Investor AB	€ 50.000	4,88 %	18.11.2021	71.026	0,00 %
Telia Co. AB	€ 50.000	4,75 %	16.11.2021	70.680	0,00 %
Nordea Bank AB	€ 50.000	4,00 %	29.06.2020	66.020	0,00 %
Svensk Exportkredit AB	\$ 50.000	1,75 %	18.05.2020	49.506	0,00 %
				84.170.576	0,88 %

Schweiz 1,08 % (2016: 1,05 %)

Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 4.600.000	2,13 %	28.06.2023	5.289.646	0,06 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 4.300.000	1,25 %	28.05.2026	4.965.408	0,05 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 4.000.000	1,25 %	11.06.2024	4.530.734	0,05 %
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	CHF 4.000.000	0,13 %	12.03.2024	4.142.022	0,04 %
Credit Suisse AG	€ 3.200.000	1,75 %	15.01.2021	4.050.200	0,04 %
Glencore Funding LLC	\$ 3.050.000	3,88 %	27.10.2027	2.998.623	0,03 %
Zuercher Kantonalbank	CHF 2.500.000	2,13 %	29.06.2022	2.824.012	0,03 %
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 2.100.000	1,38 %	14.11.2024	2.353.853	0,03 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 1.900.000	2,00 %	28.04.2021	2.121.488	0,02 %
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	CHF 2.000.000	0,63 %	01.11.2030	2.094.613	0,02 %
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 2.000.000	0,50 %	15.06.2029	2.081.272	0,02 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 2.000.000	0,00 %	22.06.2029	2.058.081	0,02 %
Glencore Finance Canada Ltd.	\$ 1.950.000	4,25 %	25.10.2022	2.040.188	0,02 %
UBS Group Funding Switzerland AG	€ 1.595.000	1,50 %	30.11.2024	1.989.326	0,02 %
Credit Suisse Group AG	\$ 1.800.000	4,28 %	09.01.2028	1.871.032	0,02 %
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 1.500.000	0,50 %	17.06.2019	1.562.186	0,02 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 1.200.000	1,50 %	30.04.2042	1.557.106	0,02 %
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 1.400.000	1,00 %	21.05.2024	1.529.297	0,02 %
Credit Suisse Group AG	\$ 1.500.000	3,57 %	09.01.2023	1.522.693	0,02 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	\$ 1.450.000	3,45 %	16.04.2021	1.479.139	0,02 %
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 1.300.000	1,13 %	16.11.2023	1.425.931	0,02 %
UBS Group Funding Switzerland AG	\$ 1.250.000	3,49 %	23.05.2023	1.269.414	0,01 %
Credit Suisse AG	€ 1.000.000	0,75 %	17.09.2021	1.230.412	0,01 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 700.000	2,00 %	25.06.2064	1.176.675	0,01 %
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 1.000.000	1,50 %	15.12.2025	1.137.301	0,01 %
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	CHF 1.000.000	1,38 %	19.03.2027	1.136.008	0,01 %
Nestle Finance International Ltd.	€ 900.000	1,75 %	02.11.2037	1.103.726	0,01 %
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	CHF 1.000.000	3,25 %	10.09.2019	1.091.226	0,01 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 1.000.000	0,50 %	27.05.2030	1.085.993	0,01 %
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	CHF 1.000.000	1,00 %	13.02.2023	1.084.864	0,01 %
LafargeHolcim Sterling Finance Netherlands BV	£ 800.000	3,00 %	12.05.2032	1.072.676	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Roche Holdings, Inc.	\$ 1.050.000	2,88 %	29.09.2021	1.064.900	0,01 %
UBS AG	\$ 1.000.000	2,20 %	08.06.2020	993.919	0,01 %
Novartis Finance SA	€ 800.000	1,13 %	30.09.2027	979.101	0,01 %
Credit Suisse Group AG^	€ 800.000	1,25 %	17.07.2025	969.301	0,01 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 700.000	3,25 %	27.06.2027	949.687	0,01 %
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 800.000	1,50 %	02.08.2033	939.230	0,01 %
UBS Group Funding Switzerland AG^	\$ 900.000	2,86 %	15.08.2023	889.060	0,01 %
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	CHF 800.000	2,63 %	08.02.2019	851.276	0,01 %
UBS Group Funding Switzerland AG	\$ 800.000	4,25 %	23.03.2028	840.502	0,01 %
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 750.000	1,25 %	29.09.2023	827.347	0,01 %
UBS Group Funding Switzerland AG	\$ 750.000	4,13 %	15.04.2026	785.377	0,01 %
ELM BV for Swiss Reinsurance Co., Ltd.^	€ 600.000	2,60 %	01.09.2166	754.619	0,01 %
Canton of Zurich	CHF 600.000	1,25 %	03.12.2032	689.892	0,01 %
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 700.000	0,38 %	08.07.2039	674.500	0,01 %
Credit Suisse Group AG^	£ 500.000	2,13 %	12.09.2025	671.289	0,01 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	\$ 625.000	4,55 %	17.04.2026	666.991	0,01 %
Glencore Finance Canada Ltd.	\$ 625.000	4,95 %	15.11.2021	665.625	0,01 %
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 600.000	1,00 %	25.01.2036	653.628	0,01 %
Credit Suisse AG	€ 500.000	4,75 %	05.08.2019	646.709	0,01 %
Roche Holdings, Inc.	\$ 600.000	3,35 %	30.09.2024	618.844	0,01 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 425.000	4,00 %	08.04.2028	618.681	0,01 %
Credit Suisse AG	€ 500.000	1,38 %	29.11.2019	617.032	0,01 %
Glencore Canada Financial Corp.	£ 400.000	7,38 %	27.05.2020	615.761	0,01 %
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	CHF 600.000	0,50 %	30.03.2034	610.282	0,01 %
Credit Suisse AG	€ 500.000	0,38 %	11.04.2019	604.118	0,01 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 500.000	1,50 %	24.07.2025	582.555	0,01 %
Roche Holdings, Inc.	\$ 575.000	3,00 %	10.11.2025	576.009	0,01 %
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	CHF 500.000	1,63 %	31.10.2024	569.472	0,01 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 350.000	3,50 %	08.04.2033	538.235	0,01 %
Glencore Funding LLC	\$ 500.000	4,63 %	29.04.2024	526.875	0,01 %
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	CHF 500.000	0,50 %	06.04.2020	523.602	0,01 %
Novartis Capital Corp.	\$ 500.000	3,70 %	21.09.2042	512.819	0,01 %
Credit Suisse AG	\$ 500.000	2,30 %	28.05.2019	500.863	0,01 %
UBS AG	\$ 500.000	2,35 %	26.03.2020	500.003	0,01 %
Novartis Capital Corp.	\$ 500.000	2,40 %	17.05.2022	497.838	0,01 %
Novartis Capital Corp.	\$ 500.000	1,80 %	14.02.2020	495.183	0,01 %
Canton of Geneva Switzerland	CHF 420.000	1,50 %	05.03.2032	491.544	0,01 %
Nestle Finance International Ltd.	€ 400.000	0,75 %	16.05.2023	491.215	0,01 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 400.000	1,25 %	27.06.2037	486.773	0,01 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 300.000	2,50 %	08.03.2036	430.313	0,00 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 200.000	4,00 %	06.01.2049	421.098	0,00 %
Roche Holdings, Inc.	\$ 425.000	2,63 %	15.05.2026	413.447	0,00 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 300.000	2,25 %	22.06.2031	396.665	0,00 %
UBS Group Funding Switzerland AG	€ 300.000	2,13 %	04.03.2024	388.292	0,00 %
Glencore Finance Europe Ltd.	€ 300.000	1,63 %	18.01.2022	372.629	0,00 %
Novartis Capital Corp.	\$ 375.000	2,40 %	21.09.2022	372.431	0,00 %
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 300.000	1,38 %	30.11.2021	327.337	0,00 %
UBS AG	€ 250.000	1,38 %	16.04.2021	313.913	0,00 %
Novartis Capital Corp.	\$ 275.000	4,00 %	20.11.2045	298.665	0,00 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	\$ 250.000	4,88 %	15.05.2045	287.829	0,00 %
Coca-Cola HBC Finance BV	€ 200.000	1,88 %	11.11.2024	257.167	0,00 %
UBS Group Funding Switzerland AG	\$ 250.000	3,00 %	15.04.2021	251.593	0,00 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	\$ 250.000	2,75 %	26.03.2020	250.646	0,00 %
Credit Suisse AG	€ 200.000	1,38 %	31.01.2022	250.362	0,00 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	€ 200.000	1,25 %	14.04.2022	247.735	0,00 %
LafargeHolcim Finance US LLC	\$ 250.000	3,50 %	22.09.2026	247.187	0,00 %
LafargeHolcim Finance US LLC	\$ 200.000	4,75 %	22.09.2046	212.226	0,00 %
Novartis Capital Corp.	\$ 200.000	4,40 %	24.04.2020	209.803	0,00 %
Novartis Capital Corp.	\$ 200.000	3,40 %	06.05.2024	207.934	0,00 %
Novartis Securities Investment Ltd.	\$ 200.000	5,13 %	10.02.2019	206.417	0,00 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	\$ 200.000	3,80 %	15.09.2022	206.031	0,00 %
UBS AG	\$ 200.000	2,45 %	01.12.2020	199.279	0,00 %
Roche Holdings, Inc.	\$ 200.000	1,75 %	28.01.2022	192.313	0,00 %
Roche Holdings, Inc.	\$ 200.000	2,38 %	28.01.2027	189.304	0,00 %
Novartis Capital Corp.	\$ 150.000	3,10 %	17.05.2027	152.388	0,00 %
ELM BV for Swiss Reinsurance Co., Ltd.^	£ 100.000	6,30 %	25.11.2166	143.797	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	£ 100.000	3,00 %	27.05.2022	142.795	0,00 %
Aquarius & Investments PLC for Zurich Insurance Co., Ltd.^	€ 100.000	4,25 %	02.10.2043	139.917	0,00 %
Nestle Holdings, Inc.	£ 100.000	1,75 %	09.12.2020	138.609	0,00 %
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co., Ltd.^	€ 100.000	7,50 %	24.07.2039	133.478	0,00 %
Nestle Finance International Ltd.	€ 100.000	1,75 %	12.09.2022	128.867	0,00 %
Novartis Capital Corp.	\$ 125.000	3,00 %	20.11.2025	126.009	0,00 %
Adecco International Financial Services BV	€ 100.000	1,50 %	22.11.2022	125.982	0,00 %
ABB Finance BV	€ 100.000	2,63 %	26.03.2019	123.992	0,00 %
Glencore Finance Europe Ltd.	€ 100.000	1,25 %	17.03.2021	122.890	0,00 %
Novartis Finance SA	€ 100.000	0,75 %	09.11.2021	122.770	0,00 %
Syngenta Finance NV	€ 100.000	1,88 %	02.11.2021	122.646	0,00 %
Geberit International BV	€ 100.000	0,69 %	30.03.2021	121.938	0,00 %
Novartis Capital Corp.	\$ 100.000	4,40 %	06.05.2044	114.777	0,00 %
Roche Holdings, Inc.	\$ 100.000	4,00 %	28.11.2044	107.687	0,00 %
ABB Treasury Center USA, Inc.	\$ 100.000	4,00 %	15.06.2021	104.777	0,00 %
UBS Group Funding Switzerland AG	\$ 100.000	4,13 %	24.09.2025	104.716	0,00 %
Credit Suisse AG	\$ 100.000	5,30 %	13.08.2019	104.677	0,00 %
Syngenta Finance NV	€ 100.000	1,25 %	10.09.2027	103.516	0,00 %
Credit Suisse AG	\$ 100.000	3,63 %	09.09.2024	103.239	0,00 %
UBS Group Funding Switzerland AG	\$ 100.000	2,95 %	24.09.2020	100.889	0,00 %
Roche Holdings, Inc.	\$ 100.000	2,25 %	30.09.2019	100.129	0,00 %
Glencore Funding LLC	\$ 100.000	4,00 %	27.03.2027	99.884	0,00 %
Glencore Funding LLC	\$ 100.000	3,00 %	27.10.2022	98.803	0,00 %
Zurich Finance UK plc^	£ 50.000	6,63 %	02.10.2166	80.185	0,00 %
UBS AG	€ 50.000	3,88 %	02.12.2019	64.823	0,00 %
Nestle Finance International Ltd.	€ 50.000	1,25 %	04.05.2020	61.942	0,00 %
Glencore Finance Canada Ltd.	\$ 25.000	5,55 %	25.10.2042	27.656	0,00 %
				102.740.196	1,08 %
Thailand 0,29 % (2016: 0,28 %)					
Thailand Government Bond	฿ 120.000.000	3,65 %	20.06.2031	4.055.363	0,04 %
Thailand Government Bond	฿ 100.000.000	1,88 %	17.06.2022	3.080.466	0,03 %
Thailand Government Bond	฿ 80.000.000	3,85 %	12.12.2025	2.739.076	0,03 %
Thailand Government Bond	฿ 70.000.000	4,88 %	22.06.2029	2.633.725	0,03 %
Thailand Government Bond	฿ 75.000.000	2,55 %	26.06.2020	2.358.017	0,03 %
Thailand Government Bond	฿ 70.000.000	3,63 %	16.06.2023	2.333.840	0,03 %
Thailand Government Bond	฿ 70.000.000	3,40 %	17.06.2036	2.296.962	0,02 %
Thailand Government Bond	฿ 65.000.000	3,58 %	17.12.2027	2.172.223	0,02 %
Thailand Government Bond	฿ 34.400.000	4,68 %	29.06.2044	1.346.151	0,01 %
Thailand Government Bond	฿ 30.000.000	3,65 %	17.12.2021	988.620	0,01 %
Thailand Government Bond	฿ 30.000.000	2,88 %	17.06.2046	873.406	0,01 %
Thailand Government Bond	฿ 20.000.000	5,67 %	13.03.2028	784.372	0,01 %
Thailand Government Bond	฿ 19.000.000	4,26 %	12.12.2037	677.086	0,01 %
Thailand Government Bond	฿ 15.000.000	4,00 %	17.06.2066	520.995	0,01 %
Thailand Government Bond	฿ 10.000.000	4,85 %	17.06.2061	405.822	0,00 %
Thailand Government Bond	฿ 10.000.000	3,80 %	14.06.2041	341.940	0,00 %
PTT PCL	\$ 200.000	4,50 %	25.10.2042	206.892	0,00 %
Siam Commercial Bank PCL	\$ 200.000	3,50 %	07.04.2019	202.057	0,00 %
				28.017.013	0,29 %
Türkei 0,01 % (2016: 0,01 %)					
Türkiye Garanti Bankasi A.S.	\$ 200.000	4,75 %	17.10.2019	203.304	0,01 %
Türk Telekomunikasyon A.S.	\$ 200.000	3,75 %	19.06.2019	201.250	0,00 %
Coca-Cola Icecek A.S.	\$ 105.000	4,22 %	19.09.2024	105.977	0,00 %
				510.531	0,01 %
VAE 0,09 % (2016: 0,06 %)					
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	\$ 2.700.000	5,88 %	13.12.2021	2.971.431	0,03 %
Abu Dhabi Government International Bond	\$ 2.100.000	3,13 %	11.10.2027	2.056.633	0,02 %
Abu Dhabi Government International Bond	\$ 500.000	6,75 %	08.04.2019	528.124	0,01 %
DIB Sukuk Ltd.	\$ 500.000	3,66 %	14.02.2022	504.420	0,01 %
DP World Ltd.	\$ 400.000	6,85 %	02.07.2037	497.602	0,01 %
Abu Dhabi Government International Bond	\$ 500.000	3,13 %	03.05.2026	494.215	0,01 %
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	\$ 450.000	6,25 %	16.09.2019	477.017	0,00 %
First Abu Dhabi Bank PJSC	\$ 300.000	2,25 %	11.02.2020	296.982	0,00 %
Dolphin Energy Ltd.	\$ 200.000	5,50 %	15.12.2021	217.056	0,00 %
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	\$ 200.000	4,38 %	22.06.2026	206.147	0,00 %
Emirates NBD PJSC	\$ 200.000	3,25 %	19.11.2019	201.758	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Emirates Telecommunications Group Co. PJSC	€ 100.000	2,75 %	18.06.2026	132.956	0,00 %
Dubai Electricity & Water Authority	\$ 100.000	7,38 %	21.10.2020	112.133	0,00 %
				8.696.474	0,09 %
Vereinigtes Königreich 4,65 % (2016: 4,41 %)					
United Kingdom Gilt	£ 14.050.000	1,50 %	22.07.2047	17.879.928	0,19 %
United Kingdom Gilt	£ 12.700.000	1,25 %	22.07.2027	17.221.394	0,18 %
United Kingdom Gilt	£ 12.220.000	0,75 %	22.07.2023	16.421.337	0,17 %
United Kingdom Gilt	£ 7.147.000	4,25 %	07.12.2046	15.056.972	0,16 %
United Kingdom Gilt	£ 9.800.000	1,75 %	07.09.2037	13.286.283	0,14 %
United Kingdom Gilt	£ 5.900.000	4,50 %	07.09.2034	11.346.995	0,12 %
United Kingdom Gilt	£ 5.670.000	3,50 %	22.01.2045	10.477.156	0,11 %
United Kingdom Gilt	£ 7.300.000	1,50 %	22.01.2021	10.158.555	0,11 %
United Kingdom Gilt	£ 5.030.000	3,25 %	22.01.2044	8.861.001	0,09 %
United Kingdom Gilt	£ 6.100.000	1,75 %	22.07.2019	8.417.594	0,09 %
United Kingdom Gilt	£ 3.550.000	4,25 %	07.12.2055	8.329.008	0,09 %
United Kingdom Gilt	£ 3.800.000	4,50 %	07.12.2042	7.962.615	0,08 %
United Kingdom Gilt	£ 3.400.000	3,50 %	22.07.2068	7.678.662	0,08 %
United Kingdom Gilt	£ 5.600.000	1,25 %	22.07.2018	7.611.762	0,08 %
United Kingdom Gilt	£ 3.950.000	4,25 %	07.03.2036	7.510.550	0,08 %
United Kingdom Gilt	£ 2.925.000	3,75 %	22.07.2052	6.091.501	0,07 %
United Kingdom Gilt	£ 4.200.000	1,50 %	22.07.2026	5.867.740	0,06 %
United Kingdom Gilt	£ 3.750.000	3,75 %	07.09.2020	5.513.044	0,06 %
United Kingdom Gilt	£ 2.940.000	2,75 %	07.09.2024	4.446.825	0,05 %
United Kingdom Gilt	£ 2.260.000	4,75 %	07.12.2030	4.260.725	0,05 %
United Kingdom Gilt	£ 2.050.000	4,25 %	07.12.2040	4.079.327	0,04 %
United Kingdom Gilt	£ 1.850.000	4,25 %	07.09.2039	3.635.272	0,04 %
Mitchells & Butlers Finance plc	£ 2.195.341	6,01 %	15.12.2028	3.548.804	0,04 %
United Kingdom Gilt	£ 1.850.000	2,50 %	22.07.2065	3.271.114	0,04 %
United Kingdom Gilt	£ 1.770.000	4,25 %	07.06.2032	3.243.644	0,04 %
United Kingdom Gilt	£ 2.280.000	2,00 %	22.07.2020	3.202.176	0,03 %
United Kingdom Gilt	£ 1.760.000	5,00 %	07.03.2025	3.049.782	0,03 %
Lloyds Banking Group plc	£ 1.950.000	2,25 %	16.10.2024	2.663.787	0,03 %
United Kingdom Gilt	£ 1.500.000	3,75 %	07.09.2021	2.262.553	0,02 %
United Kingdom Gilt	£ 1.000.000	4,25 %	07.12.2049	2.187.814	0,02 %
BAT Capital Corp.	£ 1.500.000	2,13 %	15.08.2025	2.019.730	0,02 %
BAT International Finance plc	\$ 2.000.000	2,75 %	15.06.2020	2.007.784	0,02 %
Standard Chartered plc	€ 1.600.000	4,13 %	18.01.2019	2.005.488	0,02 %
BG Energy Capital plc	€ 1.500.000	2,25 %	21.11.2029	1.981.641	0,02 %
HSBC Holdings plc	€ 1.875.000	4,25 %	18.08.2025	1.946.130	0,02 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	£ 1.000.000	5,50 %	11.02.2041	1.907.072	0,02 %
United Kingdom Gilt	£ 1.300.000	2,00 %	07.09.2025	1.887.534	0,02 %
BP Capital Markets plc	€ 1.500.000	1,08 %	26.06.2025	1.822.573	0,02 %
Cadent Finance plc	€ 1.500.000	0,63 %	22.09.2024	1.761.296	0,02 %
United Kingdom Gilt	£ 750.000	4,00 %	22.01.2060	1.755.869	0,02 %
Barclays Bank plc	£ 1.100.000	4,25 %	12.01.2022	1.674.952	0,02 %
United Kingdom Gilt	£ 1.091.000	2,25 %	07.09.2023	1.591.419	0,02 %
HSBC Holdings plc^	£ 1.110.000	2,26 %	13.11.2026	1.506.294	0,02 %
Santander UK plc	\$ 1.500.000	2,50 %	14.03.2019	1.504.151	0,02 %
Co.-Operative Bank plc	£ 1.000.000	4,75 %	11.11.2021	1.481.480	0,02 %
Places for People Homes Ltd.	£ 1.056.000	3,63 %	22.11.2028	1.451.074	0,02 %
Barclays plc	\$ 1.400.000	3,20 %	10.08.2021	1.409.244	0,02 %
Severn Trent Utilities Finance plc	£ 1.000.000	2,75 %	05.12.2031	1.392.134	0,02 %
British Telecommunications plc	£ 1.000.000	3,13 %	21.11.2031	1.384.481	0,02 %
Nationwide Building Society	€ 1.000.000	4,63 %	08.02.2021	1.374.774	0,02 %
Channel Link Enterprises Finance plc^	£ 1.000.000	3,04 %	30.06.2050	1.365.597	0,02 %
Dignity Finance plc	£ 894.690	3,55 %	31.12.2034	1.359.986	0,02 %
Principality Building Society	£ 1.000.000	2,38 %	23.11.2023	1.353.164	0,02 %
AstraZeneca plc	\$ 1.350.000	2,38 %	16.11.2020	1.347.018	0,02 %
BAE Systems Finance, Inc.	\$ 1.035.000	7,50 %	01.07.2027	1.342.215	0,02 %
Compass Group plc	£ 1.000.000	2,00 %	03.07.2029	1.330.699	0,02 %
BP Capital Markets plc	\$ 1.300.000	1,68 %	03.05.2019	1.293.405	0,01 %
Barclays plc	€ 1.000.000	1,88 %	08.12.2023	1.261.673	0,01 %
HSBC Holdings plc	\$ 1.250.000	2,95 %	25.05.2021	1.258.244	0,01 %
Bank of England Euro Note	\$ 1.250.000	1,25 %	14.03.2019	1.239.116	0,01 %
BP Capital Markets plc	\$ 1.250.000	3,02 %	16.01.2027	1.233.666	0,01 %
CNH Industrial Finance Europe SA	€ 1.000.000	1,75 %	12.09.2025	1.233.342	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Channel Link Enterprises Finance plc^	€ 1.000.000	1,76 %	30.06.2050	1.220.724	0,01 %
Global Switch Holdings Ltd.	€ 1.000.000	1,50 %	31.01.2024	1.219.472	0,01 %
Nationwide Building Society^	€ 1.000.000	2,00 %	25.07.2029	1.215.498	0,01 %
Coventry Building Society	£ 900.000	1,00 %	05.05.2020	1.214.725	0,01 %
Nationwide Building Society	€ 1.000.000	0,50 %	29.10.2019	1.211.727	0,01 %
Vodafone Group plc	€ 1.000.000	2,88 %	20.11.2037	1.206.316	0,01 %
DS Smith plc	€ 1.000.000	1,38 %	26.07.2024	1.204.967	0,01 %
British Telecommunications plc	€ 1.000.000	0,50 %	23.06.2022	1.199.791	0,01 %
Vodafone Group plc	€ 1.000.000	1,13 %	20.11.2025	1.193.025	0,01 %
Lloyds Banking Group plc	\$ 1.100.000	4,58 %	10.12.2025	1.148.888	0,01 %
United Utilities Water Ltd.	£ 700.000	5,75 %	25.03.2022	1.118.659	0,01 %
Cadent Finance plc	£ 832.000	1,13 %	22.09.2021	1.118.469	0,01 %
United Kingdom Gilt	£ 550.000	6,00 %	07.12.2028	1.103.570	0,01 %
Vodafone Group plc	\$ 1.075.000	4,38 %	19.02.2043	1.101.663	0,01 %
Coventry Building Society	£ 800.000	1,88 %	24.10.2023	1.080.929	0,01 %
HSBC Holdings plc	€ 800.000	2,50 %	15.03.2027	1.070.563	0,01 %
BUPA Finance plc	£ 671.000	5,00 %	08.12.2026	1.057.897	0,01 %
HSBC Holdings plc	\$ 1.000.000	4,38 %	23.11.2026	1.043.422	0,01 %
HSBC Holdings plc^	\$ 1.000.000	4,04 %	13.03.2028	1.040.921	0,01 %
HSBC Holdings plc	\$ 1.000.000	3,60 %	25.05.2023	1.028.918	0,01 %
Royal Bank of Scotland Group plc^	\$ 1.000.000	3,50 %	15.05.2023	1.001.416	0,01 %
BP Capital Markets plc	€ 803.000	1,12 %	25.01.2024	991.174	0,01 %
Southern Gas Networks plc	£ 700.000	2,50 %	03.02.2025	980.651	0,01 %
Lloyds Bank plc	€ 800.000	0,63 %	14.09.2022	979.719	0,01 %
Coca-Cola European Partners plc	€ 800.000	1,13 %	26.05.2024	977.383	0,01 %
Nationwide Building Society	€ 800.000	0,75 %	25.06.2019	976.130	0,01 %
Standard Chartered plc	\$ 950.000	4,05 %	12.04.2026	974.533	0,01 %
HSBC Holdings plc	£ 700.000	2,63 %	16.08.2028	966.094	0,01 %
British Telecommunications plc	€ 800.000	1,00 %	23.06.2024	960.342	0,01 %
Nationwide Building Society	\$ 950.000	4,00 %	14.09.2026	960.093	0,01 %
Segro plc	£ 700.000	2,88 %	11.10.2037	950.394	0,01 %
HSBC Holdings plc	\$ 800.000	5,25 %	14.03.2044	940.590	0,01 %
Babcock International Group plc	£ 700.000	1,88 %	05.10.2026	914.862	0,01 %
BAT Capital Corp.	\$ 825.000	4,54 %	15.08.2047	868.444	0,01 %
Society of Lloyd's^	£ 562.000	4,88 %	07.02.2047	856.629	0,01 %
British Telecommunications plc	\$ 575.000	9,13 %	15.12.2030	855.300	0,01 %
Barclays plc	\$ 800.000	5,20 %	12.05.2026	853.510	0,01 %
Nationwide Building Society	\$ 850.000	2,35 %	21.01.2020	848.999	0,01 %
United Kingdom Gilt	£ 500.000	8,00 %	07.06.2021	846.325	0,01 %
GlaxoSmithKline Capital, Inc.	\$ 600.000	6,38 %	15.05.2038	846.019	0,01 %
British Telecommunications plc	€ 700.000	1,00 %	21.11.2024	834.057	0,01 %
Southern Water Services Finance Ltd.	£ 550.000	5,00 %	31.03.2021	832.208	0,01 %
Lloyds Banking Group plc	€ 687.000	1,00 %	09.11.2023	832.117	0,01 %
Annington Funding plc	£ 600.000	3,18 %	12.07.2029	832.037	0,01 %
BUPA Finance plc	£ 600.000	2,00 %	05.04.2024	818.427	0,01 %
Affordable Housing Finance plc	£ 525.000	2,89 %	11.08.2043	818.402	0,01 %
Standard Chartered plc	\$ 800.000	4,30 %	19.02.2027	815.442	0,01 %
BAT Capital Corp.	\$ 800.000	3,56 %	15.08.2027	800.795	0,01 %
Lloyds Banking Group plc	AUD 1.000.000	4,25 %	22.11.2027	777.310	0,01 %
London Stock Exchange Group plc	£ 500.000	9,13 %	18.10.2019	772.588	0,01 %
Lloyds Banking Group plc	€ 627.000	0,75 %	09.11.2021	764.904	0,01 %
Sky plc	€ 600.000	1,50 %	15.09.2021	752.059	0,01 %
BAT International Finance plc	€ 600.000	2,25 %	16.01.2030	744.640	0,01 %
Anglo American Capital plc	\$ 700.000	4,88 %	14.05.2025	739.375	0,01 %
Nationwide Building Society	£ 500.000	5,63 %	09.09.2019	729.018	0,01 %
BP Capital Markets plc	\$ 700.000	3,54 %	04.11.2024	727.610	0,01 %
Sky plc	\$ 700.000	3,75 %	16.09.2024	727.562	0,01 %
RELX Finance BV	€ 600.000	0,38 %	22.03.2021	723.180	0,01 %
Experian Finance plc	€ 600.000	1,38 %	25.06.2026	722.234	0,01 %
Chancellor Masters & Scholars of the University of Oxford	£ 500.000	2,54 %	08.12.2117	719.135	0,01 %
Diageo Finance plc	€ 600.000	0,00 %	17.11.2020	718.631	0,01 %
Annington Funding plc	£ 500.000	3,69 %	12.07.2034	710.669	0,01 %
London & Quadrant Housing Trust Ltd.	£ 500.000	2,63 %	05.05.2026	703.565	0,01 %
FCE Bank plc	£ 500.000	2,73 %	03.06.2022	702.199	0,01 %
BP Capital Markets plc	\$ 700.000	2,24 %	10.05.2019	701.050	0,01 %
Marks & Spencer plc	£ 500.000	3,00 %	08.12.2023	700.564	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Land Securities Capital Markets plc	£ 500.000	2,40 %	08.02.2029	697.013	0,01 %
Broadgate Financing plc	£ 429.000	5,10 %	05.04.2033	689.959	0,01 %
Gatwick Funding Ltd	£ 500.000	3,13 %	28.09.2039	687.684	0,01 %
Yorkshire Building Society^	£ 500.000	3,38 %	13.09.2028	686.250	0,01 %
National Express Group plc	£ 500.000	2,50 %	11.11.2023	685.678	0,01 %
Segro plc	£ 500.000	2,38 %	11.10.2029	676.913	0,01 %
Bazalgette Finance plc	£ 500.000	2,38 %	29.11.2027	673.304	0,01 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	£ 500.000	2,38 %	03.05.2023	673.276	0,01 %
United Kingdom Gilt	£ 475.000	4,50 %	07.03.2019	673.267	0,01 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	£ 500.000	1,88 %	24.01.2024	667.979	0,01 %
Martlet Homes Ltd.	£ 500.000	3,00 %	09.05.2052	667.783	0,01 %
Sky plc	€ 500.000	2,25 %	17.11.2025	652.245	0,01 %
Royal Bank of Scotland Group plc	€ 500.000	2,50 %	22.03.2023	647.685	0,01 %
HSBC Holdings plc	€ 524.000	0,88 %	06.09.2024	630.877	0,01 %
Barclays plc	€ 500.000	1,88 %	23.03.2021	628.645	0,01 %
Vodafone Group plc	€ 500.000	1,25 %	25.08.2021	620.572	0,01 %
G4S International Finance plc	€ 500.000	1,50 %	09.01.2023	614.930	0,01 %
Skipton Building Society	£ 455.000	1,75 %	30.06.2022	613.380	0,01 %
FCE Bank plc	€ 500.000	0,87 %	13.09.2021	609.841	0,01 %
Royal Bank of Scotland Group plc	\$ 600.000	3,88 %	12.09.2023	609.800	0,01 %
Standard Chartered plc	£ 400.000	5,13 %	06.06.2034	608.078	0,01 %
Lloyds Banking Group plc	\$ 600.000	3,75 %	11.01.2027	608.058	0,01 %
Imperial Brands Finance plc	€ 500.000	1,38 %	27.01.2025	607.779	0,01 %
easyJet plc	€ 500.000	1,13 %	18.10.2023	607.076	0,01 %
Lloyds Bank plc	€ 500.000	0,50 %	11.04.2023	606.430	0,01 %
Leeds Building Society	€ 500.000	0,13 %	21.04.2020	603.733	0,01 %
Nationwide Building Society	£ 410.000	3,25 %	20.01.2028	603.030	0,01 %
Yorkshire Building Society	€ 500.000	0,38 %	11.04.2023	600.867	0,01 %
Santander UK Group Holdings plc^	\$ 600.000	3,82 %	03.11.2028	599.905	0,01 %
Standard Chartered plc^	€ 500.000	0,75 %	03.10.2023	598.784	0,01 %
AstraZeneca plc	\$ 550.000	4,38 %	16.11.2045	597.704	0,01 %
Leeds Building Society	€ 500.000	0,50 %	03.07.2024	597.237	0,01 %
Western Power Distribution plc	£ 400.000	3,63 %	06.11.2023	583.683	0,01 %
Heathrow Funding Ltd.	£ 300.000	6,45 %	10.12.2031	583.503	0,01 %
Aviva plc^	£ 400.000	4,38 %	12.09.2049	580.779	0,01 %
Centrica plc	\$ 550.000	4,00 %	16.10.2023	566.125	0,01 %
Notting Hill Housing Trust	£ 400.000	3,25 %	12.10.2048	557.265	0,01 %
BAT Capital Corp.	\$ 550.000	2,76 %	15.08.2022	546.905	0,01 %
BAT Capital Corp.	\$ 550.000	2,30 %	14.08.2020	546.786	0,01 %
Student Finance plc	£ 400.000	2,67 %	30.09.2024	543.600	0,01 %
DS Smith plc	£ 400.000	2,88 %	26.07.2029	538.132	0,01 %
United Utilities Water Ltd.	£ 300.000	5,63 %	20.12.2027	534.971	0,01 %
Aviva plc	€ 445.000	0,63 %	27.10.2023	533.656	0,01 %
Diageo Capital plc	\$ 500.000	4,83 %	15.07.2020	530.055	0,01 %
Barclays Bank plc	\$ 500.000	5,14 %	14.10.2020	528.271	0,01 %
BP Capital Markets plc	\$ 500.000	3,81 %	10.02.2024	526.113	0,01 %
SELP Finance Sarl	€ 427.000	1,50 %	20.11.2025	510.677	0,01 %
BP Capital Markets plc	\$ 500.000	3,22 %	28.11.2023	510.561	0,01 %
Santander UK Group Holdings plc	\$ 500.000	3,57 %	10.01.2023	506.341	0,01 %
Barclays plc	\$ 500.000	3,25 %	12.01.2021	504.529	0,01 %
BP Capital Markets plc	\$ 500.000	3,12 %	04.05.2026	503.596	0,01 %
Lloyds Banking Group plc	\$ 500.000	3,00 %	11.01.2022	501.417	0,01 %
BAT Capital Corp.	\$ 500.000	3,22 %	15.08.2024	500.045	0,01 %
BAT Capital Corp.	\$ 475.000	4,39 %	15.08.2037	497.562	0,01 %
HSBC Holdings plc	\$ 500.000	2,65 %	05.01.2022	496.339	0,01 %
Standard Chartered plc	\$ 500.000	2,10 %	19.08.2019	496.326	0,01 %
Santander UK plc	\$ 500.000	2,13 %	03.11.2020	495.044	0,01 %
Santander UK plc	€ 400.000	1,13 %	14.01.2022	494.830	0,01 %
Imperial Brands Finance plc	£ 300.000	4,88 %	07.06.2032	492.730	0,01 %
Heathrow Funding Ltd.	€ 400.000	1,88 %	12.07.2032	492.465	0,01 %
Nationwide Building Society	€ 400.000	1,25 %	03.03.2025	490.998	0,01 %
BAT Capital Corp.	€ 400.000	1,13 %	16.11.2023	487.575	0,01 %
Anglo American Capital plc	€ 400.000	1,63 %	18.09.2025	481.623	0,01 %
Santander UK Group Holdings plc	\$ 475.000	3,13 %	08.01.2021	479.778	0,01 %
GlaxoSmithKline Capital plc	€ 400.000	0,00 %	12.09.2020	479.475	0,01 %
Diageo Finance plc	€ 398.000	0,50 %	19.06.2024	471.179	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Reckitt Benckiser Treasury Services plc	\$ 475.000	2,38 %	24.06.2022	463.357	0,01 %
Reckitt Benckiser Treasury Services plc	\$ 475.000	3,00 %	26.06.2027	462.931	0,01 %
Reckitt Benckiser Treasury Services plc	\$ 475.000	2,75 %	26.06.2024	462.226	0,01 %
UNITE USAF II plc	£ 300.000	3,92 %	30.06.2025	457.472	0,01 %
Lloyds Bank plc	\$ 425.000	5,80 %	13.01.2020	452.655	0,01 %
Motability Operations Group plc	€ 350.000	1,63 %	09.06.2023	445.003	0,01 %
Network Rail Infrastructure Finance plc	£ 250.000	4,38 %	09.12.2030	442.906	0,01 %
Standard Chartered plc	\$ 400.000	5,20 %	26.01.2024	429.294	0,01 %
London Stock Exchange Group plc	€ 349.000	1,75 %	19.09.2029	427.837	0,01 %
Sky plc	£ 300.000	2,88 %	24.11.2020	424.927	0,01 %
EE Finance plc	£ 300.000	4,38 %	28.03.2019	422.090	0,01 %
Nationwide Building Society	£ 300.000	2,25 %	29.04.2022	421.726	0,01 %
Imperial Brands Finance plc	\$ 400.000	4,25 %	21.07.2025	418.815	0,01 %
Standard Chartered plc^	€ 341.000	1,63 %	03.10.2027	414.042	0,01 %
HSBC Holdings plc	£ 200.000	7,00 %	07.04.2038	407.259	0,01 %
SSE plc	£ 250.000	5,88 %	22.09.2022	406.034	0,01 %
HSBC Holdings plc	CAD 500.000	3,20 %	05.12.2023	403.073	0,01 %
Centrica plc	£ 200.000	7,00 %	19.09.2033	402.037	0,01 %
Wales & West Utilities Finance plc	£ 250.000	6,25 %	30.11.2021	401.575	0,01 %
Rolls-Royce plc	\$ 400.000	2,38 %	14.10.2020	397.225	0,01 %
Lloyds Banking Group plc^	\$ 400.000	2,91 %	07.11.2023	396.104	0,01 %
Brambles Finance Ltd.	€ 300.000	2,38 %	12.06.2024	393.856	0,01 %
BP Capital Markets plc	€ 300.000	1,95 %	03.03.2025	387.843	0,01 %
Sky plc	€ 300.000	1,88 %	24.11.2023	383.589	0,01 %
BG Energy Capital plc	€ 300.000	3,63 %	16.07.2019	380.972	0,01 %
Vodafone Group plc	€ 300.000	1,75 %	25.08.2023	380.477	0,01 %
Hammerson plc	£ 200.000	7,25 %	21.04.2028	376.421	0,01 %
FCE Bank plc	€ 300.000	1,62 %	11.05.2023	374.129	0,01 %
Barclays plc	€ 300.000	1,50 %	01.04.2022	373.760	0,01 %
HSBC Holdings plc	£ 200.000	6,00 %	29.03.2040	372.683	0,01 %
BP Capital Markets plc	€ 300.000	1,64 %	26.06.2029	371.655	0,01 %
Nationwide Building Society	€ 300.000	0,75 %	26.10.2022	369.137	0,01 %
Lloyds Bank plc	€ 300.000	0,38 %	18.01.2021	364.856	0,01 %
Nationwide Building Society	€ 300.000	0,50 %	23.02.2024	362.003	0,01 %
South Eastern Power Networks plc	£ 200.000	5,63 %	30.09.2030	361.195	0,01 %
Phoenix Group Holdings	£ 250.000	4,13 %	20.07.2022	360.513	0,01 %
British Telecommunications plc	£ 300.000	1,50 %	23.06.2027	358.338	0,00 %
London Stock Exchange Group plc	€ 300.000	0,88 %	19.09.2024	358.144	0,00 %
Affordable Housing Finance plc	£ 200.000	3,80 %	20.05.2042	356.491	0,00 %
Santander UK plc	£ 200.000	5,75 %	02.03.2026	355.863	0,00 %
HSBC Holdings plc^	\$ 350.000	3,03 %	22.11.2023	350.599	0,00 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	£ 200.000	4,63 %	04.06.2046	350.507	0,00 %
CYBG plc^	£ 250.000	3,13 %	22.06.2025	348.723	0,00 %
WPP Finance 2010	\$ 300.000	5,63 %	15.11.2043	348.535	0,00 %
Tritax Big Box plc	£ 250.000	2,63 %	14.12.2026	343.297	0,00 %
Vodafone Group plc	£ 200.000	5,63 %	04.12.2025	336.248	0,00 %
Land Securities Capital Markets plc^	£ 200.000	5,39 %	31.03.2027	336.124	0,00 %
Clydesdale Bank plc	£ 200.000	4,63 %	08.06.2026	332.423	0,00 %
AA Bond Co., Ltd.	£ 200.000	6,27 %	31.07.2025	325.244	0,00 %
HSBC Capital Funding Dollar1 LP^	\$ 200.000	10,18 %	31.12.2166	324.973	0,00 %
RI Finance Bonds No 3 plc	£ 200.000	6,13 %	13.11.2028	323.032	0,00 %
Intu SGS Finance plc	£ 200.000	4,63 %	17.03.2028	316.070	0,00 %
Centrica plc	£ 200.000	4,25 %	12.09.2044	313.373	0,00 %
HSBC Bank plc	\$ 300.000	4,13 %	12.08.2020	312.392	0,00 %
BAT International Finance plc	\$ 300.000	3,95 %	15.06.2025	311.487	0,00 %
HSBC Holdings plc	\$ 300.000	3,90 %	25.05.2026	310.324	0,00 %
Aviva plc^	£ 200.000	6,63 %	03.06.2041	309.313	0,00 %
WPP Finance SA	£ 200.000	6,38 %	06.11.2020	308.893	0,00 %
Tritax Big Box plc	£ 225.000	3,13 %	14.12.2031	308.517	0,00 %
Legal & General Group plc^	£ 200.000	5,38 %	27.10.2045	308.381	0,00 %
Segro plc	£ 200.000	5,63 %	07.12.2020	303.738	0,00 %
Motability Operations Group plc	£ 225.000	2,38 %	14.03.2032	303.514	0,00 %
Vodafone Group plc	£ 250.000	3,00 %	12.08.2056	297.754	0,00 %
RAC Bond Co. plc	£ 200.000	4,87 %	06.05.2026	297.689	0,00 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	£ 200.000	3,50 %	25.02.2028	295.029	0,00 %
Experian Finance plc	£ 200.000	3,50 %	15.10.2021	291.696	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
HSBC Holdings plc	\$ 270.000	4,88 %	14.01.2022	290.308	0,00 %
Yorkshire Water Services Bradford Finance Ltd.^	£ 200.000	3,75 %	22.03.2046	286.834	0,00 %
Thames Water Utilities Finance Ltd.	£ 150.000	6,75 %	16.11.2028	284.540	0,00 %
Kennedy Wilson Europe Real Estate plc	£ 200.000	3,95 %	30.06.2022	284.272	0,00 %
Transport for London	£ 200.000	2,13 %	24.04.2025	282.379	0,00 %
Next plc	£ 200.000	3,63 %	18.05.2028	280.640	0,00 %
CPUK Finance Ltd.	£ 200.000	2,67 %	28.02.2020	277.437	0,00 %
Greene King Finance plc	£ 184.425	4,06 %	15.03.2035	276.320	0,00 %
BAE Systems Holdings, Inc.	\$ 275.000	2,85 %	15.12.2020	276.097	0,00 %
Virgin Money plc	£ 200.000	2,25 %	21.04.2020	275.260	0,00 %
Land Securities Capital Markets plc	£ 200.000	2,63 %	22.09.2037	274.639	0,00 %
British Telecommunications plc	€ 220.000	1,75 %	10.03.2026	271.837	0,00 %
HSBC Holdings plc	€ 200.000	3,00 %	30.06.2025	266.912	0,00 %
Urenco Finance NV	€ 200.000	2,38 %	02.12.2024	262.344	0,00 %
HSBC Holdings plc	\$ 200.000	6,50 %	02.05.2036	261.307	0,00 %
Cadent Finance plc	£ 200.000	2,75 %	22.09.2046	259.993	0,00 %
Urenco Finance NV	€ 200.000	2,25 %	05.08.2022	258.085	0,00 %
Diageo Finance plc	€ 200.000	1,75 %	23.09.2024	256.476	0,00 %
University of Liverpool	£ 150.000	3,38 %	25.06.2055	255.396	0,00 %
HSBC Holdings plc	\$ 250.000	3,40 %	08.03.2021	255.334	0,00 %
BP Capital Markets plc	\$ 250.000	3,06 %	17.03.2022	255.121	0,00 %
Unilever NV	€ 200.000	1,75 %	05.08.2020	251.514	0,00 %
RELX Capital, Inc.	\$ 250.000	3,13 %	15.10.2022	250.438	0,00 %
Nationwide Building Society^	\$ 250.000	4,13 %	18.10.2032	250.146	0,00 %
BG Energy Capital plc	€ 200.000	1,25 %	21.11.2022	250.010	0,00 %
Barclays plc	\$ 250.000	3,65 %	16.03.2025	249.920	0,00 %
Barclays plc^	€ 200.000	2,63 %	11.11.2025	249.689	0,00 %
SP Manweb plc	£ 150.000	4,88 %	20.09.2027	249.319	0,00 %
Smiths Group plc	€ 200.000	2,00 %	23.02.2027	248.561	0,00 %
Gatwick Funding Ltd.	£ 200.000	2,63 %	07.10.2046	248.434	0,00 %
Vodafone Group plc	\$ 250.000	2,50 %	26.09.2022	247.957	0,00 %
Nationwide Building Society	\$ 250.000	2,45 %	27.07.2021	247.847	0,00 %
Unilever NV	€ 200.000	1,00 %	03.06.2023	247.496	0,00 %
Nationwide Building Society	€ 200.000	1,13 %	03.06.2022	247.327	0,00 %
Leeds Building Society	€ 200.000	1,38 %	05.05.2022	246.926	0,00 %
Royal Bank of Scotland plc	£ 150.000	5,13 %	13.01.2024	246.038	0,00 %
RELX Capital, Inc.	€ 200.000	1,30 %	12.05.2025	245.367	0,00 %
British Telecommunications plc	€ 200.000	1,13 %	10.03.2023	245.211	0,00 %
Prudential plc^	£ 150.000	5,70 %	19.12.2063	245.169	0,00 %
Lloyds Bank plc	€ 200.000	0,50 %	22.07.2020	244.167	0,00 %
Yorkshire Building Society	€ 200.000	0,50 %	19.06.2020	243.801	0,00 %
Unilever NV	€ 200.000	0,50 %	03.02.2022	242.951	0,00 %
Santander UK plc	€ 200.000	0,38 %	18.09.2019	242.936	0,00 %
Santander UK plc	€ 200.000	0,25 %	09.08.2021	241.973	0,00 %
BAT International Finance plc	€ 200.000	0,38 %	13.03.2019	241.116	0,00 %
Vodafone Group plc	€ 200.000	0,50 %	30.01.2024	235.119	0,00 %
BAE Systems Holdings, Inc.	\$ 210.000	4,75 %	07.10.2044	233.000	0,00 %
Standard Chartered plc	\$ 225.000	2,25 %	17.04.2020	223.065	0,00 %
Rolls-Royce plc	£ 150.000	3,38 %	18.06.2026	222.919	0,00 %
Barclays plc	\$ 200.000	4,95 %	10.01.2047	222.725	0,00 %
GlaxoSmithKline Capital, Inc.	\$ 200.000	4,20 %	18.03.2043	221.414	0,00 %
Diageo Investment Corp.	\$ 150.000	7,45 %	15.04.2035	218.562	0,00 %
HSBC Holdings plc	\$ 205.000	4,00 %	30.03.2022	214.310	0,00 %
BAT International Finance plc	€ 200.000	2,00 %	13.03.2045	212.513	0,00 %
HSBC Holdings plc	\$ 200.000	4,30 %	08.03.2026	212.393	0,00 %
Lloyds Banking Group plc	\$ 200.000	4,50 %	04.11.2024	209.646	0,00 %
BG Energy Capital plc	\$ 200.000	4,00 %	15.10.2021	209.618	0,00 %
Diageo Capital plc	\$ 200.000	3,88 %	29.04.2043	209.293	0,00 %
Nationwide Building Society	\$ 200.000	3,90 %	21.07.2025	208.851	0,00 %
Barclays plc	\$ 200.000	4,38 %	12.01.2026	208.107	0,00 %
BP Capital Markets plc	\$ 200.000	3,51 %	17.03.2025	206.975	0,00 %
Barclays plc	\$ 200.000	4,34 %	10.01.2028	206.445	0,00 %
Rolls-Royce plc	\$ 200.000	3,63 %	14.10.2025	206.302	0,00 %
Imperial Brands Finance plc	\$ 200.000	3,75 %	21.07.2022	206.074	0,00 %
THFC Funding No 2 plc	£ 100.000	6,35 %	08.07.2039	205.877	0,00 %
Transport for London	£ 100.000	4,00 %	07.04.2064	203.784	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
HSBC Holdings plc^	\$ 200.000	3,26 %	13.03.2023	202.545	0,00 %
BP Capital Markets plc	\$ 200.000	3,28 %	19.09.2027	201.896	0,00 %
GlaxoSmithKline Capital, Inc.	\$ 200.000	2,80 %	18.03.2023	201.887	0,00 %
Standard Chartered plc	\$ 200.000	3,95 %	11.01.2023	201.771	0,00 %
Santander UK plc	\$ 200.000	2,38 %	16.03.2020	200.023	0,00 %
Network Rail Infrastructure Finance plc	\$ 200.000	1,75 %	24.01.2019	199.534	0,00 %
Heathrow Funding Ltd.	£ 100.000	5,88 %	13.05.2041	198.970	0,00 %
AstraZeneca plc	\$ 200.000	1,95 %	18.09.2019	198.655	0,00 %
Lloyds Banking Group plc^	\$ 200.000	3,57 %	07.11.2028	198.183	0,00 %
Northern Gas Networks Finance plc	£ 100.000	5,63 %	23.03.2040	198.128	0,00 %
South Eastern Power Networks plc	£ 100.000	6,38 %	12.11.2031	195.874	0,00 %
British Telecommunications plc	£ 100.000	6,38 %	23.06.2037	195.607	0,00 %
NGG Finance plc^	€ 150.000	4,25 %	18.06.2076	195.495	0,00 %
LCR Finance plc	£ 100.000	4,50 %	07.12.2038	194.200	0,00 %
Circle Anglia Social Housing plc	£ 100.000	5,20 %	02.03.2044	191.656	0,00 %
Lloyds Bank plc	£ 100.000	6,00 %	08.02.2029	190.531	0,00 %
Peabody Capital No 2 plc	£ 100.000	4,63 %	12.12.2053	188.534	0,00 %
Lloyds Bank plc	€ 150.000	1,38 %	16.04.2021	188.228	0,00 %
Legal & General Finance plc	£ 100.000	5,88 %	11.12.2031	187.795	0,00 %
Northumbrian Water Finance plc	£ 100.000	5,13 %	23.01.2042	187.597	0,00 %
THFC Funding No 3 plc	£ 100.000	5,20 %	11.10.2043	186.809	0,00 %
GlaxoSmithKline Capital plc	£ 100.000	5,25 %	19.12.2033	186.349	0,00 %
Western Power Distribution West Midlands plc	£ 100.000	5,75 %	16.04.2032	184.076	0,00 %
BG Energy Capital plc	£ 100.000	5,00 %	04.11.2036	182.846	0,00 %
Northern Powergrid Yorkshire plc	£ 100.000	5,13 %	04.05.2035	182.828	0,00 %
Eversholt Funding plc	£ 100.000	6,70 %	22.02.2035	181.516	0,00 %
Lloyds Bank plc	£ 100.000	7,63 %	22.04.2025	181.278	0,00 %
Juturna European Loan Conduit No 16 plc	£ 109.117	5,06 %	10.08.2033	181.053	0,00 %
Thames Water Utilities Finance Ltd.	£ 100.000	5,13 %	28.09.2037	179.659	0,00 %
HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 LP^	£ 100.000	5,84 %	05.11.2166	178.111	0,00 %
BPHA Finance plc	£ 100.000	4,82 %	11.04.2044	178.007	0,00 %
Nationwide Building Society	£ 100.000	5,63 %	28.01.2026	177.606	0,00 %
AstraZeneca plc	\$ 175.000	3,38 %	16.11.2025	177.545	0,00 %
GlaxoSmithKline Capital plc	£ 100.000	4,25 %	18.12.2045	176.151	0,00 %
Imperial Brands Finance plc	£ 100.000	9,00 %	17.02.2022	174.870	0,00 %
Notting Hill Housing Trust	£ 100.000	4,38 %	20.02.2054	174.371	0,00 %
Myriad Capital plc	£ 100.000	4,75 %	20.12.2043	172.351	0,00 %
Lloyds Bank plc	£ 100.000	4,88 %	30.03.2027	171.195	0,00 %
Heathrow Funding Ltd.	£ 100.000	7,13 %	14.02.2024	171.054	0,00 %
Dignity Finance plc	£ 100.000	4,70 %	31.12.2049	170.399	0,00 %
HSBC Holdings plc	£ 100.000	5,75 %	20.12.2027	169.979	0,00 %
EMH Treasury plc	£ 100.000	4,50 %	29.01.2044	169.164	0,00 %
Transport for London	£ 100.000	4,00 %	12.09.2033	169.090	0,00 %
Together Housing Finance plc	£ 100.000	4,50 %	17.12.2042	168.793	0,00 %
Bank of Scotland plc	£ 100.000	9,38 %	15.05.2021	168.514	0,00 %
Lloyds Bank plc	£ 100.000	5,13 %	07.03.2025	168.285	0,00 %
Transport for London	£ 100.000	3,63 %	15.05.2045	168.022	0,00 %
Gatwick Funding Ltd.	£ 100.000	4,63 %	27.03.2034	165.566	0,00 %
BP Capital Markets plc	CAD 200.000	3,50 %	09.11.2020	164.671	0,00 %
Aviva plc^	£ 100.000	6,13 %	14.11.2036	163.576	0,00 %
Metropolitan Funding plc	£ 100.000	4,13 %	05.04.2048	163.376	0,00 %
Guinness Partnership Ltd.	£ 100.000	4,00 %	24.10.2044	163.200	0,00 %
Anglian Water Services Financing plc	£ 100.000	4,50 %	05.10.2027	163.069	0,00 %
Niagara Mohawk Power Corp.	\$ 150.000	4,12 %	28.11.2042	159.817	0,00 %
HSBC Bank plc	\$ 150.000	4,75 %	19.01.2021	159.404	0,00 %
Aspire Defence Finance plc	£ 93.863	4,67 %	31.03.2040	159.214	0,00 %
WM Morrison Supermarkets plc	£ 100.000	4,75 %	04.07.2029	159.079	0,00 %
London & Quadrant Housing Trust Ltd.	£ 100.000	3,75 %	27.10.2049	158.854	0,00 %
Wellcome Trust Ltd.	£ 130.000	1,13 %	21.01.2027	158.161	0,00 %
Western Power Distribution East Midlands plc	£ 100.000	5,25 %	17.01.2023	158.078	0,00 %
British Telecommunications plc	£ 100.000	8,63 %	26.03.2020	157.381	0,00 %
Legal & General Group plc^	£ 100.000	5,50 %	27.06.2064	157.282	0,00 %
Sky plc	£ 100.000	4,00 %	26.11.2029	156.941	0,00 %
Telereal Securitisation plc	£ 96.309	5,39 %	10.12.2031	156.795	0,00 %
BP Capital Markets plc	\$ 150.000	3,72 %	28.11.2028	156.404	0,00 %
Standard Chartered plc	£ 100.000	4,38 %	18.01.2038	156.379	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Motability Operations Group plc	£ 100.000	3,63 %	10.03.2036	156.320	0,00 %
Vodafone Group plc	\$ 125.000	6,15 %	27.02.2037	156.205	0,00 %
RL Finance Bonds No 2 plc^	£ 100.000	6,13 %	30.11.2043	155.676	0,00 %
CRH Finance UK plc	£ 100.000	4,13 %	02.12.2029	155.666	0,00 %
Firstgroup plc	£ 100.000	5,25 %	29.11.2022	155.555	0,00 %
Aviva plc^	£ 100.000	6,13 %	29.09.2166	155.228	0,00 %
Scottish Widows Ltd.	£ 100.000	5,50 %	16.06.2023	154.606	0,00 %
Lloyds Bank plc	\$ 150.000	3,50 %	14.05.2025	154.574	0,00 %
Yorkshire Water Services Bradford Finance Ltd.	£ 100.000	3,63 %	01.08.2029	154.162	0,00 %
RSA Insurance Group plc^	£ 100.000	5,13 %	10.10.2045	154.141	0,00 %
BUPA Finance plc	£ 100.000	5,00 %	25.04.2023	154.137	0,00 %
Arqiva Financing plc	£ 100.000	4,88 %	31.12.2032	153.836	0,00 %
Next plc	£ 100.000	5,38 %	26.10.2021	153.561	0,00 %
Society of Lloyd's	£ 100.000	4,75 %	30.10.2024	153.502	0,00 %
Santander UK plc	£ 100.000	5,13 %	14.04.2021	153.180	0,00 %
NGG Finance plc^	£ 100.000	5,63 %	18.06.2073	152.893	0,00 %
Manchester Airport Group Funding plc	£ 100.000	4,13 %	02.04.2024	152.820	0,00 %
BAT International Finance plc	£ 100.000	4,00 %	04.09.2026	152.448	0,00 %
Aviva plc^	£ 100.000	5,13 %	04.06.2050	152.354	0,00 %
Barclays Bank plc	\$ 125.000	10,18 %	12.06.2021	152.050	0,00 %
Prudential plc^	£ 100.000	5,00 %	20.07.2055	151.903	0,00 %
CNH Industrial NV	\$ 150.000	3,85 %	15.11.2027	149.625	0,00 %
AstraZeneca plc	\$ 150.000	1,75 %	16.11.2018	149.596	0,00 %
Aviva plc^	£ 100.000	6,13 %	05.07.2043	149.132	0,00 %
Intu Metrocentre Finance plc	£ 100.000	4,13 %	06.12.2023	149.100	0,00 %
BAT International Finance plc	£ 100.000	6,38 %	12.12.2019	148.878	0,00 %
AstraZeneca plc	\$ 150.000	3,13 %	12.06.2027	148.431	0,00 %
Lloyds Bank plc	€ 100.000	4,88 %	13.01.2023	147.669	0,00 %
InterContinental Hotels Group plc	£ 100.000	3,75 %	14.08.2025	147.654	0,00 %
Swan Housing Capital plc	£ 100.000	3,63 %	05.03.2048	146.959	0,00 %
Scotland Gas Networks plc	£ 100.000	3,25 %	08.03.2027	145.789	0,00 %
Orbit Capital plc	£ 100.000	3,50 %	24.03.2045	145.631	0,00 %
Hammerson plc	£ 100.000	3,50 %	27.10.2025	143.980	0,00 %
Centrica plc^	£ 100.000	5,25 %	10.04.2075	143.221	0,00 %
AA Bond Co., Ltd.	£ 105.000	2,88 %	31.01.2022	143.080	0,00 %
Whitbread Group plc	£ 100.000	3,38 %	16.10.2025	142.581	0,00 %
Nationwide Building Society	€ 100.000	4,38 %	28.02.2022	141.247	0,00 %
Vodafone Group plc	€ 100.000	4,65 %	20.01.2022	140.554	0,00 %
SSE plc^	£ 100.000	3,63 %	16.09.2077	139.716	0,00 %
Woods Transmission plc	£ 93.379	3,45 %	24.08.2034	139.274	0,00 %
Lloyds Bank plc	£ 100.000	1,75 %	31.03.2022	138.841	0,00 %
Barclays Bank plc	€ 100.000	6,00 %	14.01.2021	138.653	0,00 %
RELX Investments plc	£ 100.000	2,75 %	01.08.2019	138.175	0,00 %
Imperial Brands Finance plc	€ 100.000	3,38 %	26.02.2026	137.280	0,00 %
BAT International Finance plc	£ 100.000	1,75 %	05.07.2021	137.195	0,00 %
Santander UK plc	€ 100.000	4,25 %	12.04.2021	136.854	0,00 %
HSBC Holdings plc	\$ 100.000	6,80 %	01.06.2038	136.514	0,00 %
Aviva plc^	€ 100.000	3,88 %	03.07.2044	135.473	0,00 %
Nationwide Building Society	€ 100.000	2,25 %	25.06.2029	135.303	0,00 %
AstraZeneca plc	\$ 100.000	6,45 %	15.09.2037	135.150	0,00 %
BAT International Finance plc	€ 100.000	3,63 %	09.11.2021	134.895	0,00 %
Barclays Bank plc	€ 100.000	4,00 %	12.01.2021	134.817	0,00 %
WPP Finance 2013	€ 100.000	3,00 %	20.11.2023	134.715	0,00 %
Standard Chartered plc	€ 100.000	3,63 %	23.11.2022	134.587	0,00 %
Diageo Finance plc	€ 100.000	2,38 %	20.05.2026	133.570	0,00 %
BAT International Finance plc	€ 100.000	2,75 %	25.03.2025	133.403	0,00 %
Royal Bank of Scotland plc	€ 100.000	3,88 %	19.10.2020	133.307	0,00 %
BP Capital Markets plc	\$ 125.000	4,50 %	01.10.2020	132.068	0,00 %
Standard Chartered plc	€ 100.000	3,13 %	19.11.2024	131.767	0,00 %
Royal Bank of Scotland plc	€ 100.000	5,38 %	30.09.2019	131.386	0,00 %
Bank of Scotland plc	€ 100.000	3,88 %	07.02.2020	130.434	0,00 %
HSBC Holdings plc	€ 100.000	6,00 %	10.06.2019	130.230	0,00 %
Aviva plc^	€ 100.000	3,38 %	04.12.2045	130.178	0,00 %
BP AMI Leasing, Inc.	\$ 125.000	5,52 %	08.05.2019	130.135	0,00 %
Cadent Finance plc	£ 100.000	2,63 %	22.09.2038	130.123	0,00 %
Gwynt y Mor OFTO plc	£ 91.400	2,78 %	17.02.2034	129.235	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
BAE Systems Holdings, Inc.	\$ 125.000	3,85 %	15.12.2025	129.003	0,00 %
Anglo American Capital plc	\$ 125.000	4,13 %	15.04.2021	128.594	0,00 %
Leeds Building Society	€ 100.000	2,63 %	01.04.2021	128.226	0,00 %
ELM BV for RELX Finance	€ 100.000	2,50 %	24.09.2020	127.879	0,00 %
Hammerson plc	€ 100.000	2,00 %	01.07.2022	126.661	0,00 %
BP Capital Markets plc	€ 100.000	1,53 %	26.09.2022	126.553	0,00 %
GlaxoSmithKline Capital plc	\$ 125.000	2,85 %	08.05.2022	126.507	0,00 %
Vodafone Group plc	\$ 125.000	2,95 %	19.02.2023	125.701	0,00 %
Babcock International Group plc	€ 100.000	1,75 %	06.10.2022	125.174	0,00 %
Yorkshire Building Society	€ 100.000	1,25 %	11.06.2021	124.983	0,00 %
BP Capital Markets plc	€ 100.000	1,57 %	16.02.2027	124.771	0,00 %
Compass Group plc	€ 100.000	3,13 %	13.02.2019	124.310	0,00 %
BP Capital Markets plc	€ 100.000	2,99 %	18.02.2019	124.299	0,00 %
BP Capital Markets plc	\$ 125.000	2,50 %	06.11.2022	124.181	0,00 %
HSBC Holdings plc^	€ 100.000	3,38 %	10.01.2024	123.979	0,00 %
Niagara Mohawk Power Corp.	\$ 125.000	2,72 %	28.11.2022	123.956	0,00 %
BP Capital Markets plc	€ 100.000	1,11 %	16.02.2023	123.884	0,00 %
Yorkshire Building Society	€ 100.000	2,13 %	18.03.2019	123.223	0,00 %
FCE Bank plc	€ 100.000	1,88 %	18.04.2019	123.012	0,00 %
FCE Bank plc	€ 100.000	1,11 %	13.05.2020	122.909	0,00 %
FCE Bank plc	€ 100.000	1,13 %	10.02.2022	122.720	0,00 %
Santander UK plc	€ 100.000	2,00 %	14.01.2019	122.691	0,00 %
Santander UK plc	€ 100.000	0,88 %	25.11.2020	122.585	0,00 %
Mondi Finance plc	€ 100.000	1,50 %	15.04.2024	122.467	0,00 %
Santander UK plc	€ 100.000	0,88 %	13.01.2020	122.103	0,00 %
Diageo Finance plc	€ 100.000	1,13 %	20.05.2019	121.983	0,00 %
Nationwide Building Society	€ 100.000	0,38 %	30.07.2020	121.705	0,00 %
Nationwide Building Society	€ 100.000	0,13 %	25.01.2021	120.729	0,00 %
Unilever NV	€ 100.000	0,00 %	29.04.2020	120.248	0,00 %
Heathrow Funding Ltd.	€ 100.000	1,50 %	11.02.2030	119.878	0,00 %
Unilever NV	€ 100.000	0,50 %	29.04.2024	119.445	0,00 %
LCR Finance plc	£ 50.000	5,10 %	07.03.2051	118.950	0,00 %
Prudential plc	£ 62.000	5,88 %	11.05.2029	112.797	0,00 %
Nationwide Building Society	\$ 100.000	6,25 %	25.02.2020	107.890	0,00 %
HSBC Holdings plc	\$ 100.000	5,10 %	05.04.2021	107.380	0,00 %
Nats En Route plc	£ 67.600	5,25 %	31.03.2026	106.287	0,00 %
Vodafone Group plc	\$ 100.000	4,38 %	16.03.2021	105.655	0,00 %
United Utilities plc	\$ 100.000	5,38 %	01.02.2019	102.893	0,00 %
WPP Finance 2010	\$ 100.000	3,63 %	07.09.2022	102.882	0,00 %
Eastern Power Networks plc	£ 50.000	6,25 %	12.11.2036	102.068	0,00 %
WPP Finance 2010	\$ 100.000	3,75 %	19.09.2024	101.933	0,00 %
AstraZeneca plc	\$ 100.000	4,00 %	18.09.2042	101.672	0,00 %
Trinity Acquisition plc	\$ 100.000	3,50 %	15.09.2021	101.019	0,00 %
BP Capital Markets plc	\$ 100.000	2,75 %	10.05.2023	100.222	0,00 %
BP Capital Markets plc	\$ 100.000	2,52 %	19.09.2022	99.581	0,00 %
BP Capital Markets plc	\$ 100.000	1,77 %	19.09.2019	99.272	0,00 %
GlaxoSmithKline Capital plc	£ 50.000	5,25 %	10.04.2042	98.392	0,00 %
Network Rail Infrastructure Finance plc	£ 50.000	4,75 %	29.11.2035	96.943	0,00 %
Southern Water Services Finance Ltd.	£ 50.000	6,64 %	31.03.2026	90.920	0,00 %
Sky plc	£ 50.000	6,00 %	21.05.2027	88.358	0,00 %
LCR Finance plc	£ 50.000	4,50 %	07.12.2028	87.247	0,00 %
Standard Life Aberdeen plc^	£ 50.000	6,75 %	12.07.2166	85.081	0,00 %
Broadgate Financing plc	£ 50.000	5,00 %	05.10.2031	83.357	0,00 %
Network Rail Infrastructure Finance plc	£ 50.000	4,75 %	22.01.2024	81.899	0,00 %
Centrica plc	£ 50.000	6,38 %	10.03.2022	80.810	0,00 %
New England Power Co.	\$ 75.000	3,80 %	05.12.2047	76.709	0,00 %
Great Rolling Stock Co., Ltd.	£ 50.000	6,25 %	27.07.2020	75.723	0,00 %
Aviva plc^	£ 50.000	6,88 %	21.05.2166	73.777	0,00 %
GlaxoSmithKline Capital plc	€ 50.000	4,00 %	16.06.2025	73.745	0,00 %
Trinity Acquisition plc	\$ 70.000	4,40 %	15.03.2026	73.060	0,00 %
Mitchells & Butlers Finance plc	£ 46.117	5,57 %	15.12.2030	72.989	0,00 %
Nationwide Building Society	€ 50.000	6,75 %	22.07.2020	69.703	0,00 %
Bank of Scotland plc	€ 50.000	4,50 %	13.07.2021	69.463	0,00 %
Lloyds Bank plc	€ 50.000	6,50 %	24.03.2020	68.421	0,00 %
HSBC Bank plc	€ 50.000	4,00 %	15.01.2021	67.177	0,00 %
BAT International Finance plc	€ 50.000	4,00 %	07.07.2020	65.892	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Barclays Bank plc	€ 50.000	4,00 %	07.10.2019	64.599	0,00 %
Mead Johnson Nutrition Co.	\$ 50.000	5,90 %	01.11.2039	63.285	0,00 %
Santander UK Group Holdings plc	\$ 50.000	4,75 %	15.09.2025	52.413	0,00 %
Lloyds Bank plc	\$ 25.000	6,50 %	14.09.2020	27.345	0,00 %
				442.843.281	4,65 %
USA 39,74 % (2016: 39,88 %)					
US Treasury Note	\$ 70.465.000	1,75 %	15.11.2020	70.057.628	0,74 %
US Treasury Note	\$ 58.362.000	1,50 %	15.08.2020	57.723.666	0,61 %
US Treasury Note	\$ 51.355.000	1,63 %	15.03.2020	51.050.080	0,54 %
US Treasury Note	\$ 49.415.000	1,38 %	30.09.2020	48.658.333	0,51 %
US Treasury Note	\$ 38.500.000	1,88 %	31.10.2022	37.940.549	0,40 %
US Treasury Note	\$ 37.656.000	2,13 %	30.09.2024	37.179.418	0,39 %
US Treasury Note	\$ 35.880.000	1,00 %	15.11.2019	35.302.554	0,37 %
US Treasury Note	\$ 29.899.100	1,63 %	15.10.2020	29.632.813	0,31 %
US Treasury Note	\$ 29.020.000	1,50 %	15.07.2020	28.711.663	0,30 %
Federal National Mortgage Association	\$ 26.285.000	3,50 %	01.01.2048	27.002.580	0,29 %
US Treasury Note	\$ 26.060.000	1,75 %	30.06.2022	25.587.663	0,27 %
US Treasury Note	\$ 23.110.000	2,13 %	30.11.2024	22.803.071	0,24 %
US Treasury Note	\$ 23.030.000	2,00 %	30.04.2024	22.612.581	0,24 %
US Treasury Note	\$ 22.648.000	1,38 %	30.09.2019	22.453.368	0,24 %
US Treasury Note	\$ 22.571.000	1,38 %	15.02.2020	22.324.130	0,24 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 20.805.000	3,50 %	01.01.2048	21.375.057	0,23 %
US Treasury Note	\$ 20.660.000	1,50 %	15.04.2020	20.469.540	0,22 %
Federal National Mortgage Association	\$ 20.236.774	3,00 %	01.11.2046	20.251.575	0,21 %
Federal National Mortgage Association	\$ 18.680.000	4,00 %	01.01.2048	19.534.403	0,21 %
US Treasury Bond	\$ 19.300.000	2,75 %	15.11.2047	19.324.125	0,20 %
US Treasury Note	\$ 18.827.000	2,25 %	31.12.2023	18.785.816	0,20 %
US Treasury Note	\$ 18.872.000	1,50 %	31.05.2020	18.683.280	0,20 %
Government National Mortgage Association	\$ 17.940.000	3,50 %	01.01.2048	18.553.885	0,20 %
US Treasury Note	\$ 18.500.000	0,88 %	15.09.2019	18.190.702	0,19 %
US Treasury Bond	\$ 13.675.000	5,38 %	15.02.2031	18.162.109	0,19 %
US Treasury Note	\$ 18.175.000	2,13 %	31.03.2024	17.987.570	0,19 %
US Treasury Note	\$ 17.200.000	3,13 %	15.05.2019	17.492.937	0,19 %
US Treasury Note	\$ 17.700.000	1,00 %	15.10.2019	17.431.735	0,18 %
US Treasury Note	\$ 17.710.000	2,00 %	30.06.2024	17.361.334	0,18 %
US Treasury Note	\$ 17.370.000	1,25 %	31.10.2021	16.827.188	0,18 %
US Treasury Bond	\$ 14.227.500	3,63 %	15.08.2043	16.603.936	0,18 %
US Treasury Note	\$ 15.150.000	1,38 %	31.01.2020	14.989.031	0,16 %
US Treasury Note	\$ 15.000.000	1,25 %	31.10.2019	14.831.250	0,16 %
US Treasury Note	\$ 15.000.000	0,75 %	15.07.2019	14.749.218	0,16 %
US Treasury Note	\$ 14.721.000	2,25 %	15.11.2027	14.509.386	0,15 %
US Treasury Bond	\$ 15.207.000	2,50 %	15.02.2045	14.496.547	0,15 %
US Treasury Bond	\$ 12.323.000	3,63 %	15.02.2044	14.400.581	0,15 %
Federal National Mortgage Association	\$ 14.222.832	3,00 %	01.01.2047	14.233.299	0,15 %
US Treasury Note	\$ 14.400.000	1,13 %	30.09.2021	13.893.751	0,15 %
US Treasury Note	\$ 14.035.000	2,13 %	31.07.2024	13.866.142	0,15 %
US Treasury Note	\$ 13.465.000	1,50 %	15.06.2020	13.328.247	0,14 %
US Treasury Bond	\$ 9.975.000	4,50 %	15.08.2039	13.025.167	0,14 %
US Treasury Bond	\$ 9.289.000	5,00 %	15.05.2037	12.736.090	0,14 %
US Treasury Note ¹	\$ 12.670.000	1,75 %	30.11.2019	12.638.325	0,13 %
US Treasury Note	\$ 12.200.000	3,63 %	15.02.2020	12.634.625	0,13 %
US Treasury Bond	\$ 12.200.000	2,88 %	15.05.2043	12.531.688	0,13 %
US Treasury Note	\$ 12.665.000	1,75 %	30.09.2022	12.409.722	0,13 %
US Treasury Note	\$ 12.450.000	1,75 %	15.05.2023	12.142.641	0,13 %
US Treasury Note	\$ 12.150.000	2,25 %	31.10.2024	12.087.352	0,13 %
US Treasury Note	\$ 11.600.000	3,63 %	15.08.2019	11.920.812	0,13 %
Government National Mortgage Association	\$ 11.774.353	3,00 %	20.08.2046	11.889.599	0,13 %
US Treasury Note	\$ 11.900.000	1,63 %	31.08.2019	11.851.656	0,13 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 11.175.000	4,00 %	01.01.2048	11.685.732	0,12 %
US Treasury Note	\$ 11.750.000	1,88 %	30.09.2022	11.579.258	0,12 %
US Treasury Note	\$ 11.729.000	1,88 %	31.08.2022	11.564.061	0,12 %
US Treasury Note	\$ 12.100.000	1,38 %	30.06.2023	11.555.500	0,12 %
US Treasury Note	\$ 11.646.000	1,25 %	30.04.2019	11.553.195	0,12 %
US Treasury Note	\$ 11.050.000	3,13 %	15.05.2021	11.435.024	0,12 %
US Treasury Bond	\$ 11.305.000	2,75 %	15.11.2042	11.366.825	0,12 %
US Treasury Note	\$ 11.703.000	1,13 %	31.08.2021	11.304.367	0,12 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
US Treasury Bond	\$ 11.088.000	2,75 %	15.08.2047	11.098.395	0,12 %
Government National Mortgage Association	\$ 10.570.000	4,00 %	01.01.2048	11.020.876	0,12 %
US Treasury Bond	\$ 11.870.000	2,25 %	15.08.2046	10.703.402	0,11 %
Federal National Mortgage Association	\$ 9.665.000	3,00 %	01.01.2033	9.847.728	0,10 %
US Treasury Note	\$ 9.650.000	2,50 %	15.08.2023	9.782.688	0,10 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 9.588.365	3,00 %	01.12.2046	9.596.918	0,10 %
US Treasury Bond	\$ 9.500.000	2,75 %	15.08.2042	9.557.891	0,10 %
US Treasury Note	\$ 9.370.000	1,38 %	31.10.2020	9.217.738	0,10 %
US Treasury Note	\$ 9.234.000	0,75 %	15.02.2019	9.121.461	0,10 %
US Treasury Note	\$ 9.086.300	2,00 %	31.10.2022	9.006.795	0,10 %
US Treasury Bond	\$ 9.450.000	2,50 %	15.05.2046	8.987.836	0,10 %
US Treasury Note	\$ 8.850.000	1,63 %	31.10.2023	8.543.016	0,09 %
Government National Mortgage Association	\$ 8.360.000	3,00 %	01.01.2048	8.435.762	0,09 %
US Treasury Note	\$ 8.519.600	1,75 %	30.11.2021	8.399.793	0,09 %
US Treasury Note	\$ 8.425.000	2,13 %	30.11.2023	8.356.547	0,09 %
US Treasury Note	\$ 8.300.000	2,00 %	28.02.2021	8.293.516	0,09 %
US Treasury Bond	\$ 7.870.000	3,00 %	15.05.2045	8.264.729	0,09 %
US Treasury Note ¹	\$ 7.941.000	2,75 %	15.02.2024	8.148.211	0,09 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 7.849.646	3,00 %	01.01.2047	7.856.666	0,08 %
Federal National Mortgage Association	\$ 7.725.000	2,50 %	01.01.2033	7.716.550	0,08 %
US Treasury Note	\$ 7.738.000	1,13 %	15.01.2019	7.682.383	0,08 %
US Treasury Note	\$ 7.325.000	2,75 %	15.11.2023	7.521.859	0,08 %
US Treasury Bond	\$ 6.125.000	3,88 %	15.08.2040	7.376.797	0,08 %
US Treasury Note	\$ 7.500.000	1,75 %	31.01.2023	7.332.422	0,08 %
US Treasury Note	\$ 7.199.000	2,50 %	15.05.2024	7.279.989	0,08 %
US Treasury Bond	\$ 6.958.000	2,88 %	15.08.2045	7.130.863	0,08 %
US Treasury Note	\$ 7.149.000	0,88 %	15.05.2019	7.056.286	0,08 %
Federal National Mortgage Association	\$ 6.620.000	4,50 %	01.01.2048	7.044.094	0,08 %
US Treasury Bond	\$ 6.676.000	3,00 %	15.11.2045	7.011.886	0,07 %
US Treasury Note	\$ 7.000.000	1,63 %	31.05.2023	6.779.063	0,07 %
US Treasury Note	\$ 6.924.000	1,63 %	15.08.2022	6.758.473	0,07 %
US Treasury Note	\$ 6.716.000	0,88 %	15.06.2019	6.622.606	0,07 %
US Treasury Note	\$ 6.600.000	1,50 %	31.05.2019	6.567.000	0,07 %
US Treasury Note	\$ 6.540.000	2,13 %	29.02.2024	6.474.600	0,07 %
US Treasury Bond	\$ 5.900.000	3,13 %	15.02.2043	6.337.891	0,07 %
Government National Mortgage Association	\$ 6.070.883	3,50 %	20.07.2046	6.285.525	0,07 %
US Treasury Bond	\$ 4.937.000	4,25 %	15.11.2040	6.265.362	0,07 %
US Treasury Bond	\$ 5.000.000	7,63 %	15.11.2022	6.257.813	0,07 %
Federal National Mortgage Association	\$ 5.946.442	3,50 %	01.11.2045	6.118.613	0,07 %
US Treasury Bond	\$ 5.066.000	3,75 %	15.11.2043	6.030.915	0,06 %
US Treasury Note	\$ 5.900.000	2,13 %	31.08.2020	5.927.656	0,06 %
US Treasury Bond	\$ 4.425.000	4,63 %	15.02.2040	5.881.102	0,06 %
US Treasury Note	\$ 5.895.000	1,25 %	31.01.2020	5.818.549	0,06 %
US Treasury Bond	\$ 4.500.000	4,38 %	15.05.2040	5.797.969	0,06 %
US Treasury Note	\$ 5.765.000	1,88 %	31.03.2022	5.699.243	0,06 %
US Treasury Note	\$ 5.800.000	2,00 %	15.02.2025	5.668.594	0,06 %
US Treasury Bond	\$ 5.109.000	8,13 %	15.08.2019	5.613.514	0,06 %
US Treasury Note	\$ 5.500.000	1,50 %	28.02.2019	5.477.656	0,06 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 5.460.000	1,88 %	17.11.2020	5.433.563	0,06 %
US Treasury Note	\$ 5.425.000	1,38 %	28.02.2019	5.395.332	0,06 %
US Treasury Bond	\$ 4.050.000	4,75 %	15.02.2037	5.394.094	0,06 %
US Treasury Note	\$ 5.420.000	1,88 %	31.01.2022	5.363.259	0,06 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 5.114.650	4,00 %	01.01.2046	5.349.004	0,06 %
US Treasury Note	\$ 5.509.000	1,63 %	30.04.2023	5.340.287	0,06 %
US Treasury Note	\$ 5.483.800	1,88 %	31.08.2024	5.334.709	0,06 %
US Treasury Note	\$ 5.423.000	0,75 %	15.08.2019	5.327.250	0,06 %
US Treasury Note	\$ 5.295.000	2,13 %	31.12.2021	5.295.000	0,06 %
US Treasury Note	\$ 5.315.000	1,13 %	31.01.2019	5.275.138	0,06 %
US Treasury Bond	\$ 5.022.000	3,00 %	15.11.2044	5.273.884	0,06 %
US Treasury Bond	\$ 3.865.000	4,75 %	15.02.2041	5.243.718	0,06 %
US Treasury Note	\$ 5.325.000	1,63 %	15.11.2022	5.187.715	0,06 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 5.131.412	3,00 %	01.09.2045	5.143.914	0,06 %
US Treasury Note	\$ 5.360.000	1,38 %	30.09.2023	5.104.563	0,05 %
US Treasury Note	\$ 4.850.000	3,50 %	15.05.2020	5.026.570	0,05 %
US Treasury Note	\$ 5.075.000	1,38 %	15.01.2020	5.022.664	0,05 %
US Treasury Note	\$ 5.000.000	2,25 %	31.01.2024	4.988.281	0,05 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
US Treasury Bond	\$ 3.850.000	4,38 %	15.05.2041	4.979.133	0,05 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 4.635.000	4,50 %	01.01.2048	4.926.860	0,05 %
US Treasury Note	\$ 4.935.000	1,63 %	31.12.2019	4.908.783	0,05 %
US Treasury Note	\$ 5.065.000	1,13 %	30.06.2021	4.904.344	0,05 %
US Treasury Bond	\$ 4.000.000	6,25 %	15.08.2023	4.842.500	0,05 %
US Treasury Note	\$ 5.000.000	1,50 %	28.02.2023	4.824.219	0,05 %
US Treasury Note	\$ 4.753.000	1,38 %	15.12.2019	4.706.955	0,05 %
US Treasury Bond	\$ 3.600.000	4,50 %	15.02.2036	4.635.000	0,05 %
Government National Mortgage Association	\$ 4.394.302	3,50 %	20.05.2046	4.546.974	0,05 %
US Treasury Note	\$ 4.361.000	1,50 %	31.10.2019	4.331.699	0,05 %
Government National Mortgage Association	\$ 4.110.000	4,50 %	01.01.2048	4.311.647	0,05 %
Government National Mortgage Association	\$ 4.221.463	3,00 %	20.12.2046	4.262.919	0,05 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 4.138.831	3,50 %	01.12.2044	4.256.536	0,05 %
US Treasury Bond	\$ 3.956.000	3,13 %	15.02.2042	4.250.228	0,05 %
US Treasury Note	\$ 4.289.000	1,75 %	31.03.2022	4.217.963	0,05 %
US Treasury Note	\$ 4.250.000	2,00 %	15.02.2023	4.205.508	0,05 %
US Treasury Note	\$ 4.247.000	1,38 %	30.04.2020	4.194.576	0,05 %
US Treasury Note	\$ 4.225.000	1,13 %	31.12.2019	4.162.285	0,05 %
US Treasury Note	\$ 4.145.000	2,13 %	15.08.2021	4.150.181	0,04 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 4.065.000	3,00 %	01.01.2033	4.140.584	0,04 %
US Treasury Note	\$ 4.275.000	1,50 %	31.03.2023	4.120.699	0,04 %
Federal National Mortgage Association	\$ 4.087.882	2,50 %	01.11.2031	4.085.138	0,04 %
US Treasury Bond	\$ 2.900.000	6,25 %	15.05.2030	4.075.406	0,04 %
US Treasury Bond	\$ 3.779.000	3,13 %	15.11.2041	4.060.063	0,04 %
US Treasury Bond	\$ 3.200.000	5,25 %	15.11.2028	4.059.000	0,04 %
US Treasury Note	\$ 4.035.000	1,88 %	31.12.2019	4.034.370	0,04 %
US Treasury Note	\$ 4.000.000	2,13 %	31.12.2022	3.983.125	0,04 %
US Treasury Bond	\$ 3.100.000	4,38 %	15.02.2038	3.961.219	0,04 %
Federal National Mortgage Association	\$ 3.927.835	2,50 %	01.12.2031	3.925.202	0,04 %
US Treasury Note	\$ 3.856.000	1,63 %	30.04.2019	3.844.552	0,04 %
US Treasury Note	\$ 3.827.000	2,00 %	31.05.2021	3.819.824	0,04 %
Government National Mortgage Association	\$ 3.680.000	3,50 %	01.01.2048	3.804.775	0,04 %
US Treasury Note	\$ 3.825.000	1,25 %	31.05.2019	3.793.324	0,04 %
US Treasury Note	\$ 4.000.000	1,25 %	31.07.2023	3.790.000	0,04 %
US Treasury Note	\$ 3.800.000	1,63 %	30.06.2020	3.772.094	0,04 %
US Treasury Note	\$ 3.750.000	2,13 %	30.09.2021	3.751.758	0,04 %
US Treasury Bond	\$ 3.035.000	7,13 %	15.02.2023	3.750.122	0,04 %
US Treasury Note	\$ 3.821.000	1,25 %	31.03.2021	3.726.669	0,04 %
US Treasury Note	\$ 3.700.000	2,13 %	30.06.2022	3.691.906	0,04 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 3.695.570	2,50 %	01.12.2031	3.691.399	0,04 %
US Treasury Note	\$ 3.600.000	2,00 %	31.08.2021	3.587.625	0,04 %
US Treasury Note	\$ 3.347.000	3,38 %	15.11.2019	3.439.043	0,04 %
Bank of America Corp.^	\$ 3.440.000	3,42 %	20.12.2028	3.432.635	0,04 %
US Treasury Bond	\$ 2.825.000	3,75 %	15.08.2041	3.345.859	0,04 %
GS Mortgage Securities Trust 2013^	\$ 3.105.000	4,06 %	10.07.2046	3.319.897	0,04 %
US Treasury Note	\$ 3.358.000	1,38 %	31.03.2020	3.319.173	0,04 %
Government National Mortgage Association	\$ 3.175.467	3,50 %	20.06.2046	3.293.124	0,04 %
Government National Mortgage Association	\$ 3.231.819	3,00 %	20.09.2046	3.263.460	0,04 %
Government National Mortgage Association	\$ 3.103.312	3,50 %	20.03.2045	3.221.199	0,04 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 3.185.818	3,00 %	01.02.2047	3.188.670	0,03 %
US Treasury Bond	\$ 2.425.000	5,50 %	15.08.2028	3.121.051	0,03 %
US Treasury Bond	\$ 2.904.000	3,13 %	15.08.2044	3.117.263	0,03 %
US Treasury Note	\$ 3.059.000	2,63 %	15.08.2020	3.112.055	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 2.800.000	5,75 %	24.01.2022	3.096.369	0,03 %
US Treasury Note	\$ 3.113.800	1,75 %	31.12.2020	3.091.906	0,03 %
US Treasury Note ¹	\$ 3.135.000	1,13 %	28.02.2021	3.047.808	0,03 %
American Express Credit Corp.	\$ 3.000.000	3,30 %	03.05.2027	3.028.686	0,03 %
US Treasury Bond	\$ 2.700.000	3,38 %	15.05.2044	3.026.531	0,03 %
US Treasury Note	\$ 3.000.000	2,25 %	31.07.2021	3.016.875	0,03 %
US Treasury Note	\$ 3.025.000	0,88 %	15.04.2019	2.987.660	0,03 %
Morgan Stanley	\$ 3.000.000	2,63 %	17.11.2021	2.982.753	0,03 %
Federal Home Loan Banks	\$ 3.000.000	1,25 %	16.01.2019	2.982.690	0,03 %
Federal Home Loan Banks	\$ 3.000.000	1,38 %	28.05.2019	2.978.943	0,03 %
US Treasury Note	\$ 3.000.000	2,00 %	31.07.2022	2.977.031	0,03 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 3.000.000	1,13 %	15.04.2019	2.971.974	0,03 %
US Treasury Note	\$ 2.925.000	1,88 %	31.05.2022	2.891.180	0,03 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 2.495.000	4,90 %	01.02.2046	2.888.479	0,03 %
US Treasury Bond	\$ 2.200.000	4,38 %	15.11.2039	2.829.750	0,03 %
US Treasury Note	\$ 2.775.000	2,25 %	31.03.2021	2.793.211	0,03 %
Government National Mortgage Association	\$ 2.754.190	3,00 %	20.01.2047	2.781.241	0,03 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 2.680.000	3,30 %	01.02.2023	2.739.826	0,03 %
Morgan Stanley	\$ 2.700.000	2,65 %	27.01.2020	2.710.851	0,03 %
Government National Mortgage Association	\$ 2.654.114	3,00 %	20.01.2043	2.696.396	0,03 %
Government National Mortgage Association	\$ 2.546.759	3,50 %	20.10.2042	2.649.288	0,03 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 2.610.000	2,65 %	01.02.2021	2.622.682	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 2.605.000	3,30 %	01.04.2026	2.615.308	0,03 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 2.532.825	3,50 %	01.12.2045	2.602.583	0,03 %
Federal National Mortgage Association	\$ 2.532.016	3,50 %	01.08.2045	2.601.336	0,03 %
Government National Mortgage Association	\$ 2.552.674	3,00 %	20.10.2046	2.577.667	0,03 %
Bank of America Corp.	\$ 2.500.000	3,30 %	11.01.2023	2.557.917	0,03 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 2.475.000	3,60 %	15.10.2020	2.526.992	0,03 %
US Treasury Bond	\$ 2.650.000	2,50 %	15.02.2046	2.521.641	0,03 %
PNC Bank NA	\$ 2.500.000	1,80 %	05.11.2018	2.496.590	0,03 %
Federal Home Loan Banks	\$ 2.500.000	1,88 %	29.11.2021	2.473.512	0,03 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 2.347.355	4,00 %	01.08.2047	2.456.646	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 2.000.000	1,38 %	15.05.2024	2.451.539	0,03 %
Apple, Inc. ¹	\$ 2.100.000	4,65 %	23.02.2046	2.449.457	0,03 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 2.500.000	1,13 %	12.08.2021	2.412.347	0,03 %
US Treasury Note	\$ 2.457.000	2,00 %	31.05.2024	2.410.547	0,03 %
US Treasury Note	\$ 2.425.000	1,13 %	31.05.2019	2.400.750	0,03 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 2.325.000	3,65 %	01.02.2026	2.398.168	0,03 %
US Treasury Note	\$ 2.282.000	3,63 %	15.02.2021	2.392.891	0,03 %
US Treasury Note	\$ 2.400.000	1,50 %	30.11.2019	2.382.750	0,03 %
US Treasury Note	\$ 2.405.000	1,88 %	28.02.2022	2.378.695	0,03 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 2.375.000	3,00 %	01.01.2048	2.374.628	0,03 %
Government National Mortgage Association	\$ 2.289.495	3,50 %	20.07.2045	2.374.139	0,03 %
Medtronic, Inc.	\$ 2.081.000	4,38 %	15.03.2035	2.342.415	0,03 %
Federal National Mortgage Association	\$ 2.266.116	3,50 %	01.07.2043	2.337.401	0,03 %
US Treasury Bond	\$ 2.020.000	3,50 %	15.02.2039	2.305.009	0,03 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 2.215.711	3,50 %	01.03.2046	2.290.487	0,03 %
US Treasury Bond	\$ 1.799.000	4,25 %	15.05.2039	2.272.924	0,03 %
Tyson Foods, Inc.	\$ 2.125.000	4,50 %	15.06.2022	2.268.276	0,03 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 2.225.000	3,25 %	15.06.2027	2.265.958	0,03 %
Wells Fargo & Co.	\$ 2.250.000	2,55 %	07.12.2020	2.258.267	0,03 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 2.241.646	2,50 %	01.12.2030	2.239.117	0,02 %
Citigroup, Inc.	\$ 2.100.000	4,50 %	14.01.2022	2.234.154	0,02 %
US Treasury Bond	\$ 1.625.000	6,13 %	15.08.2029	2.229.551	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 2.025.375	5,50 %	01.06.2038	2.226.974	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 2.115.000	6,30 %	23.04.2019	2.226.655	0,02 %
Citigroup, Inc.	\$ 2.100.000	4,45 %	29.09.2027	2.214.612	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 2.177.781	3,00 %	20.07.2045	2.199.047	0,02 %
US Bancorp	€ 1.819.000	0,85 %	07.06.2024	2.194.349	0,02 %
Morgan Stanley	\$ 2.100.000	4,00 %	23.07.2025	2.191.209	0,02 %
Federal Home Loan Banks	\$ 2.200.000	1,50 %	21.10.2019	2.183.179	0,02 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	\$ 2.150.000	4,20 %	15.03.2028	2.182.250	0,02 %
Morgan Stanley [^]	€ 1.800.000	1,34 %	23.10.2026	2.158.673	0,02 %
US Treasury Bond	\$ 2.050.000	3,00 %	15.05.2042	2.156.664	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 2.125.000	3,50 %	23.01.2025	2.151.467	0,02 %
US Treasury Note	\$ 2.175.000	1,75 %	30.04.2022	2.137.277	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 2.053.212	3,50 %	01.09.2043	2.118.775	0,02 %
Basin Electric Power Cooperative	\$ 1.900.000	4,75 %	26.04.2047	2.118.591	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 2.029.804	3,50 %	20.04.2045	2.106.911	0,02 %
US Treasury Note	\$ 2.200.000	1,38 %	31.08.2023	2.097.219	0,02 %
GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	\$ 1.933.000	4,42 %	15.11.2035	2.091.232	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 2.068.475	3,00 %	20.10.2045	2.088.673	0,02 %
US Treasury Note	\$ 2.105.000	1,63 %	30.11.2020	2.083.621	0,02 %
Bank of America Corp. [^]	€ 1.700.000	0,74 %	07.02.2022	2.072.299	0,02 %
Wells Fargo & Co.	£ 1.500.000	2,13 %	20.12.2023	2.068.898	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 2.062.117	3,00 %	01.09.2046	2.063.956	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.983.207	3,50 %	01.04.2042	2.049.890	0,02 %
US Treasury Note	\$ 2.048.000	2,00 %	30.11.2022	2.029.760	0,02 %
Microsoft Corp.	\$ 2.000.000	2,38 %	12.02.2022	2.020.362	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal National Mortgage Association	\$ 1.999.980	2,50 %	01.04.2028	2.018.976	0,02 %
Bank of America Corp.	\$ 2.000.000	2,65 %	01.04.2019	2.013.810	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 2.000.000	3,13 %	23.01.2025	2.007.608	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 2.000.000	1,50 %	30.07.2020	1.974.544	0,02 %
US Treasury Bond	\$ 1.829.000	8,88 %	15.02.2019	1.973.034	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 2.000.000	1,00 %	28.08.2019	1.970.372	0,02 %
Morgan Stanley	€ 1.598.000	1,00 %	02.12.2022	1.958.171	0,02 %
Federal Home Loan Banks	\$ 1.975.000	1,38 %	15.11.2019	1.954.490	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.893.386	3,50 %	01.01.2044	1.953.966	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.935.066	3,00 %	01.07.2043	1.947.542	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.906.700	3,00 %	01.12.2036	1.939.919	0,02 %
US Treasury Note	\$ 1.946.000	1,25 %	31.03.2019	1.931.405	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.859.999	3,50 %	01.03.2046	1.911.820	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 2.025.000	1,88 %	24.09.2026	1.910.314	0,02 %
Bank of America Corp.	\$ 1.275.000	7,75 %	14.05.2038	1.909.742	0,02 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 1.900.000	1,90 %	01.02.2019	1.896.099	0,02 %
Johnson & Johnson	\$ 1.900.000	2,25 %	03.03.2022	1.893.620	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.808.141	3,50 %	20.07.2042	1.882.024	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.897.000	1,50 %	28.02.2020	1.878.140	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.838.033	3,00 %	01.09.2032	1.875.691	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 1.400.000	6,75 %	01.10.2037	1.874.565	0,02 %
US Treasury Note	\$ 1.900.000	1,25 %	29.02.2020	1.874.469	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.802.084	3,50 %	20.09.2045	1.868.780	0,02 %
Intel Corp.	\$ 1.800.000	3,30 %	01.10.2021	1.862.566	0,02 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 1.650.000	4,70 %	01.02.2036	1.851.224	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.764.316	4,00 %	20.12.2045	1.848.003	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.818.841	3,00 %	20.12.2042	1.847.812	0,02 %
Allergan Funding SCS	\$ 1.810.000	3,80 %	15.03.2025	1.835.411	0,02 %
General Electric Co.	\$ 1.422.000	5,88 %	14.01.2038	1.834.380	0,02 %
CF Industries, Inc.	\$ 1.820.000	3,40 %	01.12.2021	1.828.938	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.779.908	3,00 %	01.01.2027	1.821.881	0,02 %
US Treasury Bond	\$ 1.400.000	4,50 %	15.05.2038	1.819.344	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.763.546	3,50 %	01.10.2045	1.810.091	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.727.148	4,00 %	01.05.2047	1.806.579	0,02 %
Berkshire Hathaway, Inc.	\$ 1.815.000	2,20 %	15.03.2021	1.804.704	0,02 %
US Treasury Note	\$ 1.811.000	1,38 %	29.02.2020	1.790.626	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	€ 1.500.000	0,63 %	25.01.2024	1.788.878	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.709.505	4,00 %	20.08.2045	1.785.271	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.702.277	4,00 %	20.10.2043	1.783.911	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.703.487	4,00 %	01.10.2045	1.781.148	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.753.415	3,00 %	20.07.2043	1.777.030	0,02 %
Apple, Inc.	CAD 2.250.000	2,51 %	19.08.2024	1.774.626	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.699.331	4,00 %	20.03.2047	1.771.823	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.652.946	4,00 %	01.12.2045	1.749.784	0,02 %
Energy Transfer LP	\$ 1.750.000	4,05 %	15.03.2025	1.748.350	0,02 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	\$ 1.775.000	2,88 %	23.09.2023	1.738.724	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.674.184	3,50 %	20.01.2046	1.736.168	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.662.994	3,50 %	20.05.2045	1.724.435	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.200.000	6,75 %	15.03.2031	1.712.790	0,02 %
Abbott Laboratories	\$ 1.500.000	4,90 %	30.11.2046	1.712.142	0,02 %
US Treasury Note	\$ 1.704.000	2,13 %	31.01.2021	1.709.591	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.635.075	3,50 %	20.06.2042	1.701.882	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 1.650.000	3,45 %	15.03.2021	1.698.150	0,02 %
US Treasury Note	\$ 1.700.000	1,63 %	31.03.2019	1.695.219	0,02 %
US Treasury Note	\$ 1.719.000	0,88 %	31.07.2019	1.692.946	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 1.675.000	3,00 %	26.04.2022	1.681.680	0,02 %
Capital One Financial Corp.	\$ 1.675.000	3,05 %	09.03.2022	1.681.264	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.658.996	3,00 %	20.09.2042	1.678.604	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.627.507	3,50 %	01.10.2047	1.672.647	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.675.000	2,00 %	05.10.2022	1.654.339	0,02 %
Applied Materials, Inc.	\$ 1.550.000	3,90 %	01.10.2025	1.646.322	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.550.893	4,00 %	01.09.2040	1.628.089	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	AUD 2.000.000	5,00 %	21.08.2019	1.624.433	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.559.574	3,50 %	20.10.2045	1.617.287	0,02 %
US Treasury Note	\$ 1.630.000	1,63 %	31.07.2020	1.617.266	0,02 %
Bank of America Corp. ¹	\$ 1.600.000	2,63 %	19.10.2020	1.612.282	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.600.000	2,38 %	13.01.2022	1.610.450	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.472.270	5,00 %	01.12.2043	1.591.233	0,02 %
Morgan Stanley	\$ 1.600.000	2,75 %	19.05.2022	1.590.680	0,02 %
Kinder Morgan, Inc.	\$ 1.525.000	4,30 %	01.06.2025	1.587.363	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.556.114	3,00 %	20.04.2043	1.580.899	0,02 %
AT&T, Inc.	\$ 1.500.000	4,60 %	15.02.2021	1.579.332	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	AUD 2.000.000	4,05 %	17.02.2025	1.571.400	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.560.949	3,00 %	01.05.2043	1.567.884	0,02 %
Microsoft Corp.	\$ 1.400.000	4,10 %	06.02.2037	1.563.219	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.491.939	4,00 %	01.09.2047	1.562.339	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 1.500.000	4,25 %	21.10.2025	1.562.155	0,02 %
Schlumberger Investment SA	\$ 1.525.000	3,30 %	14.09.2021	1.561.769	0,02 %
DDR Corp.	\$ 1.500.000	4,70 %	01.06.2027	1.560.783	0,02 %
General Electric Co.	€ 1.300.000	0,38 %	17.05.2022	1.558.856	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.505.000	3,50 %	01.01.2033	1.553.207	0,02 %
Duke Energy Corp.	\$ 1.600.000	1,80 %	01.09.2021	1.552.570	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 1.550.000	2,55 %	01.03.2021	1.551.716	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.491.996	3,50 %	20.08.2045	1.547.196	0,02 %
Southwestern Electric Power Co.	\$ 1.500.000	3,90 %	01.04.2045	1.537.157	0,02 %
Wells Fargo & Co. [^]	\$ 1.500.000	3,58 %	22.05.2028	1.528.685	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.520.802	3,00 %	01.07.2046	1.521.915	0,02 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 1.500.000	3,70 %	28.03.2022	1.517.280	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.461.967	3,50 %	20.03.2046	1.516.108	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.447.805	4,00 %	01.04.2047	1.514.356	0,02 %
Bank of America Corp.	\$ 1.455.000	4,00 %	22.01.2025	1.513.535	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 1.375.000	5,25 %	16.03.2037	1.511.472	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.521.000	1,13 %	14.12.2018	1.511.129	0,02 %
PNC Bank NA	\$ 1.500.000	2,63 %	17.02.2022	1.500.726	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.438.951	3,50 %	20.07.2043	1.496.898	0,02 %
Branch Banking & Trust Co.	\$ 1.500.000	2,10 %	15.01.2020	1.494.987	0,02 %
US Treasury Note	\$ 1.500.000	1,50 %	31.03.2019	1.493.438	0,02 %
Apollo Management Holdings LP	\$ 1.425.000	4,40 %	27.05.2026	1.492.142	0,02 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	\$ 1.500.000	1,92 %	07.04.2022	1.492.111	0,02 %
Wells Fargo & Co.	\$ 1.500.000	2,63 %	22.07.2022	1.491.242	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.476.055	3,00 %	20.06.2046	1.490.499	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.450.234	3,50 %	01.07.2047	1.490.145	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.381.629	5,00 %	01.08.2044	1.484.524	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.500.000	1,63 %	29.09.2020	1.483.905	0,02 %
Praxair, Inc.	\$ 1.500.000	2,20 %	15.08.2022	1.480.820	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.425.986	3,50 %	20.02.2046	1.478.812	0,02 %
Apple, Inc.	€ 1.200.000	1,38 %	24.05.2029	1.473.013	0,02 %
US Treasury Note	\$ 1.495.000	1,38 %	31.01.2021	1.466.502	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.403.670	3,50 %	20.01.2043	1.460.203	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.393.661	4,00 %	01.05.2047	1.458.590	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 1.480.000	4,52 %	15.09.2048	1.457.732	0,02 %
Monsanto Co.	\$ 1.450.000	2,75 %	15.07.2021	1.452.192	0,02 %
Federal Home Loan Banks	\$ 1.500.000	1,13 %	14.07.2021	1.449.001	0,02 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 1.401.063	3,50 %	01.03.2045	1.440.907	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.387.389	3,50 %	20.12.2044	1.440.201	0,02 %
US Treasury Bond	\$ 1.086.000	6,13 %	15.11.2027	1.438.611	0,02 %
State of Illinois	\$ 1.440.000	5,10 %	01.06.2033	1.437.610	0,02 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 1.375.000	4,42 %	15.06.2021	1.432.776	0,02 %
Cintas Corp. No 2	\$ 1.375.000	3,70 %	01.04.2027	1.429.095	0,02 %
US Treasury Bond	\$ 1.054.000	7,63 %	15.02.2025	1.418.948	0,02 %
Intel Corp.	\$ 1.359.000	3,73 %	08.12.2047	1.416.155	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.377.261	3,50 %	01.06.2046	1.415.219	0,02 %
US Treasury Note	\$ 1.427.000	1,00 %	30.06.2019	1.409.385	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.346.549	4,00 %	20.08.2047	1.408.050	0,02 %
Newell Brands Inc.	\$ 1.350.000	4,20 %	01.04.2026	1.407.821	0,02 %
GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	\$ 1.412.000	2,34 %	15.11.2020	1.406.274	0,02 %
Morgan Stanley	\$ 1.400.000	2,50 %	24.01.2019	1.405.622	0,02 %
McKesson Corp.	\$ 1.405.000	2,28 %	15.03.2019	1.405.326	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.338.724	4,00 %	01.03.2047	1.400.173	0,02 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 1.400.000	2,20 %	28.02.2021	1.393.438	0,02 %
Wells Fargo & Co.	\$ 1.325.000	4,10 %	03.06.2026	1.390.932	0,02 %
Morgan Stanley	\$ 1.325.000	4,35 %	08.09.2026	1.387.940	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.406.000	1,38 %	20.04.2020	1.386.862	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.332.364	3,50 %	20.05.2043	1.386.019	0,02 %
Citigroup, Inc.	\$ 1.400.000	3,20 %	21.10.2026	1.385.703	0,02 %
Brandywine Operating Partnership LP	\$ 1.400.000	3,95 %	15.11.2027	1.384.790	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.366.500	2,50 %	01.05.2028	1.378.432	0,02 %
Fidelity National Information Services, Inc.	\$ 1.400.000	2,25 %	15.08.2021	1.377.715	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.306.367	4,00 %	01.12.2041	1.374.161	0,02 %
US Treasury Note	\$ 1.449.000	1,63 %	15.02.2026	1.367.947	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.326.191	3,50 %	01.09.2047	1.362.973	0,02 %
US Treasury Bond	\$ 1.067.000	5,25 %	15.02.2029	1.358.424	0,02 %
Medtronic, Inc. ¹	\$ 1.350.000	2,50 %	15.03.2020	1.357.213	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.352.004	3,00 %	01.08.2046	1.352.993	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.300.000	3,41 %	25.12.2026	1.351.285	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	£ 1.000.000	2,25 %	06.09.2024	1.346.865	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.302.949	3,50 %	01.05.2042	1.346.748	0,02 %
Apple, Inc.	¥ 150.000.000	0,35 %	10.06.2020	1.341.095	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.314.702	3,00 %	01.11.2030	1.339.614	0,02 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.293.712	3,50 %	20.10.2047	1.338.940	0,02 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 1.350.000	2,50 %	15.07.2022	1.338.278	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 1.327.000	2,25 %	23.01.2020	1.325.960	0,02 %
Amgen, Inc.	\$ 1.220.000	4,40 %	01.05.2045	1.325.428	0,02 %
Pfizer, Inc.	€ 1.100.000	0,25 %	06.03.2022	1.320.906	0,02 %
AT&T, Inc.	\$ 1.425.000	4,35 %	15.06.2045	1.320.794	0,02 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 1.250.000	4,40 %	15.10.2022	1.313.455	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.275.595	3,50 %	01.09.2045	1.312.504	0,02 %
CD 2016-CD2 Mortgage Trust [^]	\$ 1.265.000	3,53 %	10.11.2049	1.305.746	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 1.231.000	4,86 %	21.08.2046	1.283.235	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.210.486	4,00 %	01.09.2044	1.267.656	0,01 %
Bank of America Corp.	\$ 1.255.000	2,63 %	19.04.2021	1.261.404	0,01 %
Comcast Corp.	\$ 1.250.000	3,00 %	01.02.2024	1.259.372	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 1.250.000	3,90 %	14.08.2027	1.258.495	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.198.349	4,00 %	20.02.2041	1.250.771	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.241.881	3,00 %	01.02.2037	1.250.344	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.201.320	3,50 %	20.04.2043	1.249.676	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.171.028	4,50 %	20.08.2041	1.248.895	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 1.238.000	2,95 %	15.03.2022	1.245.341	0,01 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 1.175.000	4,91 %	23.07.2025	1.242.817	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.200.730	3,50 %	01.10.2045	1.241.233	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.159.025	4,50 %	01.05.2041	1.240.142	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.195.330	3,50 %	01.02.2041	1.238.086	0,01 %
Citibank NA	\$ 1.250.000	2,13 %	20.10.2020	1.237.094	0,01 %
GS Mortgage Securities Trust 2017	\$ 1.213.000	3,43 %	10.08.2050	1.235.319	0,01 %
JPMorgan Chase & Co. [^]	€ 1.000.000	1,64 %	18.05.2028	1.232.469	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.181.389	3,50 %	20.08.2044	1.226.388	0,01 %
Omnicom Group, Inc.	\$ 1.200.000	3,65 %	01.11.2024	1.224.384	0,01 %
AT&T, Inc.	£ 900.000	3,55 %	14.09.2037	1.223.639	0,01 %
Wells Fargo & Co.	€ 1.000.000	1,38 %	26.10.2026	1.222.861	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 1.200.000	3,38 %	01.05.2023	1.220.065	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 1.200.000	3,34 %	18.03.2021	1.218.384	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.169.779	3,50 %	20.05.2042	1.217.601	0,01 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 1.040.000	6,48 %	23.10.2045	1.216.006	0,01 %
Berkshire Hathaway, Inc.	€ 1.000.000	0,50 %	13.03.2020	1.212.886	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 1.150.000	4,15 %	15.03.2024	1.210.659	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.175.659	3,50 %	01.04.2045	1.209.085	0,01 %
AT&T, Inc.	€ 1.000.000	2,35 %	04.09.2029	1.207.621	0,01 %
Morgan Stanley	\$ 1.150.000	3,88 %	29.04.2024	1.199.803	0,01 %
John Deere Cash Management SA	€ 1.000.000	0,50 %	15.09.2023	1.198.086	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.184.650	3,00 %	20.01.2046	1.196.234	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.146.832	4,00 %	20.01.2047	1.196.024	0,01 %
AbbVie, Inc.	\$ 1.175.000	3,20 %	06.11.2022	1.193.198	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 1.150.000	3,30 %	22.04.2024	1.192.796	0,01 %
FirstEnergy Transmission LLC	\$ 1.000.000	5,45 %	15.07.2044	1.192.737	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 1.050.000	4,80 %	08.07.2044	1.189.592	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 1.161.000	5,01 %	21.08.2054	1.188.221	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.146.494	3,50 %	01.01.2045	1.185.102	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 1.000.000	4,85 %	01.02.2044	1.184.716	0,01 %
McDonald's Corp.	€ 1.000.000	1,50 %	28.11.2029	1.184.149	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 1.175.000	2,95 %	15.11.2024	1.183.388	0,01 %
PNC Bank NA	\$ 1.180.000	2,40 %	18.10.2019	1.181.296	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	€ 1.000.000	0,63 %	08.11.2024	1.179.726	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.130.000	4,00 %	01.12.2047	1.178.834	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 1.100.000	5,50 %	01.03.2044	1.175.722	0,01 %
Baxter International, Inc.	€ 964.000	1,30 %	30.05.2025	1.171.115	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 1.125.000	4,20 %	01.03.2021	1.168.415	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.113.004	4,00 %	20.10.2045	1.165.754	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 1.170.000	1,85 %	22.03.2019	1.165.453	0,01 %
Reliance Standard Life Global Funding II	\$ 1.150.000	3,05 %	20.01.2021	1.163.214	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.200.000	2,13 %	24.04.2026	1.162.489	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.108.352	4,00 %	20.03.2045	1.160.146	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.094.967	4,00 %	01.02.2041	1.152.807	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 1.100.000	3,79 %	15.09.2048	1.151.194	0,01 %
Phillips 66	\$ 1.000.000	4,88 %	15.11.2044	1.139.063	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.083.345	4,00 %	20.12.2040	1.135.363	0,01 %
Medtronic, Inc.	\$ 975.000	4,63 %	15.03.2045	1.131.772	0,01 %
American Express Co.	\$ 1.100.000	3,63 %	05.12.2024	1.130.840	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.085.166	3,50 %	20.03.2043	1.128.857	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.113.210	2,50 %	01.08.2027	1.122.926	0,01 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates	\$ 1.095.000	3,24 %	25.04.2027	1.122.922	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.116.022	2,50 %	01.04.2027	1.122.672	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.060.522	4,00 %	01.07.2044	1.122.530	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.101.850	3,00 %	15.12.2045	1.114.388	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.114.182	2,50 %	01.02.2032	1.112.923	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.063.107	4,00 %	01.05.2047	1.112.010	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.043.849	4,50 %	01.07.2047	1.110.497	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.110.623	2,50 %	01.11.2031	1.109.878	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	AUD 1.400.000	4,05 %	10.12.2018	1.109.072	0,01 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 1.000.000	6,02 %	15.06.2026	1.102.618	0,01 %
AbbVie, Inc.	\$ 1.100.000	2,00 %	06.11.2018	1.099.504	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.051.202	4,00 %	01.02.2047	1.099.404	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.060.947	3,50 %	20.08.2047	1.098.148	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 1.000.000	4,25 %	15.04.2047	1.098.131	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.100.000	1,75 %	12.09.2019	1.096.832	0,01 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 1.050.000	4,46 %	23.07.2022	1.092.950	0,01 %
Discovery Communications LLC	\$ 1.025.000	4,90 %	11.03.2026	1.092.178	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.082.468	2,50 %	01.07.2028	1.091.923	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.058.984	3,50 %	01.01.2042	1.091.744	0,01 %
NBCUniversal Media LLC	\$ 1.000.000	4,45 %	15.01.2043	1.090.214	0,01 %
Activision Blizzard, Inc.	\$ 1.100.000	2,30 %	15.09.2021	1.086.700	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.049.397	3,50 %	20.12.2047	1.086.072	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.017.320	4,50 %	20.04.2041	1.084.916	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 1.100.000	3,40 %	15.05.2025	1.082.731	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.052.968	3,50 %	01.05.2047	1.081.889	0,01 %
General Electric Co.	€ 900.000	1,50 %	17.05.2029	1.081.228	0,01 %
Progressive Corp.	\$ 1.000.000	4,13 %	15.04.2047	1.080.587	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.029.042	4,00 %	01.01.2041	1.080.388	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.032.836	4,00 %	01.10.2045	1.080.194	0,01 %
Liberty Mutual Group, Inc.	\$ 1.000.000	4,95 %	01.05.2022	1.079.197	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.029.271	4,00 %	20.06.2045	1.077.481	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.057.816	3,00 %	01.11.2036	1.076.429	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.034.222	3,50 %	20.06.2045	1.072.445	0,01 %
ONEOK Partners LP	\$ 1.000.000	5,00 %	15.09.2023	1.071.264	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.041.317	3,50 %	01.03.2046	1.070.337	0,01 %
US Treasury Note	\$ 1.067.000	2,00 %	30.11.2020	1.068.000	0,01 %
Principal Financial Group, Inc.	\$ 1.075.000	3,10 %	15.11.2026	1.061.458	0,01 %
GS Mortgage Securities Trust 2014	\$ 1.000.000	3,93 %	10.09.2047	1.059.490	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 1.010.000	5,01 %	15.04.2049	1.058.945	0,01 %
Teachers Insurance & Annuity Association of America	\$ 1.000.000	4,27 %	15.05.2047	1.058.306	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 1.000.000	3,81 %	15.12.2048	1.052.340	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014	\$ 1.000.000	3,82 %	15.08.2050	1.048.390	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 1.050.000	2,00 %	14.04.2020	1.041.203	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.032.971	2,50 %	01.03.2027	1.038.631	0,01 %
GS Mortgage Securities Trust 2012	\$ 1.011.181	3,48 %	10.01.2045	1.038.544	0,01 %
Caterpillar, Inc.	\$ 1.000.000	3,40 %	15.05.2024	1.035.901	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 1.000.000	3,85 %	08.07.2024	1.035.827	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.023.110	3,00 %	15.08.2045	1.034.751	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 994.627	3,50 %	15.01.2042	1.033.696	0,01 %
Morgan Stanley Capital I Trust 2017	\$ 1.000.000	3,53 %	15.06.2050	1.032.480	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 903.000	4,25 %	06.02.2047	1.032.471	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 1.011.000	3,45 %	15.07.2050	1.031.008	0,01 %
Time Warner Cable LLC	\$ 1.000.000	4,13 %	15.02.2021	1.030.470	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 983.706	4,00 %	01.07.2046	1.028.528	0,01 %
Southern California Edison Co.	\$ 800.000	6,00 %	15.01.2034	1.028.492	0,01 %
Constellation Brands, Inc.	\$ 1.000.000	3,70 %	06.12.2026	1.027.999	0,01 %
Dow Chemical Co.	\$ 1.000.000	3,50 %	01.10.2024	1.027.554	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.019.514	3,00 %	01.09.2042	1.024.985	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 1.000.000	4,02 %	31.10.2038	1.024.465	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 995.313	3,50 %	01.01.2046	1.024.149	0,01 %
Synchrony Financial	\$ 1.000.000	3,75 %	15.08.2021	1.024.009	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 1.000.000	3,22 %	25.03.2027	1.023.950	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.040.000	1,50 %	30.11.2020	1.023.940	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.000.000	3,00 %	25.01.2024	1.022.129	0,01 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 1.000.000	3,46 %	15.06.2050	1.022.010	0,01 %
Williams Partners LP	\$ 1.000.000	3,90 %	15.01.2025	1.021.327	0,01 %
Visa, Inc.	\$ 1.000.000	3,15 %	14.12.2025	1.021.159	0,01 %
Morgan Stanley	\$ 1.000.000	3,63 %	20.01.2027	1.020.165	0,01 %
Synchrony Financial	\$ 975.000	4,50 %	23.07.2025	1.019.186	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 951.622	5,00 %	20.08.2040	1.019.071	0,01 %
CSAIL 2017-C8 Commercial Mortgage Trust	\$ 1.000.000	3,39 %	15.06.2050	1.018.940	0,01 %
General Electric Co.	\$ 744.000	6,75 %	15.03.2032	1.018.724	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.008.671	2,50 %	01.07.2028	1.018.258	0,01 %
Tennessee Valley Authority	\$ 1.000.000	2,88 %	01.02.2027	1.017.676	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 972.071	4,00 %	20.10.2044	1.017.477	0,01 %
Devon Energy Corp.	\$ 1.000.000	3,25 %	15.05.2022	1.017.335	0,01 %
United Airlines 2016-1 Klasse AA Pass Through Trust	\$ 1.025.000	3,10 %	07.07.2028	1.016.801	0,01 %
US Treasury Note	\$ 1.015.000	2,00 %	31.07.2020	1.016.586	0,01 %
Marathon Oil Corp.	\$ 1.000.000	3,85 %	01.06.2025	1.015.170	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 994.475	3,00 %	01.06.2033	1.014.835	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 1.000.000	4,90 %	14.08.2037	1.014.630	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 1.000.000	3,13 %	16.03.2022	1.012.987	0,01 %
US Treasury Note	\$ 993.000	2,63 %	15.11.2020	1.010.843	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 1.000.000	3,66 %	08.09.2024	1.009.988	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 1.000.000	2,70 %	13.05.2022	1.008.005	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 1.000.000	5,15 %	14.02.2050	1.005.625	0,01 %
Tennessee Valley Authority	\$ 700.000	7,13 %	01.05.2030	1.005.227	0,01 %
CBS Corp.	\$ 1.000.000	3,50 %	15.01.2025	1.002.814	0,01 %
US Treasury Note ¹	\$ 1.000.000	2,38 %	15.08.2024	1.002.813	0,01 %
Digital Realty Trust LP	\$ 975.000	3,63 %	01.10.2022	1.002.396	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 750.000	6,25 %	01.02.2041	1.001.985	0,01 %
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust 2012	\$ 1.000.000	2,85 %	10.12.2045	999.850	0,01 %
Wells Fargo & Co.	\$ 1.000.000	2,13 %	22.04.2019	999.749	0,01 %
Citigroup, Inc.	\$ 1.000.000	2,45 %	10.01.2020	999.276	0,01 %
Mercedes-Benz Auto Lease Trust 2017	\$ 1.000.000	1,79 %	15.04.2020	997.581	0,01 %
Discover Card Execution Note Trust	\$ 1.000.000	1,64 %	15.07.2021	996.950	0,01 %
TTX Co.	\$ 1.000.000	2,25 %	01.02.2019	996.579	0,01 %
Capital One Na	\$ 1.000.000	2,35 %	31.01.2020	996.543	0,01 %
AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2017	\$ 1.000.000	1,98 %	20.12.2021	995.894	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 958.738	3,50 %	01.07.2034	994.496	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	€ 750.000	3,88 %	23.09.2020	994.337	0,01 %
Georgia Power Co.	\$ 1.000.000	2,00 %	08.09.2020	994.056	0,01 %
Kansas City Southern	\$ 875.000	4,95 %	15.08.2045	993.955	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 949.789	4,00 %	01.10.2047	993.451	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.000.000	1,63 %	21.01.2020	993.228	0,01 %
Bank of America Corp.^	\$ 1.000.000	3,09 %	01.10.2025	992.757	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.000.000	2,00 %	05.01.2022	992.188	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 1.000.000	2,91 %	05.06.2023	991.611	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.000.000	1,38 %	15.08.2019	991.453	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.000.000	1,50 %	17.01.2020	990.776	0,01 %
Walt Disney Co.	\$ 1.000.000	1,80 %	05.06.2020	990.400	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 1.000.000	2,40 %	13.01.2023	989.897	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 1.000.000	1,85 %	06.02.2020	989.664	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 969.950	3,00 %	01.12.2026	988.356	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 1.000.000	2,05 %	03.05.2021	986.557	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.000.000	1,88 %	05.04.2022	986.256	0,01 %
Amgen, Inc.	\$ 881.000	4,66 %	15.06.2051	985.773	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	£ 733.000	1,13 %	15.12.2021	985.672	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 1.000.000	2,35 %	15.11.2021	984.967	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 938.053	4,00 %	01.09.2043	984.682	0,01 %
Federal Home Loan Banks	\$ 1.000.000	1,00 %	26.09.2019	984.333	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 946.113	3,50 %	01.04.2032	984.299	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.000.000	1,00 %	24.10.2019	983.468	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 1.000.000	2,95 %	01.10.2026	981.933	0,01 %
International Business Machines Corp.	€ 800.000	1,50 %	23.05.2029	981.767	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 955.053	3,50 %	01.12.2046	981.218	0,01 %
American International Group, Inc.	€ 800.000	1,88 %	21.06.2027	981.119	0,01 %
ConocoPhillips	\$ 700.000	6,50 %	01.02.2039	979.582	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 958.946	3,00 %	01.07.2033	978.591	0,01 %
State of California	\$ 625.000	7,63 %	01.03.2040	977.781	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 973.168	3,00 %	01.04.2043	977.500	0,01 %
Bunge Ltd. Finance Corp.	\$ 1.000.000	3,75 %	25.09.2027	977.254	0,01 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 1.000.000	2,60 %	25.12.2026	973.780	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 941.010	3,50 %	20.09.2046	973.699	0,01 %
Altria Group, Inc.	\$ 800.000	5,38 %	31.01.2044	973.444	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	€ 800.000	2,88 %	15.01.2038	972.815	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 929.036	4,00 %	01.02.2046	972.795	0,01 %
Nestle Holdings, Inc.	€ 800.000	0,88 %	18.07.2025	971.125	0,01 %
International Paper Co.	\$ 1.000.000	3,00 %	15.02.2027	969.271	0,01 %
Visa, Inc.	\$ 850.000	4,30 %	14.12.2045	966.778	0,01 %
Prudential Financial, Inc.	\$ 850.000	4,60 %	15.05.2044	966.705	0,01 %
Morgan Stanley	€ 773.000	1,88 %	27.04.2027	960.793	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 925.428	3,50 %	20.01.2045	960.632	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 897.638	4,50 %	20.07.2041	957.328	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 925.735	3,50 %	01.02.2026	956.325	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 925.317	3,50 %	01.11.2042	954.437	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 931.173	3,00 %	01.06.2027	953.161	0,01 %
Coca-Cola Co.	€ 800.000	0,50 %	08.03.2024	953.147	0,01 %
Jefferies Group LLC/Jefferies Group Capital Finance, Inc.	\$ 900.000	4,85 %	15.01.2027	952.996	0,01 %
AutoZone, Inc.	\$ 925.000	3,70 %	15.04.2022	951.389	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 925.000	3,45 %	18.12.2026	950.551	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 914.418	3,50 %	20.10.2044	949.232	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 906.573	4,00 %	20.12.2044	948.892	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 916.568	3,50 %	01.03.2045	947.333	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 750.000	5,25 %	01.09.2035	946.408	0,01 %
HP, Inc.	\$ 890.000	4,65 %	09.12.2021	945.965	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 945.256	3,00 %	01.10.2046	945.949	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 911.924	3,50 %	01.01.2026	945.448	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 932.913	3,00 %	20.12.2044	944.612	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 894.815	4,00 %	01.07.2040	942.352	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 909.834	3,50 %	01.04.2042	940.486	0,01 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 860.000	4,44 %	06.10.2048	938.707	0,01 %
Johnson & Johnson	\$ 915.000	2,95 %	01.09.2020	934.560	0,01 %
Progressive Corp.	\$ 900.000	3,75 %	23.08.2021	934.274	0,01 %
State of California	\$ 625.000	7,30 %	01.10.2039	932.412	0,01 %
Tyco Electronics Group SA	\$ 875.000	4,88 %	15.01.2021	930.202	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 952.422	2,50 %	20.11.2046	929.402	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 893.003	3,50 %	01.03.2041	924.952	0,01 %
Coca-Cola Co.	\$ 925.000	1,65 %	01.11.2018	923.155	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 881.352	4,00 %	20.08.2044	922.538	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 885.407	3,50 %	20.10.2041	921.575	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 880.000	4,00 %	01.01.2048	918.363	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 875.000	3,80 %	15.11.2037	918.258	0,01 %
Home Depot, Inc.	\$ 675.000	5,88 %	16.12.2036	915.772	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal National Mortgage Association	\$ 899.523	3,00 %	01.10.2036	915.193	0,01 %
Total System Services, Inc.	\$ 850.000	4,80 %	01.04.2026	914.342	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 850.000	4,13 %	15.05.2045	912.759	0,01 %
Omnicom Group, Inc.	\$ 900.000	3,60 %	15.04.2026	909.981	0,01 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 925.000	3,88 %	15.01.2027	909.789	0,01 %
Home Depot, Inc.	\$ 925.000	2,80 %	14.09.2027	908.407	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 841.107	5,00 %	01.10.2041	905.710	0,01 %
ConocoPhillips Co.	\$ 850.000	4,15 %	15.11.2034	901.688	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 898.000	3,38 %	15.02.2025	900.245	0,01 %
Apple, Inc. ¹	\$ 900.000	2,25 %	23.02.2021	898.777	0,01 %
US Treasury Note	\$ 896.000	2,00 %	30.09.2020	897.260	0,01 %
US Treasury Note	\$ 900.000	1,88 %	30.11.2021	892.547	0,01 %
Corning, Inc.	¥ 100.000.000	0,99 %	10.08.2027	892.082	0,01 %
US Treasury Note	\$ 896.000	2,00 %	15.02.2022	891.520	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 775.000	4,75 %	01.03.2046	890.762	0,01 %
DTE Energy Co.	\$ 925.000	2,85 %	01.10.2026	887.143	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 850.000	3,70 %	08.08.2046	886.240	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 870.991	3,00 %	01.12.2035	885.602	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 900.000	1,90 %	15.09.2021	885.255	0,01 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 820.000	5,00 %	04.06.2042	879.871	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 865.147	3,00 %	01.07.2035	879.805	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 854.777	3,50 %	01.04.2043	878.574	0,01 %
Wells Fargo & Co.	\$ 850.000	3,90 %	01.05.2045	876.774	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 850.000	3,30 %	06.02.2027	875.994	0,01 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 875.000	3,00 %	15.07.2023	871.251	0,01 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 832.102	4,00 %	01.07.2047	870.468	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 831.328	4,00 %	20.01.2045	870.141	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 849.893	3,00 %	01.12.2026	869.935	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 837.515	3,50 %	20.03.2046	868.531	0,01 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 840.000	3,50 %	01.01.2033	867.956	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 851.166	3,00 %	01.08.2029	867.316	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 850.000	2,80 %	08.07.2021	864.419	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 858.348	3,00 %	01.11.2042	862.961	0,01 %
US Treasury Note	\$ 876.000	1,75 %	31.05.2022	860.670	0,01 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	€ 700.000	1,41 %	13.12.2022	859.943	0,01 %
MPLX LP	\$ 800.000	4,88 %	01.12.2024	859.279	0,01 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	\$ 800.000	5,63 %	01.02.2021	855.000	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 819.784	3,50 %	20.09.2042	852.791	0,01 %
US Treasury Note	\$ 850.000	2,13 %	30.06.2021	851.461	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 811.817	4,00 %	20.04.2046	850.315	0,01 %
Morgan Stanley	£ 615.000	2,63 %	09.03.2027	849.612	0,01 %
Visa, Inc.	\$ 850.000	2,20 %	14.12.2020	849.538	0,01 %
AT&T, Inc.	€ 700.000	1,80 %	04.09.2026	848.873	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 796.187	5,00 %	20.09.2039	846.654	0,01 %
Rochester Gas & Electric Corp.	\$ 850.000	3,10 %	01.06.2027	846.242	0,01 %
AbbVie, Inc.	€ 700.000	0,38 %	18.11.2019	845.618	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 813.914	3,50 %	01.11.2031	840.796	0,01 %
Federal Home Loan Banks	\$ 850.000	1,13 %	21.06.2019	840.704	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 825.000	2,85 %	06.05.2021	838.576	0,01 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 837.143	3,00 %	01.01.2047	837.892	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 808.808	3,50 %	20.05.2047	837.034	0,01 %
Boardwalk Pipelines LP	\$ 750.000	5,95 %	01.06.2026	835.729	0,01 %
AbbVie, Inc.	\$ 778.000	4,40 %	06.11.2042	833.856	0,01 %
NBCUniversal Enterprise, Inc.	\$ 835.000	1,97 %	15.04.2019	833.212	0,01 %
Wells Fargo & Co.	\$ 700.000	5,38 %	02.11.2043	833.165	0,01 %
US Treasury Note	\$ 836.000	1,63 %	31.07.2019	832.865	0,01 %
CVS Health Corp.	\$ 725.000	5,13 %	20.07.2045	832.365	0,01 %
Union Pacific Corp.	\$ 700.000	4,82 %	01.02.2044	831.425	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	€ 700.000	0,38 %	15.11.2023	830.667	0,01 %
Humana, Inc.	\$ 800.000	3,85 %	01.10.2024	829.793	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 791.751	4,00 %	20.01.2044	829.713	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 771.682	4,50 %	20.08.2040	828.272	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 791.545	4,00 %	20.09.2047	827.730	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 850.000	1,55 %	08.08.2021	827.683	0,01 %
JPMorgan Chase & Co. [^]	\$ 800.000	4,03 %	24.07.2048	827.670	0,01 %
Williams Partners LP	\$ 800.000	4,00 %	15.11.2021	827.361	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
S&P Global, Inc.	\$ 850.000	2,95 %	22.01.2027	827.233	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 799.036	3,50 %	20.11.2046	826.797	0,01 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 808.000	3,73 %	15.12.2024	826.357	0,01 %
Actavis, Inc.	\$ 825.000	3,25 %	01.10.2022	826.246	0,01 %
Parker-Hannifin Corp.	\$ 800.000	3,50 %	15.09.2022	825.381	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 780.518	4,50 %	15.01.2046	823.688	0,01 %
PepsiCo, Inc.	\$ 825.000	2,15 %	14.10.2020	823.242	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 805.369	3,00 %	01.05.2027	820.651	0,01 %
Biogen, Inc.	\$ 775.000	4,05 %	15.09.2025	820.458	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 801.000	5,15 %	15.11.2046	818.773	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 795.257	3,50 %	01.11.2044	817.847	0,01 %
Procter & Gamble Co.	\$ 850.000	2,45 %	03.11.2026	817.503	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 800.000	3,38 %	11.08.2025	817.270	0,01 %
MPLX LP	\$ 800.000	4,13 %	01.03.2027	816.538	0,01 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 795.000	4,50 %	15.02.2045	814.451	0,01 %
Southern Co.	\$ 775.000	4,25 %	01.07.2036	814.298	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 800.000	3,20 %	25.01.2023	813.396	0,01 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates	\$ 800.000	2,95 %	25.07.2024	813.312	0,01 %
Bayer US Finance LLC	\$ 800.000	3,38 %	08.10.2024	813.088	0,01 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 750.000	5,45 %	15.06.2023	810.479	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 780.239	3,50 %	20.02.2045	809.916	0,01 %
McDonald's Corp.	\$ 800.000	2,75 %	09.12.2020	808.129	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 778.435	3,50 %	01.11.2025	807.024	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 754.734	4,50 %	01.12.2039	807.017	0,01 %
Dominion Energy Gas Holdings LLC	\$ 800.000	2,80 %	15.11.2020	805.946	0,01 %
LC6 Commercial Mortgage Trust 2013	\$ 800.000	2,94 %	10.01.2046	805.624	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 801.693	3,00 %	01.05.2043	805.249	0,01 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 775.000	4,25 %	15.11.2019	804.273	0,01 %
Danaher Corp.	\$ 725.000	4,38 %	15.09.2045	804.028	0,01 %
Old Republic International Corp.	\$ 750.000	4,88 %	01.10.2024	803.779	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 787.426	3,00 %	01.07.2030	802.348	0,01 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 794.000	3,06 %	25.05.2027	799.423	0,01 %
John Deere Capital Corp.	\$ 800.000	1,95 %	08.01.2019	798.538	0,01 %
US Treasury Note	\$ 800.000	1,25 %	31.01.2019	794.875	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 800.000	3,27 %	29.09.2025	793.748	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	AUD 1.000.000	4,50 %	17.08.2027	793.104	0,01 %
Boeing Co.	\$ 750.000	4,88 %	15.02.2020	792.229	0,01 %
Goodman US Finance Three LLC	\$ 800.000	3,70 %	15.03.2028	791.630	0,01 %
Home Depot, Inc.	\$ 790.000	3,00 %	01.04.2026	790.296	0,01 %
Jackson National Life Global Funding	\$ 800.000	2,50 %	27.06.2022	787.474	0,01 %
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 700.000	5,55 %	15.03.2026	783.768	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 750.000	4,50 %	10.08.2033	783.086	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 794.000	1,38 %	01.05.2020	782.768	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 750.000	4,13 %	16.03.2027	782.706	0,01 %
Wells Fargo & Co.	AUD 1.000.000	3,00 %	27.07.2021	780.844	0,01 %
Aviation Capital Group LLC	\$ 800.000	3,50 %	01.11.2027	780.784	0,01 %
Fidelity National Information Services, Inc.	€ 655.000	1,10 %	15.07.2024	780.767	0,01 %
Illinois Tool Works, Inc.	\$ 800.000	2,65 %	15.11.2026	779.886	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 750.000	3,88 %	10.09.2024	778.651	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 753.871	3,50 %	01.10.2043	777.979	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 800.000	1,38 %	07.10.2021	777.721	0,01 %
US Bancorp	\$ 775.000	2,20 %	25.04.2019	776.250	0,01 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	\$ 700.000	5,75 %	15.05.2024	775.250	0,01 %
Baltimore Gas & Electric Co.	\$ 750.000	3,50 %	15.11.2021	774.532	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 767.016	3,00 %	20.06.2045	774.500	0,01 %
CC Holdings GS V LLC/Crown Castle GS III Corp.	\$ 750.000	3,85 %	15.04.2023	774.025	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 775.000	2,63 %	25.04.2021	773.869	0,01 %
United Technologies Corp.	\$ 700.000	4,50 %	01.06.2042	773.487	0,01 %
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A	\$ 775.000	2,07 %	15.05.2022	771.475	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	\$ 750.000	4,65 %	15.10.2025	770.939	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 775.000	4,50 %	15.05.2035	769.999	0,01 %
Puget Energy, Inc.	\$ 750.000	3,65 %	15.05.2025	767.789	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 746.999	3,50 %	01.12.2046	767.482	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 750.000	3,38 %	15.04.2027	767.451	0,01 %
Bank of America Corp.^	\$ 750.000	3,71 %	24.04.2028	767.224	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 718.147	4,50 %	01.08.2040	766.903	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 700.000	5,88 %	02.08.2021	766.771	0,01 %
Constellation Brands, Inc.	\$ 700.000	4,75 %	15.11.2024	766.637	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 743.518	3,50 %	01.02.2046	765.049	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 722.151	4,00 %	01.11.2043	764.745	0,01 %
United Technologies Corp.	\$ 750.000	3,10 %	01.06.2022	763.805	0,01 %
Exelon Corp.	\$ 750.000	3,50 %	01.06.2022	761.718	0,01 %
Viacom, Inc.	\$ 750.000	4,25 %	01.09.2023	761.483	0,01 %
Cigna Corp.	\$ 730.000	4,00 %	15.02.2022	761.372	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 760.156	3,00 %	01.05.2046	760.833	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 711.924	4,50 %	01.09.2040	760.296	0,01 %
Exelon Generation Co. LLC	\$ 750.000	2,95 %	15.01.2020	757.555	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 650.000	4,45 %	03.11.2045	757.479	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 735.831	3,50 %	01.07.2045	757.105	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 747.289	3,00 %	20.11.2046	754.607	0,01 %
Amazon.com, Inc.	\$ 700.000	4,05 %	22.08.2047	753.910	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 750.447	3,00 %	01.07.2043	753.781	0,01 %
CVS Health Corp.	\$ 750.000	2,80 %	20.07.2020	753.135	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 736.951	3,00 %	01.08.2032	752.042	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 750.000	2,35 %	28.01.2019	751.702	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 600.000	6,05 %	01.03.2034	751.582	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 728.951	3,50 %	01.07.2042	751.485	0,01 %
Abbott Laboratories	\$ 750.000	2,35 %	22.11.2019	751.189	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 600.000	5,80 %	01.03.2037	750.604	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 723.263	3,50 %	20.11.2045	750.034	0,01 %
Manufacturers & Traders Trust Co.	\$ 750.000	2,25 %	25.07.2019	749.954	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 750.000	2,40 %	09.05.2019	749.953	0,01 %
Bank of America Corp.	\$ 750.000	2,25 %	21.04.2020	749.839	0,01 %
Southern Power Co.	€ 600.000	1,85 %	20.06.2026	748.891	0,01 %
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	\$ 750.000	2,40 %	15.09.2019	748.330	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 718.897	3,50 %	20.08.2042	748.276	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 722.325	3,50 %	01.01.2041	747.982	0,01 %
State of California	\$ 475.000	7,55 %	01.04.2039	747.465	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 725.000	3,25 %	25.10.2020	747.049	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 724.280	3,50 %	01.04.2045	745.651	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 716.282	3,50 %	20.11.2041	745.557	0,01 %
Toyota Auto Receivables 2017-B Owner Trust	\$ 750.000	1,76 %	15.07.2021	745.056	0,01 %
Duke Energy Indiana LLC	\$ 725.000	3,75 %	15.05.2046	745.022	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 690.055	5,00 %	01.02.2036	744.516	0,01 %
Chevron Corp.	\$ 750.000	2,36 %	05.12.2022	744.137	0,01 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	\$ 750.000	1,90 %	23.09.2019	743.463	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 700.000	3,90 %	01.08.2046	743.333	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 750.000	1,10 %	02.08.2019	742.396	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 750.000	2,50 %	02.11.2022	741.401	0,01 %
Molson Coors Brewing Co.	\$ 725.000	4,20 %	15.07.2046	739.116	0,01 %
Mylan, Inc.	\$ 750.000	3,13 %	15.01.2023	739.001	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 716.553	3,50 %	01.06.2043	736.663	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 674.617	4,50 %	01.04.2045	734.474	0,01 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	€ 600.000	0,80 %	21.01.2022	733.216	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 732.196	3,00 %	01.06.2046	732.849	0,01 %
HSBC Bank USA NA	\$ 500.000	7,00 %	15.01.2039	732.597	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 706.116	3,50 %	01.11.2033	732.425	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 672.630	5,00 %	20.01.2040	731.976	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 702.485	3,50 %	20.12.2041	731.197	0,01 %
FirstEnergy Corp.	\$ 700.000	4,25 %	15.03.2023	731.009	0,01 %
Pfizer, Inc.	\$ 740.000	2,75 %	03.06.2026	729.332	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 719.587	3,00 %	20.08.2043	729.279	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 725.000	3,40 %	14.08.2024	729.066	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 700.000	3,85 %	15.11.2023	726.623	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 712.225	3,00 %	01.09.2030	726.609	0,01 %
Halliburton Co.	\$ 700.000	3,80 %	15.11.2025	725.803	0,01 %
New York Life Insurance Co.	\$ 505.000	6,75 %	15.11.2039	724.525	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 688.743	4,50 %	20.03.2045	723.788	0,01 %
General Motors Co.	\$ 575.000	6,75 %	01.04.2046	722.686	0,01 %
Chevron Corp.	\$ 700.000	3,33 %	17.11.2025	722.112	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 701.688	3,50 %	01.02.2046	721.994	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 708.115	3,00 %	01.04.2032	721.841	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Allergan Funding SCS	€ 600.000	0,50 %	01.06.2021	720.988	0,01 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 675.000	4,75 %	15.11.2021	719.970	0,01 %
United Technologies Corp.	\$ 725.000	2,80 %	04.05.2024	719.385	0,01 %
Noble Energy, Inc.	\$ 700.000	3,90 %	15.11.2024	719.330	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 699.425	3,50 %	01.08.2042	719.082	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	€ 600.000	0,96 %	07.09.2023	718.693	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 690.842	3,50 %	01.06.2032	718.677	0,01 %
Sammons Financial Group, Inc.	\$ 700.000	4,45 %	12.05.2027	718.060	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 662.654	4,50 %	01.02.2045	717.903	0,01 %
General Electric Co.	€ 600.000	0,88 %	17.05.2025	717.834	0,01 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 721.000	1,91 %	06.03.2020	717.667	0,01 %
Realty Income Corp.	\$ 650.000	4,65 %	15.03.2047	717.138	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 710.292	2,50 %	01.10.2027	717.032	0,01 %
Mid-America Apartments LP	\$ 700.000	3,75 %	15.06.2024	716.748	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 700.000	3,38 %	15.11.2026	715.656	0,01 %
American Tower Corp.	\$ 725.000	3,55 %	15.07.2027	715.493	0,01 %
Reynolds American, Inc.	\$ 600.000	5,70 %	15.08.2035	715.111	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 675.000	4,35 %	15.08.2021	714.737	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 700.000	4,25 %	01.03.2027	713.580	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 714.000	4,30 %	15.02.2030	712.383	0,01 %
MetLife, Inc.	\$ 675.000	4,13 %	13.08.2042	710.603	0,01 %
Mylan NV	€ 569.000	2,25 %	22.11.2024	710.592	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	€ 600.000	1,50 %	15.11.2032	709.772	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 694.366	3,00 %	01.01.2033	708.595	0,01 %
Bunge Finance Europe BV	€ 570.000	1,85 %	16.06.2023	707.367	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 630.485	6,00 %	01.11.2038	707.119	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 699.873	3,00 %	20.02.2047	706.744	0,01 %
International Business Machines Corp.	\$ 700.000	2,88 %	09.11.2022	705.689	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 500.000	6,20 %	15.04.2038	705.412	0,01 %
US Treasury Note	\$ 700.000	2,25 %	30.04.2021	704.484	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 650.000	4,25 %	15.03.2043	703.860	0,01 %
ERP Operating LP	\$ 725.000	2,85 %	01.11.2026	703.726	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 652.714	5,00 %	01.11.2033	703.680	0,01 %
Becton Dickinson & Co.	€ 583.000	1,00 %	15.12.2022	703.521	0,01 %
Trinity Acquisition plc	€ 553.000	2,13 %	26.05.2022	703.422	0,01 %
Bank of America Corp.^	\$ 650.000	4,24 %	24.04.2038	702.642	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 694.449	2,50 %	01.08.2027	701.046	0,01 %
Reliance Standard Life Global Funding II	\$ 700.000	2,50 %	15.01.2020	699.322	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	€ 600.000	1,88 %	06.11.2037	698.516	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 700.000	2,88 %	31.10.2022	698.254	0,01 %
Chevron Corp.	\$ 700.000	2,10 %	16.05.2021	694.473	0,01 %
American Express Credit Account Master Trust	\$ 700.000	1,77 %	15.11.2022	693.900	0,01 %
AbbVie, Inc.	\$ 675.000	3,60 %	14.05.2025	693.712	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 694.298	2,50 %	01.10.2031	693.514	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 685.749	3,00 %	20.07.2047	692.488	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 691.497	3,00 %	01.12.2046	692.114	0,01 %
Bank of America Corp.	\$ 700.000	3,25 %	21.10.2027	691.491	0,01 %
CVS Health Corp.	\$ 690.000	3,38 %	12.08.2024	691.224	0,01 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 677.468	3,00 %	01.09.2032	690.398	0,01 %
Caterpillar, Inc.	\$ 600.000	4,30 %	15.05.2044	689.722	0,01 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 535.000	8,35 %	15.07.2046	689.371	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	£ 500.000	1,88 %	10.02.2020	688.864	0,01 %
Teachers Insurance & Annuity Association of America	\$ 600.000	4,90 %	15.09.2044	688.806	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 675.000	4,40 %	01.11.2034	687.558	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 664.853	3,50 %	01.12.2044	686.157	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 662.144	3,50 %	01.10.2042	684.416	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 700.000	2,65 %	15.07.2026	682.473	0,01 %
Norfolk Southern Corp.	\$ 675.000	3,00 %	01.04.2022	682.385	0,01 %
Crown Castle International Corp.	\$ 650.000	4,45 %	15.02.2026	682.285	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 650.000	4,00 %	03.03.2024	680.931	0,01 %
Westfield America Management Ltd.	£ 500.000	2,63 %	30.03.2029	680.694	0,01 %
AIG Global Funding	\$ 700.000	1,90 %	06.10.2021	680.232	0,01 %
Columbia Property Trust Operating Partnership LP	\$ 700.000	3,65 %	15.08.2026	679.560	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 600.000	4,45 %	06.05.2044	679.253	0,01 %
Altria Group, Inc.	\$ 675.000	2,63 %	14.01.2020	679.072	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 640.411	4,00 %	01.09.2043	678.187	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Microsoft Corp.	\$ 575.000	4,50 %	06.02.2057	677.166	0,01 %
Sierra Pacific Power Co.	\$ 700.000	2,60 %	01.05.2026	675.746	0,01 %
Amazon.com, Inc.	\$ 675.000	2,50 %	29.11.2022	674.538	0,01 %
US Treasury Note	\$ 675.000	2,00 %	15.11.2021	672.996	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 630.668	4,50 %	20.09.2041	672.614	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 650.066	3,50 %	01.07.2044	671.942	0,01 %
American Transmission Systems, Inc.	\$ 575.000	5,00 %	01.09.2044	671.510	0,01 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	\$ 500.000	6,13 %	01.04.2036	670.676	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	€ 562.000	1,45 %	16.03.2027	670.455	0,01 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 675.000	3,00 %	15.01.2022	670.311	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 652.122	3,50 %	01.10.2046	670.091	0,01 %
Discovery Communications LLC	£ 500.000	2,50 %	20.09.2024	669.577	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 645.000	3,85 %	04.08.2046	668.488	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 661.729	3,00 %	20.11.2045	668.191	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 653.627	3,00 %	01.11.2032	667.700	0,01 %
Abbott Laboratories	\$ 650.000	3,75 %	30.11.2026	667.623	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 636.762	4,00 %	01.12.2045	665.955	0,01 %
Southern Copper Corp.	\$ 550.000	5,88 %	23.04.2045	664.882	0,01 %
Enbridge Energy Partners LP	\$ 500.000	7,38 %	15.10.2045	664.846	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 659.698	3,00 %	01.10.2042	664.358	0,01 %
KKR Group Finance Co. III LLC	\$ 605.000	5,13 %	01.06.2044	663.682	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 652.107	3,00 %	01.09.2036	663.577	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 632.815	4,00 %	20.11.2041	663.184	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 654.741	3,00 %	15.03.2045	663.144	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 525.000	5,38 %	15.07.2040	662.000	0,01 %
Neuberger Berman Group LLC/Neuberger Berman Finance Corp.	\$ 650.000	4,88 %	15.04.2045	661.780	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 662.223	2,50 %	01.02.2032	661.779	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 630.541	4,00 %	01.07.2044	660.305	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 617.046	4,50 %	01.04.2039	659.757	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 650.000	3,45 %	10.04.2022	658.434	0,01 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 500.000	5,50 %	15.01.2040	657.842	0,01 %
Home Depot, Inc.	\$ 550.000	4,88 %	15.02.2044	657.263	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 633.071	3,50 %	01.09.2035	655.935	0,01 %
Berkshire Hathaway, Inc.	\$ 650.000	3,13 %	15.03.2026	655.639	0,01 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012	\$ 650.000	2,88 %	15.12.2045	654.726	0,01 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 650.000	3,50 %	15.06.2024	654.311	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 620.871	4,00 %	01.03.2041	653.676	0,01 %
CenterPoint Energy Resources Corp.	\$ 625.000	4,50 %	15.01.2021	653.189	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 600.000	4,20 %	15.01.2047	652.235	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 603.794	5,00 %	01.10.2035	651.435	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 500.000	6,88 %	01.03.2033	651.269	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 650.000	3,00 %	30.06.2022	650.957	0,01 %
Amazon.com, Inc.	\$ 650.000	3,15 %	22.08.2027	650.820	0,01 %
Kinder Morgan, Inc.	\$ 625.000	5,05 %	15.02.2046	648.571	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 637.412	3,00 %	01.03.2037	648.548	0,01 %
AbbVie, Inc.	\$ 600.000	4,45 %	14.05.2046	648.328	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 635.762	3,00 %	01.12.2030	647.819	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 650.000	1,75 %	26.11.2019	647.666	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 640.881	3,00 %	20.08.2045	647.143	0,01 %
Old Republic International Corp.	\$ 645.000	3,88 %	26.08.2026	646.603	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 605.437	4,50 %	01.03.2029	645.408	0,01 %
Massachusetts Mutual Life Insurance Co.	\$ 525.000	5,38 %	01.12.2041	645.324	0,01 %
Andeavor	\$ 600.000	4,75 %	15.12.2023	645.000	0,01 %
Moody's Corp.	\$ 650.000	2,75 %	15.07.2019	644.472	0,01 %
Texas Instruments, Inc.	\$ 650.000	2,90 %	03.11.2027	644.241	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 625.000	3,45 %	08.08.2036	643.766	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 609.309	4,00 %	01.11.2043	643.329	0,01 %
Fifth Third Auto Trust 2017	\$ 650.000	2,03 %	15.07.2024	642.865	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 500.000	2,13 %	30.09.2024	641.746	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 685.000	4,50 %	09.03.2048	641.625	0,01 %
US Treasury Note	\$ 650.000	2,25 %	15.08.2027	640.656	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 600.000	4,40 %	01.12.2021	639.107	0,01 %
Crown Castle International Corp.	\$ 650.000	2,25 %	01.09.2021	638.862	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 613.880	3,50 %	01.02.2032	638.641	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 610.562	4,00 %	01.01.2045	638.532	0,01 %
MUFG Americas Holdings Corp.	\$ 625.000	3,50 %	18.06.2022	638.149	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 500.000	6,60 %	15.03.2046	637.944	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 500.000	2,00 %	27.07.2023	637.620	0,01 %
Bank of America Corp. ¹	\$ 600.000	4,13 %	22.01.2024	636.948	0,01 %
New Jersey Turnpike Authority	\$ 425.000	7,10 %	01.01.2041	634.920	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 603.219	4,00 %	01.02.2042	634.570	0,01 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 650.000	3,25 %	20.05.2027	634.314	0,01 %
US Treasury Note	\$ 640.000	1,25 %	30.06.2019	634.300	0,01 %
Dover Corp.	€ 500.000	2,13 %	01.12.2020	633.388	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 600.000	5,35 %	01.09.2040	632.959	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 625.000	2,63 %	06.09.2024	632.842	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 650.000	4,75 %	15.05.2046	632.798	0,01 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	\$ 625.000	3,05 %	09.01.2020	632.223	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 626.548	2,50 %	01.10.2027	632.020	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 661.000	4,67 %	15.03.2055	631.608	0,01 %
Abbott Laboratories	\$ 625.000	2,90 %	30.11.2021	631.576	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 608.295	3,50 %	20.12.2045	630.818	0,01 %
Travelers Cos, Inc.	\$ 600.000	5,90 %	02.06.2019	630.355	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 603.782	3,50 %	01.09.2029	629.712	0,01 %
PepsiCo, Inc.	\$ 600.000	4,00 %	02.05.2047	629.403	0,01 %
Bank of America Corp.	\$ 600.000	4,20 %	26.08.2024	629.253	0,01 %
Eastman Chemical Co.	€ 500.000	1,88 %	23.11.2026	628.703	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 558.147	6,50 %	01.10.2037	628.130	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 600.000	4,81 %	15.03.2039	627.564	0,01 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 650.000	2,65 %	15.01.2023	626.829	0,01 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	€ 500.000	2,88 %	18.06.2019	626.733	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 605.280	3,50 %	01.07.2043	624.650	0,01 %
US Treasury Note	\$ 625.000	1,88 %	30.06.2020	624.219	0,01 %
Morgan Stanley	\$ 600.000	3,88 %	27.01.2026	624.056	0,01 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	\$ 600.000	4,40 %	01.04.2021	623.768	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 611.498	3,00 %	01.07.2032	623.360	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 625.000	2,45 %	01.10.2022	622.636	0,01 %
International Business Machines Corp.	\$ 625.000	1,90 %	27.01.2020	622.244	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	€ 488.000	2,63 %	01.12.2031	620.728	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 603.549	3,50 %	01.03.2047	620.124	0,01 %
General Electric Co.	\$ 586.000	6,00 %	07.08.2019	619.521	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 584.077	4,50 %	15.03.2040	618.653	0,01 %
Citigroup, Inc. [^]	\$ 600.000	3,89 %	10.01.2028	618.084	0,01 %
Electronic Arts, Inc.	\$ 600.000	3,70 %	01.03.2021	617.410	0,01 %
New York Life Global Funding	\$ 650.000	2,35 %	14.07.2026	617.251	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 616.656	3,00 %	01.02.2043	617.105	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 600.000	3,45 %	15.01.2027	616.887	0,01 %
Wells Fargo & Co.	\$ 500.000	5,61 %	15.01.2044	616.552	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 610.518	3,00 %	20.03.2046	616.484	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 593.154	3,50 %	20.07.2044	615.746	0,01 %
Stryker Corp.	\$ 600.000	3,38 %	01.11.2025	614.125	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 575.000	5,45 %	01.03.2047	614.103	0,01 %
Carnival Corp.	€ 500.000	1,13 %	06.11.2019	612.111	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp. [^]	\$ 600.000	3,03 %	25.10.2020	610.350	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 575.000	4,15 %	01.03.2047	609.873	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 567.699	4,50 %	20.09.2040	609.365	0,01 %
Walt Disney Co.	\$ 600.000	3,15 %	17.09.2025	609.260	0,01 %
CBS Corp.	\$ 650.000	2,90 %	15.01.2027	608.730	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 588.824	3,50 %	01.08.2042	608.638	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 598.441	3,00 %	20.11.2042	607.969	0,01 %
AutoNation, Inc.	\$ 600.000	3,35 %	15.01.2021	607.874	0,01 %
Parker-Hannifin Corp	€ 500.000	1,13 %	01.03.2025	607.545	0,01 %
Commonwealth Edison Co.	\$ 600.000	3,65 %	15.06.2046	607.045	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 500.000	0,75 %	10.05.2019	606.920	0,01 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 589.434	3,50 %	01.09.2047	605.736	0,01 %
Wells Fargo & Co.	\$ 500.000	5,38 %	07.02.2035	605.720	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 565.949	4,50 %	01.08.2040	605.540	0,01 %
Pfizer, Inc.	€ 500.000	1,00 %	06.03.2027	605.232	0,01 %
AT&T, Inc.	€ 500.000	1,05 %	04.09.2023	605.016	0,01 %
Comcast Corp.	\$ 425.000	6,95 %	15.08.2037	604.985	0,01 %
Molson Coors Brewing Co.	€ 500.000	1,25 %	15.07.2024	604.877	0,01 %
McKesson Corp.	€ 500.000	0,63 %	17.08.2021	604.856	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeitsdatum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Morgan Stanley^	\$ 600.000	3,59 %	22.07.2028	604.177	0,01 %
Pfizer, Inc.	\$ 600.000	3,00 %	15.12.2026	604.012	0,01 %
Tyson Foods, Inc.	\$ 600.000	2,65 %	15.08.2019	603.182	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 575.511	4,00 %	20.05.2042	603.119	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 625.000	2,40 %	08.08.2026	603.009	0,01 %
Hartford Financial Services Group, Inc.	\$ 475.000	5,95 %	15.10.2036	602.809	0,01 %
Genentech, Inc.	\$ 500.000	5,25 %	15.07.2035	602.655	0,01 %
Time Warner, Inc.	\$ 600.000	4,65 %	01.06.2044	602.414	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 600.000	2,75 %	15.09.2020	602.126	0,01 %
Allergan Funding SCS	€ 500.000	2,13 %	01.06.2029	601.942	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 600.000	2,55 %	11.04.2023	601.914	0,01 %
Citigroup, Inc.	€ 500.000	0,75 %	26.10.2023	601.371	0,01 %
International Business Machines Corp.	\$ 600.000	2,50 %	27.01.2022	600.348	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 600.000	3,05 %	15.11.2027	599.778	0,01 %
Allergan Funding SCS	\$ 595.000	3,00 %	12.03.2020	599.493	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 600.000	2,45 %	30.06.2020	599.438	0,01 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 588.611	3,00 %	01.09.2037	599.349	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 600.000	1,80 %	13.11.2018	599.011	0,01 %
Time Warner, Inc.	\$ 600.000	3,80 %	15.02.2027	598.861	0,01 %
Coca-Cola Co.	€ 500.000	0,00 %	09.03.2021	598.821	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 558.867	4,50 %	01.01.2040	597.974	0,01 %
John Deere Capital Corp.	\$ 600.000	2,05 %	10.03.2020	597.968	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 546.439	5,50 %	01.05.2034	596.226	0,01 %
Procter & Gamble Co.	€ 500.000	0,50 %	25.10.2024	595.807	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 605.000	0,88 %	19.07.2019	595.561	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 572.132	3,50 %	01.03.2032	595.216	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 564.018	4,00 %	01.12.2040	594.030	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 592.262	3,00 %	01.02.2046	593.706	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 565.639	4,50 %	20.05.2047	593.624	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 600.000	1,25 %	02.10.2019	592.977	0,01 %
US Treasury Note	\$ 599.000	1,25 %	31.08.2019	592.916	0,01 %
State of California	\$ 400.000	7,50 %	01.04.2034	592.328	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 545.956	4,50 %	01.11.2042	591.527	0,01 %
Air Lease Corp.	\$ 600.000	2,63 %	01.07.2022	590.985	0,01 %
Citigroup, Inc.	\$ 500.000	5,30 %	06.05.2044	590.200	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 576.233	3,00 %	01.04.2027	589.828	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 571.815	3,50 %	01.07.2043	589.818	0,01 %
US Treasury Bond	\$ 575.000	2,88 %	15.11.2046	589.734	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 600.000	2,95 %	01.03.2027	588.883	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 587.362	2,50 %	01.10.2030	588.870	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 578.397	3,00 %	01.04.2035	588.806	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 500.000	4,70 %	01.09.2045	588.676	0,01 %
Apache Corp.	\$ 500.000	6,00 %	15.01.2037	588.606	0,01 %
Kroger Co.	\$ 550.000	5,15 %	01.08.2043	587.631	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 561.084	4,00 %	20.02.2045	586.645	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 589.567	1,87 %	25.11.2019	586.572	0,01 %
Johnson & Johnson	\$ 500.000	4,50 %	05.12.2043	586.263	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 565.681	3,50 %	01.02.2041	585.934	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	£ 300.000	5,63 %	27.03.2034	585.530	0,01 %
AbbVie, Inc.	\$ 524.000	4,70 %	14.05.2045	584.301	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 582.487	3,00 %	01.11.2045	583.812	0,01 %
Ford Motor Co.	\$ 450.000	7,45 %	16.07.2031	583.769	0,01 %
Amazon.com, Inc.	\$ 500.000	4,80 %	05.12.2034	583.597	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 575.000	3,25 %	15.11.2027	583.517	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 500.000	4,30 %	22.04.2044	583.197	0,01 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 575.000	3,48 %	01.06.2019	582.203	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 550.000	5,25 %	01.03.2037	581.901	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 584.000	4,27 %	15.01.2036	580.957	0,01 %
General Dynamics Corp.	\$ 600.000	2,63 %	15.11.2027	579.646	0,01 %
General Electric Co.	\$ 436.000	6,15 %	07.08.2037	579.319	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	€ 500.000	1,38 %	02.11.2028	579.296	0,01 %
Republic Services, Inc.	\$ 550.000	5,50 %	15.09.2019	579.035	0,01 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 575.000	2,80 %	02.07.2020	578.055	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 557.747	3,50 %	01.10.2035	577.866	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 550.143	4,00 %	01.09.2043	577.656	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 575.000	5,30 %	14.08.2058	576.517	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal National Mortgage Association	\$ 538.341	4,50 %	01.08.2040	576.025	0,01 %
Lincoln National Corp.	\$ 450.000	6,30 %	09.10.2037	575.089	0,01 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 550.000	4,45 %	15.01.2020	574.820	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 547.405	4,00 %	20.09.2044	572.981	0,01 %
Bank of America Corp.	\$ 541.000	4,00 %	01.04.2024	571.754	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 500.000	4,88 %	15.11.2043	570.683	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 552.440	3,50 %	01.01.2043	570.135	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 544.493	4,00 %	01.02.2046	570.129	0,01 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 567.000	2,68 %	15.12.2019	569.486	0,01 %
Entergy Louisiana LLC	\$ 500.000	5,40 %	01.11.2024	569.448	0,01 %
PepsiCo, Inc.	\$ 600.000	2,38 %	06.10.2026	569.310	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 548.683	3,50 %	20.03.2047	568.355	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 546.294	3,50 %	15.09.2041	568.110	0,01 %
ConocoPhillips Co.	\$ 500.000	4,95 %	15.03.2026	567.492	0,01 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 550.000	5,38 %	01.05.2047	567.283	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 540.606	4,00 %	20.07.2044	566.525	0,01 %
Energy Transfer LP	\$ 525.000	9,00 %	15.04.2019	566.455	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 553.241	3,00 %	01.02.2027	566.289	0,01 %
US Treasury Note	\$ 575.000	1,75 %	15.05.2022	565.656	0,01 %
Celgene Corp.	\$ 500.000	5,00 %	15.08.2045	565.549	0,01 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 525.000	4,67 %	06.06.2047	565.076	0,01 %
Williams Partners LP	\$ 500.000	5,40 %	04.03.2044	563.457	0,01 %
Medtronic, Inc.	\$ 550.000	3,15 %	15.03.2022	563.390	0,01 %
Comcast Corp.	\$ 550.000	3,30 %	01.02.2027	561.066	0,01 %
Chubb INA Holdings, Inc.	\$ 500.000	4,35 %	03.11.2045	560.822	0,01 %
US Treasury Note	\$ 562.000	1,63 %	30.06.2019	560.068	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 554.609	2,50 %	01.01.2028	559.876	0,01 %
Southern Copper Corp.	\$ 500.000	5,25 %	08.11.2042	559.440	0,01 %
Colgate-Palmolive Co.	\$ 575.000	1,95 %	01.02.2023	558.803	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 534.008	4,00 %	01.05.2046	558.464	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 558.392	2,50 %	01.11.2030	557.762	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 550.000	3,20 %	15.01.2021	557.759	0,01 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	\$ 500.000	5,95 %	01.12.2025	557.724	0,01 %
Target Corp.	\$ 550.000	3,90 %	15.11.2047	557.389	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 500.000	4,75 %	15.02.2044	556.851	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 525.264	4,00 %	01.10.2044	556.674	0,01 %
Abbott Laboratories	\$ 550.000	3,25 %	15.04.2023	556.530	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 550.000	3,45 %	14.01.2022	556.359	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 531.881	4,00 %	01.12.2045	556.243	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 529.983	4,00 %	20.01.2041	555.412	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 537.493	3,50 %	01.09.2026	555.246	0,01 %
Williams Partners LP	\$ 450.000	6,30 %	15.04.2040	554.909	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 536.847	3,50 %	01.06.2042	554.893	0,01 %
BlackRock, Inc.	\$ 550.000	3,20 %	15.03.2027	554.601	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 547.090	3,00 %	20.09.2043	554.459	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 500.000	4,50 %	01.02.2045	554.006	0,01 %
American Tower Corp.	\$ 500.000	5,90 %	01.11.2021	553.671	0,01 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 575.000	3,00 %	01.06.2026	553.203	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 525.000	3,75 %	12.02.2045	553.172	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 542.548	3,00 %	01.01.2027	552.849	0,01 %
WestRock MWV LLC	\$ 400.000	7,95 %	15.02.2031	552.313	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 530.511	3,50 %	20.12.2042	551.877	0,01 %
Time Warner, Inc.	\$ 525.000	4,90 %	15.06.2042	551.673	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 550.000	4,10 %	15.02.2028	551.620	0,01 %
HSBC USA, Inc.	\$ 550.000	2,25 %	23.06.2019	551.318	0,01 %
Aflac, Inc.	\$ 550.000	2,40 %	16.03.2020	550.238	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 512.302	4,50 %	20.01.2040	549.910	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 546.292	3,00 %	01.08.2043	549.814	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 488.794	6,00 %	01.05.2038	549.303	0,01 %
New York Life Global Funding	\$ 550.000	1,55 %	02.11.2018	548.268	0,01 %
Priceline Group, Inc.	€ 451.000	0,80 %	10.03.2022	548.110	0,01 %
ERP Operating LP	\$ 500.000	4,50 %	01.06.2045	548.104	0,01 %
Southern Co.	\$ 550.000	2,95 %	01.07.2023	546.832	0,01 %
LYB International Finance BV	\$ 500.000	4,88 %	15.03.2044	545.416	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 550.000	2,91 %	24.07.2023	545.186	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 550.000	4,38 %	01.06.2046	544.789	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 500.000	4,95 %	15.10.2054	544.707	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 534.527	3,00 %	01.06.2029	544.666	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	£ 400.000	3,38 %	27.10.2036	544.617	0,01 %
Sherwin-Williams Co.	\$ 500.000	4,50 %	01.06.2047	544.469	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 535.872	3,00 %	20.06.2043	544.406	0,01 %
Energy Transfer LP/Regency Energy Finance Corp.	\$ 500.000	5,88 %	01.03.2022	544.375	0,01 %
Bank of America Corp.	\$ 450.000	5,00 %	21.01.2044	543.405	0,01 %
Morgan Stanley	\$ 500.000	4,38 %	22.01.2047	543.326	0,01 %
US Treasury Note	\$ 550.000	1,38 %	31.05.2020	542.953	0,01 %
Celgene Corp.	\$ 525.000	3,88 %	15.08.2025	542.863	0,01 %
Anthem, Inc.	\$ 510.000	4,38 %	01.12.2047	542.816	0,01 %
Huntington National Bank	\$ 550.000	2,50 %	07.08.2022	542.407	0,01 %
Comcast Corp.	\$ 475.000	4,75 %	01.03.2044	542.238	0,01 %
CBRE Services, Inc.	\$ 500.000	4,88 %	01.03.2026	541.972	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 530.020	3,00 %	01.04.2033	541.428	0,01 %
Dow Chemical Co.	\$ 500.000	8,55 %	15.05.2019	541.338	0,01 %
Bank of America Corp.	\$ 425.000	6,11 %	29.01.2037	540.846	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 492.492	5,50 %	01.04.2036	540.795	0,01 %
Eastman Chemical Co.	\$ 500.000	4,65 %	15.10.2044	540.692	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 519.248	3,50 %	01.12.2031	540.194	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 511.593	4,00 %	01.10.2033	540.191	0,01 %
Newell Brands Inc.	\$ 450.000	5,50 %	01.04.2046	539.140	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 518.795	3,50 %	01.07.2034	538.101	0,01 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 550.000	2,20 %	15.01.2021	537.998	0,01 %
Massachusetts Mutual Life Insurance Co.	\$ 475.000	4,90 %	01.04.2077	536.684	0,01 %
County of Clark Department of Aviation	\$ 500.000	6,88 %	01.07.2042	536.675	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 534.516	3,00 %	01.11.2042	536.473	0,01 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 550.000	2,90 %	20.05.2024	536.356	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.^	\$ 500.000	4,26 %	22.02.2048	536.130	0,01 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	\$ 500.000	4,80 %	18.11.2044	535.946	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 525.000	3,25 %	23.02.2026	535.758	0,01 %
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 500.000	8,70 %	15.03.2019	535.692	0,01 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 550.000	2,60 %	30.01.2023	535.531	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 504.465	4,00 %	01.08.2031	534.503	0,01 %
CVS Health Corp.	\$ 500.000	4,75 %	01.12.2022	534.371	0,01 %
Florida Gas Transmission Co. LLC	\$ 500.000	4,35 %	15.07.2025	533.918	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 496.954	4,50 %	15.08.2039	533.916	0,01 %
Biogen, Inc.	\$ 450.000	5,20 %	15.09.2045	533.670	0,01 %
Tyson Foods, Inc.	\$ 475.000	4,88 %	15.08.2034	532.856	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 514.200	3,50 %	15.02.2042	532.513	0,01 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 498.860	4,50 %	01.02.2041	532.490	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 450.000	6,38 %	01.03.2041	531.953	0,01 %
Visa, Inc.	\$ 525.000	2,80 %	14.12.2022	531.923	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 506.410	4,00 %	01.05.2042	531.520	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 512.405	3,50 %	20.04.2047	530.794	0,01 %
Cimarex Energy Co.	\$ 500.000	4,38 %	01.06.2024	530.685	0,01 %
Time Warner Cable LLC	\$ 425.000	7,30 %	01.07.2038	530.280	0,01 %
Wells Fargo & Co.	CAD 650.000	3,87 %	21.05.2025	530.080	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 515.847	3,50 %	01.09.2045	529.991	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 507.478	4,00 %	20.07.2045	529.684	0,01 %
HSBC USA, Inc.	\$ 500.000	5,00 %	27.09.2020	528.744	0,01 %
Williams Partners LP	\$ 500.000	5,25 %	15.03.2020	528.366	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 475.000	5,15 %	15.09.2023	528.260	0,01 %
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 500.000	4,85 %	15.03.2021	528.085	0,01 %
PartnerRe Finance B LLC	\$ 500.000	5,50 %	01.06.2020	528.028	0,01 %
CSX Corp.	\$ 400.000	6,22 %	30.04.2040	527.917	0,01 %
CVS Health Corp.	\$ 550.000	2,88 %	01.06.2026	527.677	0,01 %
Monsanto Co.	\$ 500.000	4,65 %	15.11.2043	527.636	0,01 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 450.000	6,38 %	23.10.2035	527.316	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 525.000	2,95 %	15.05.2025	526.565	0,01 %
AbbVie, Inc.	\$ 525.000	2,50 %	14.05.2020	526.204	0,01 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	\$ 400.000	5,95 %	15.05.2037	526.022	0,01 %
ConocoPhillips	\$ 425.000	5,90 %	15.10.2032	525.513	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Bank of America Corp.	\$ 500.000	4,25 %	22.10.2026	525.435	0,01 %
Amgen, Inc.	\$ 525.000	2,20 %	22.05.2019	525.187	0,01 %
Nucor Corp.	\$ 500.000	4,00 %	01.08.2023	524.848	0,01 %
General Electric Co.	\$ 500.000	4,38 %	16.09.2020	524.620	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 512.165	3,00 %	01.10.2026	524.247	0,01 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 550.000	3,50 %	15.01.2028	524.099	0,01 %
General Electric Co.	\$ 525.000	2,70 %	09.10.2022	523.947	0,01 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	\$ 525.000	1,65 %	08.02.2019	522.846	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 517.495	3,00 %	20.07.2046	522.559	0,01 %
Welltower, Inc.	\$ 500.000	4,25 %	01.04.2026	522.096	0,01 %
Time Warner Cable LLC	\$ 500.000	5,50 %	01.09.2041	521.870	0,01 %
Amgen, Inc.	€ 420.000	1,25 %	25.02.2022	521.471	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 509.370	3,00 %	01.05.2027	521.394	0,01 %
Energy Transfer LP	\$ 490.000	6,05 %	01.06.2041	520.980	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 496.906	4,00 %	20.11.2040	520.754	0,01 %
MidAmerican Energy Co.	\$ 500.000	3,50 %	15.10.2024	520.704	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 511.527	3,00 %	01.01.2037	520.459	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 500.000	4,30 %	01.05.2024	520.361	0,01 %
ONEOK, Inc.	\$ 500.000	4,95 %	13.07.2047	520.353	0,01 %
L3 Technologies, Inc.	\$ 500.000	3,95 %	28.05.2024	519.538	0,01 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017	\$ 500.000	3,60 %	15.05.2050	519.355	0,01 %
Comcast Corp.	\$ 475.000	4,40 %	15.08.2035	518.824	0,01 %
Boston Gas Co.	\$ 525.000	3,15 %	01.08.2027	518.806	0,01 %
Bank 2018-BNK ⁸	\$ 500.000	3,63 %	15.05.2050	518.730	0,01 %
Oklahoma Gas & Electric Co.	\$ 500.000	3,85 %	15.08.2047	518.572	0,01 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.^	\$ 500.000	4,75 %	30.04.2043	518.428	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 500.000	3,28 %	25.06.2025	517.690	0,01 %
Chevron Corp.	\$ 500.000	4,95 %	03.03.2019	516.365	0,01 %
CD 2017-CD4 Mortgage Trust^	\$ 500.000	3,51 %	10.05.2050	516.180	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 500.000	3,75 %	15.11.2047	515.928	0,01 %
Federal Home Loan Banks	\$ 525.000	1,38 %	28.09.2020	515.894	0,01 %
Morgan Stanley	\$ 500.000	3,70 %	23.10.2024	515.335	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 512.309	3,00 %	01.03.2042	515.063	0,01 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	\$ 500.000	3,50 %	10.03.2025	514.587	0,01 %
US Treasury Bond	\$ 425.000	8,13 %	15.08.2021	514.316	0,01 %
Morgan Stanley^	\$ 500.000	3,97 %	22.07.2038	514.137	0,01 %
Celgene Corp.	\$ 500.000	3,63 %	15.05.2024	514.043	0,01 %
Bank 2018-BNK ⁸	\$ 499.000	3,52 %	15.07.2060	513.137	0,01 %
AT&T, Inc.	£ 350.000	4,25 %	01.06.2043	513.048	0,01 %
GS Mortgage Securities Trust 2017	\$ 500.000	3,43 %	10.05.2050	512.575	0,01 %
Chevron Corp.	\$ 500.000	3,19 %	24.06.2023	512.551	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 498.390	3,50 %	01.07.2046	512.055	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 500.000	3,35 %	09.02.2027	512.053	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 500.000	3,06 %	25.11.2023	511.800	0,01 %
Bank 2018-BNK ⁸	\$ 499.000	3,74 %	15.07.2060	511.575	0,01 %
Southwestern Public Service Co.	\$ 500.000	3,70 %	15.08.2047	511.461	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 500.000	3,60 %	17.02.2023	511.394	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 485.289	4,00 %	01.02.2041	510.922	0,01 %
CD 2017-CD4 Mortgage Trust	\$ 500.000	3,75 %	10.05.2050	510.670	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 500.000	3,29 %	25.03.2029	510.659	0,01 %
Honda Auto Receivables 2017-2 Owner Trust	\$ 515.000	1,68 %	16.08.2021	510.453	0,01 %
CFCRE Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 500.000	3,57 %	15.06.2050	509.870	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 500.000	3,35 %	15.03.2023	509.448	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 500.000	3,20 %	13.05.2025	509.386	0,01 %
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	\$ 500.000	3,55 %	01.05.2027	508.965	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 477.204	4,50 %	20.05.2041	508.945	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 505.681	3,00 %	01.01.2043	508.942	0,01 %
Florida Power & Light Co.	\$ 500.000	3,13 %	01.12.2025	508.800	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 475.000	5,00 %	01.03.2021	508.548	0,01 %
GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	\$ 500.000	3,37 %	15.11.2025	507.896	0,01 %
Time Warner, Inc.	\$ 500.000	3,55 %	01.06.2024	507.635	0,01 %
Mohawk Industries, Inc.	€ 400.000	2,00 %	14.01.2022	507.029	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 491.466	3,50 %	01.10.2042	506.921	0,01 %
Wells Fargo & Co.	\$ 500.000	3,00 %	22.01.2021	506.532	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 477.893	4,00 %	01.10.2030	506.443	0,01 %
TJX Cos, Inc.	\$ 500.000	2,75 %	15.06.2021	506.012	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeitsdatum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Government National Mortgage Association	\$ 482.596	4,00 %	20.11.2043	505.728	0,01 %
Ohio State University	\$ 450.000	4,80 %	01.06.2111	505.463	0,01 %
Wells Fargo & Co.	\$ 475.000	4,30 %	22.07.2027	505.446	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 500.000	3,20 %	01.03.2022	505.344	0,01 %
Amazon.com, Inc.	\$ 500.000	2,60 %	05.12.2019	505.125	0,01 %
Chubb INA Holdings, Inc.	\$ 500.000	2,88 %	03.11.2022	504.729	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 475.000	4,00 %	15.11.2047	504.727	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 482.380	4,00 %	01.11.2044	504.547	0,01 %
Activision Blizzard, Inc.	\$ 500.000	3,40 %	15.09.2026	503.947	0,01 %
LYB International Finance II BV	€ 400.000	1,88 %	02.03.2022	503.758	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2012	\$ 499.621	2,92 %	15.10.2045	503.518	0,01 %
Digital Realty Trust LP	\$ 500.000	3,70 %	15.08.2027	503.432	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 486.822	3,50 %	01.06.2045	503.240	0,01 %
Walt Disney Co.	\$ 550.000	1,85 %	30.07.2026	503.096	0,01 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 500.000	2,73 %	01.03.2023	503.059	0,01 %
US Bancorp	\$ 500.000	2,63 %	24.01.2022	502.876	0,01 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	\$ 500.000	2,95 %	07.02.2024	502.769	0,01 %
Duke Energy Progress LLC	\$ 500.000	3,60 %	15.09.2047	502.368	0,01 %
Wells Fargo & Co.	\$ 500.000	2,60 %	22.07.2020	502.348	0,01 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2012	\$ 500.000	2,86 %	15.11.2045	502.200	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 500.000	2,63 %	31.01.2019	501.978	0,01 %
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	\$ 500.000	4,00 %	15.08.2026	501.875	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.^	\$ 500.000	3,22 %	01.03.2025	501.540	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 500.000	3,50 %	16.11.2026	501.333	0,01 %
SunTrust Banks, Inc.	\$ 500.000	2,35 %	01.11.2018	501.050	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 500.000	2,55 %	23.10.2019	500.925	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 469.199	4,50 %	01.06.2041	500.866	0,01 %
HSBC USA, Inc.	\$ 500.000	2,38 %	13.11.2019	500.821	0,01 %
Spectra Energy Partners LP	\$ 500.000	3,50 %	15.03.2025	500.790	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 487.237	3,50 %	01.03.2042	500.709	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 475.000	4,25 %	10.11.2044	500.607	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 500.000	2,60 %	07.02.2022	500.531	0,01 %
US Treasury Bond	\$ 425.000	7,88 %	15.02.2021	500.438	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 500.000	2,31 %	25.03.2020	500.410	0,01 %
Boeing Co.	\$ 500.000	2,35 %	30.10.2021	500.271	0,01 %
Sempra Energy	\$ 500.000	2,40 %	15.03.2020	500.216	0,01 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 500.000	2,40 %	06.03.2022	499.853	0,01 %
Simon International Finance SCA	€ 400.000	1,38 %	18.11.2022	499.807	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 500.000	2,50 %	15.10.2022	499.438	0,01 %
AT&T, Inc.	€ 400.000	1,45 %	01.06.2022	499.201	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.^	\$ 500.000	2,66 %	16.05.2023	499.148	0,01 %
Walt Disney Co.	\$ 500.000	1,95 %	04.03.2020	498.317	0,01 %
McDonald's Corp.	\$ 500.000	1,88 %	29.05.2019	498.288	0,01 %
Anthem, Inc.	\$ 500.000	2,25 %	15.08.2019	497.766	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 500.000	2,00 %	03.11.2020	497.685	0,01 %
Merck & Co., Inc.	\$ 500.000	2,75 %	10.02.2025	497.612	0,01 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 500.000	3,63 %	15.01.2024	497.597	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 471.992	4,50 %	20.11.2044	497.555	0,01 %
Kinder Morgan, Inc.	€ 400.000	1,50 %	16.03.2022	497.426	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 500.000	3,30 %	23.08.2029	497.381	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	€ 400.000	1,25 %	17.09.2021	497.376	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 500.000	2,55 %	29.11.2022	497.373	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 500.000	1,88 %	28.12.2020	497.346	0,01 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 500.000	1,82 %	15.09.2022	497.333	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 500.000	1,73 %	25.07.2019	497.180	0,01 %
Federal Home Loan Banks	\$ 500.000	1,38 %	18.03.2019	497.147	0,01 %
PepsiCo, Inc.	\$ 500.000	1,55 %	02.05.2019	497.037	0,01 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 500.000	2,38 %	15.01.2020	497.009	0,01 %
Coca-Cola Co.	\$ 500.000	1,88 %	27.10.2020	496.676	0,01 %
Capital One Financial Corp.	\$ 500.000	3,75 %	28.07.2026	496.569	0,01 %
General Electric Co.	€ 400.000	1,25 %	26.05.2023	496.137	0,01 %
Voya Financial, Inc.	\$ 500.000	3,13 %	15.07.2024	495.923	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 500.000	1,50 %	12.09.2019	495.833	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 500.000	2,30 %	11.05.2022	495.794	0,01 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 500.000	2,55 %	15.10.2022	495.653	0,01 %
Union Electric Co.	\$ 500.000	2,95 %	15.06.2027	495.331	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal National Mortgage Association	\$ 500.000	1,00 %	26.02.2019	495.279	0,01 %
AT&T, Inc.	£ 300.000	5,20 %	18.11.2033	495.087	0,01 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	\$ 450.000	5,63 %	01.03.2025	495.000	0,01 %
Andeavor	\$ 450.000	5,13 %	15.12.2026	495.000	0,01 %
Fifth Third Bank	\$ 500.000	2,25 %	14.06.2021	494.552	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 450.000	4,00 %	11.04.2043	494.410	0,01 %
Phillips 66 Partners LP	\$ 500.000	3,55 %	01.10.2026	494.256	0,01 %
Port Authority of New York & New Jersey	\$ 400.000	4,93 %	01.10.2051	494.248	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 457.132	5,00 %	01.06.2035	494.228	0,01 %
Newmont Mining Corp.	\$ 450.000	4,88 %	15.03.2042	494.163	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 500.000	1,50 %	22.06.2020	494.010	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 489.169	3,00 %	20.05.2046	493.953	0,01 %
Sempra Energy	\$ 500.000	1,63 %	07.10.2019	493.921	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 468.289	4,50 %	20.10.2043	493.684	0,01 %
Markel Corp.	\$ 500.000	3,50 %	01.11.2027	493.655	0,01 %
Tyco Electronics Group SA	\$ 500.000	3,13 %	15.08.2027	493.612	0,01 %
First Republic Bank	\$ 500.000	2,50 %	06.06.2022	493.337	0,01 %
Ecolab, Inc.	\$ 500.000	2,38 %	10.08.2022	493.331	0,01 %
Mondelez International Holdings Netherlands BV	\$ 500.000	1,63 %	28.10.2019	493.146	0,01 %
EOG Resources, Inc.	\$ 500.000	2,63 %	15.03.2023	493.046	0,01 %
Hess Corp.	\$ 450.000	6,00 %	15.01.2040	492.931	0,01 %
Compass Bank	\$ 500.000	2,88 %	29.06.2022	492.798	0,01 %
AT&T, Inc.	€ 400.000	3,15 %	04.09.2036	492.664	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 425.000	4,80 %	01.04.2044	492.553	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 350.000	6,63 %	15.11.2030	492.213	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 500.000	4,80 %	15.06.2044	491.617	0,01 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	\$ 500.000	2,40 %	23.09.2021	491.341	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 473.116	3,50 %	20.03.2042	491.185	0,01 %
Cox Communications, Inc.	\$ 500.000	3,15 %	15.08.2024	490.760	0,01 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 450.000	4,25 %	15.09.2044	490.674	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 473.145	3,50 %	01.12.2025	490.554	0,01 %
Aflac, Inc.	\$ 500.000	2,88 %	15.10.2026	490.470	0,01 %
Forest Laboratories LLC	\$ 465.000	4,88 %	15.02.2021	490.109	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 452.962	4,50 %	01.07.2040	489.975	0,01 %
Amazon.com, Inc.	\$ 450.000	4,25 %	22.08.2057	489.941	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 500.000	1,38 %	26.02.2021	489.468	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 469.326	3,50 %	01.06.2031	489.442	0,01 %
PPL Capital Funding, Inc.	\$ 500.000	3,10 %	15.05.2026	489.342	0,01 %
Monsanto Co.	\$ 500.000	2,85 %	15.04.2025	488.874	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 479.679	3,00 %	01.03.2027	488.780	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 487.000	2,85 %	11.05.2024	488.555	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 467.136	4,00 %	01.08.2044	488.530	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 487.360	3,00 %	01.01.2046	488.471	0,01 %
Wells Fargo & Co.	\$ 500.000	3,00 %	23.10.2026	487.316	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 500.000	2,47 %	25.04.2026	487.280	0,01 %
DH Europe Finance SA	€ 400.000	1,00 %	08.07.2019	486.723	0,01 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 500.000	2,70 %	01.11.2023	486.002	0,01 %
PepsiCo, Inc.	\$ 500.000	3,45 %	06.10.2046	485.413	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 500.000	3,40 %	15.11.2046	485.346	0,01 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 456.472	4,50 %	01.06.2047	485.282	0,01 %
3M Co.	\$ 500.000	1,63 %	19.09.2021	484.845	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 500.000	1,25 %	17.08.2021	484.573	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 470.897	3,50 %	01.08.2042	483.791	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 469.701	3,50 %	01.01.2045	483.572	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 473.471	3,00 %	01.10.2030	482.437	0,01 %
Ford Credit Canada Co.	CAD 600.000	2,92 %	16.09.2020	481.844	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 460.964	3,50 %	01.12.2029	481.322	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 500.000	2,45 %	04.08.2026	480.252	0,01 %
Target Corp.	\$ 500.000	2,50 %	15.04.2026	479.835	0,01 %
Caterpillar, Inc.	\$ 450.000	3,80 %	15.08.2042	479.774	0,01 %
Princeton University	\$ 465.000	4,95 %	01.03.2019	479.605	0,01 %
Federal Home Loan Banks	\$ 350.000	5,50 %	15.07.2036	479.539	0,01 %
Realty Income Corp.	\$ 500.000	3,00 %	15.01.2027	478.362	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 460.610	3,50 %	20.08.2043	478.162	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	\$ 500.000	2,85 %	31.01.2023	478.099	0,01 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 475.000	4,30 %	20.05.2047	477.850	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 500.000	3,13 %	15.01.2025	477.645	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 477.293	3,00 %	01.11.2042	477.640	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 472.555	2,50 %	01.11.2027	477.043	0,01 %
American Airlines 2016-3 Klasse AA Pass Through Trust	\$ 486.193	3,00 %	15.10.2028	476.612	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 454.577	4,00 %	20.01.2046	476.140	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 450.000	3,85 %	15.07.2036	475.521	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 453.746	4,00 %	20.04.2042	475.514	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 447.643	4,00 %	01.08.2044	475.219	0,01 %
Xcel Energy, Inc.	\$ 350.000	6,50 %	01.07.2036	475.073	0,01 %
International Business Machines Corp.	\$ 450.000	4,00 %	20.06.2042	474.304	0,01 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 464.063	3,00 %	01.03.2033	474.056	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 458.882	3,50 %	01.09.2044	473.578	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 471.907	3,00 %	01.11.2042	473.418	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 338.000	6,25 %	15.07.2032	473.270	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 470.413	3,00 %	01.09.2042	472.941	0,01 %
Fluor Corp.	€ 380.000	1,75 %	21.03.2023	471.799	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 471.389	3,00 %	01.02.2047	471.736	0,01 %
Johnson Controls International plc	\$ 400.000	5,13 %	14.09.2045	471.682	0,01 %
Tanger Properties LP	\$ 500.000	3,13 %	01.09.2026	471.577	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 466.558	2,50 %	01.12.2027	470.991	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 500.000	2,63 %	15.08.2026	470.739	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 475.000	1,35 %	18.05.2019	470.684	0,01 %
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl	€ 400.000	1,10 %	09.11.2027	469.386	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 450.651	3,50 %	01.05.2032	469.267	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 452.189	3,50 %	01.10.2025	468.792	0,01 %
State of Wisconsin	\$ 450.000	3,95 %	01.05.2036	468.023	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 447.487	4,00 %	15.07.2045	467.928	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 443.794	4,50 %	20.03.2044	467.894	0,01 %
Protective Life Global Funding	\$ 475.000	2,62 %	22.08.2022	467.643	0,01 %
Medtronic, Inc.	\$ 450.000	3,50 %	15.03.2025	467.582	0,01 %
Reynolds American, Inc.	\$ 375.000	5,85 %	15.08.2045	467.473	0,01 %
MidAmerican Energy Co.	\$ 390.000	4,80 %	15.09.2043	467.005	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 448.967	3,50 %	01.11.2025	466.987	0,01 %
Trans-Allegheny Interstate Line Co.	\$ 450.000	3,85 %	01.06.2025	466.911	0,01 %
Mylan NV	€ 380.000	1,25 %	23.11.2020	466.854	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 457.087	3,00 %	01.04.2033	466.453	0,01 %
International Flavors & Fragrances, Inc.	€ 370.000	1,75 %	14.03.2024	466.343	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.^	\$ 450.000	3,78 %	01.02.2028	465.654	0,01 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 400.000	4,70 %	15.05.2046	464.933	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 450.000	3,80 %	15.03.2022	464.727	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 457.533	3,00 %	20.08.2044	463.688	0,01 %
Bank of America Corp.	£ 300.000	5,50 %	22.11.2021	463.108	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 422.212	5,50 %	01.01.2040	462.891	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 480.000	0,00 %	09.10.2019	462.800	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 446.125	3,50 %	01.11.2037	462.765	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 439.409	4,00 %	01.12.2039	462.749	0,01 %
University of Texas System	\$ 385.000	4,79 %	15.08.2046	462.366	0,01 %
Port Authority of New York & New Jersey	\$ 400.000	4,46 %	01.10.2062	461.892	0,01 %
Conagra Brands, Inc.	\$ 457.000	3,20 %	25.01.2023	461.799	0,01 %
Wells Fargo & Co.	£ 344.000	1,38 %	30.06.2022	461.755	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 475.000	2,00 %	08.08.2023	461.577	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 350.000	5,13 %	23.10.2019	459.334	0,01 %
Viacom, Inc.	\$ 533.000	4,38 %	15.03.2043	459.313	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 435.686	4,00 %	01.12.2040	458.814	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 450.000	3,13 %	03.11.2025	458.798	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 428.064	4,50 %	01.11.2040	458.037	0,01 %
Abbott Laboratories	\$ 450.000	3,40 %	30.11.2023	457.846	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 444.935	3,50 %	01.11.2045	457.808	0,01 %
US Treasury Note	\$ 460.000	2,25 %	15.11.2024	457.484	0,01 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	\$ 450.000	3,30 %	01.04.2021	457.133	0,01 %
Southwestern Public Service Co.	\$ 445.000	3,30 %	15.06.2024	456.600	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 425.000	4,00 %	12.02.2055	456.565	0,01 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 455.000	3,25 %	15.01.2028	455.930	0,01 %
Kansas Development Finance Authority	\$ 400.000	4,93 %	15.04.2045	455.848	0,01 %
Fidelity National Information Services, Inc.	€ 380.000	0,40 %	15.01.2021	455.432	0,01 %
Columbia Pipeline Group, Inc.	\$ 450.000	3,30 %	01.06.2020	455.424	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Altria Group, Inc.	\$ 425.000	4,75 %	05.05.2021	455.370	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 422.922	5,00 %	20.10.2039	455.190	0,01 %
Citigroup, Inc.	\$ 400.000	4,65 %	30.07.2045	455.154	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 450.000	3,00 %	09.02.2024	455.147	0,01 %
Spirit AeroSystems, Inc.	\$ 450.000	3,85 %	15.06.2026	454.922	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 436.517	3,50 %	01.04.2032	454.545	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 434.548	4,00 %	01.07.2044	454.462	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 452.318	3,00 %	01.12.2042	454.333	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 450.000	3,25 %	16.05.2027	454.096	0,01 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	\$ 450.000	5,40 %	01.10.2047	453.701	0,01 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 450.000	3,70 %	06.06.2027	453.401	0,01 %
Simon Property Group LP	\$ 450.000	3,38 %	15.06.2027	453.282	0,01 %
Estee Lauder Cos, Inc.	\$ 450.000	3,15 %	15.03.2027	453.053	0,01 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	\$ 450.000	2,70 %	18.11.2019	452.841	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 417.467	4,50 %	01.08.2041	452.293	0,01 %
Merck & Co., Inc.	€ 380.000	0,50 %	02.11.2024	451.817	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 439.701	3,50 %	01.05.2046	451.754	0,01 %
Comcast Corp.	\$ 450.000	3,15 %	15.02.2028	451.730	0,01 %
ACE Capital Trust II	\$ 300.000	9,70 %	01.04.2030	451.500	0,01 %
Sempra Energy	\$ 350.000	6,00 %	15.10.2039	451.499	0,01 %
Bank 2018-BNK ⁸	\$ 450.000	3,18 %	15.09.2060	451.260	0,01 %
Andeavor	\$ 450.000	3,80 %	01.04.2028	450.984	0,01 %
Prcoa Global Funding I	\$ 450.000	2,55 %	24.11.2020	450.756	0,01 %
Kroger Co.	\$ 450.000	2,30 %	15.01.2019	449.847	0,01 %
Ally Auto Receivables Trust 2017	\$ 453.000	1,75 %	15.12.2021	449.587	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 424.289	4,50 %	20.02.2039	449.103	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 416.050	5,00 %	01.01.2039	449.015	0,01 %
Wells Fargo & Co.	\$ 450.000	2,15 %	30.01.2020	449.008	0,01 %
DR Horton, Inc.	\$ 400.000	5,75 %	15.08.2023	448.662	0,01 %
Halliburton Co.	\$ 400.000	4,85 %	15.11.2035	448.374	0,01 %
Bank of America Corp.^1	\$ 448.000	3,00 %	20.12.2023	448.288	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 450.000	1,80 %	13.11.2019	448.172	0,01 %
GM Financial Automobile Leasing Trust 2017	\$ 450.000	2,12 %	20.09.2021	448.043	0,01 %
American Express Credit Account Master Trust	\$ 450.000	2,04 %	15.05.2023	447.870	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 437.713	3,00 %	20.02.2027	447.747	0,01 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	\$ 450.000	1,80 %	20.09.2021	447.611	0,01 %
Home Depot, Inc.	\$ 450.000	1,80 %	05.06.2020	446.310	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 400.000	4,13 %	15.06.2047	446.248	0,01 %
Simon Property Group LP	\$ 450.000	3,25 %	30.11.2026	445.713	0,01 %
Union Electric Co.	\$ 425.000	3,90 %	15.09.2042	445.460	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 419.796	4,00 %	01.07.2042	444.618	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 400.000	4,30 %	08.07.2034	444.466	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 429.914	3,50 %	01.07.2042	444.394	0,01 %
EOG Resources, Inc.	\$ 425.000	5,63 %	01.06.2019	444.240	0,01 %
Pfizer, Inc.	\$ 400.000	4,13 %	15.12.2046	444.193	0,01 %
VEREIT Operating Partnership LP	\$ 450.000	3,95 %	15.08.2027	444.155	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 424.271	4,00 %	20.05.2045	444.127	0,01 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 325.000	5,90 %	15.02.2039	444.073	0,01 %
Bay Area Toll Authority	\$ 300.000	6,26 %	01.04.2049	443.196	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 412.812	5,50 %	01.11.2038	443.159	0,01 %
General Motors Co.	\$ 375.000	6,25 %	02.10.2043	442.105	0,01 %
MetLife, Inc.	\$ 425.000	3,60 %	13.11.2025	441.989	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 432.893	3,00 %	01.11.2032	441.764	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 424.380	3,50 %	20.01.2042	441.729	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 427.066	3,50 %	01.12.2042	441.422	0,01 %
Merck & Co., Inc.	\$ 425.000	3,70 %	10.02.2045	441.024	0,01 %
John Deere Capital Corp.	\$ 450.000	2,80 %	08.09.2027	440.826	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 420.360	4,00 %	20.09.2041	440.528	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 400.000	4,85 %	15.03.2044	438.808	0,01 %
Electronic Arts, Inc.	\$ 400.000	4,80 %	01.03.2026	438.571	0,01 %
Omega Healthcare Investors, Inc.	\$ 450.000	4,50 %	01.04.2027	438.188	0,01 %
McDonald's Corp.	\$ 425.000	3,50 %	01.03.2027	437.960	0,01 %
New Jersey Economic Development Authority	\$ 350.000	7,43 %	15.02.2029	437.731	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 423.322	3,50 %	01.01.2042	437.552	0,01 %
Prudential Financial, Inc.^	\$ 400.000	5,88 %	15.09.2042	437.288	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 423.472	3,50 %	01.12.2041	436.790	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Amgen, Inc.	\$ 425.000	3,45 %	01.10.2020	436.329	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 436.465	2,50 %	01.10.2031	436.172	0,01 %
FirstEnergy Corp.	\$ 325.000	7,38 %	15.11.2031	436.108	0,01 %
Fidelity National Information Services, Inc.	\$ 450.000	3,00 %	15.08.2026	435.187	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 405.123	4,50 %	20.10.2040	434.859	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 420.396	3,50 %	01.11.2044	434.543	0,01 %
Citigroup, Inc.	£ 200.000	6,80 %	25.06.2038	434.155	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 400.000	6,85 %	15.02.2020	433.578	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 413.978	4,00 %	01.10.2044	432.936	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 399.782	5,00 %	01.06.2035	431.368	0,01 %
Biogen, Inc.	\$ 425.000	2,90 %	15.09.2020	430.973	0,01 %
Union Pacific Corp.	\$ 400.000	4,05 %	15.11.2045	430.514	0,01 %
Pfizer, Inc.	\$ 375.000	4,40 %	15.05.2044	430.409	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 375.000	6,00 %	15.08.2040	430.221	0,01 %
Union Pacific Corp.	\$ 400.000	4,05 %	01.03.2046	429.961	0,01 %
GE Capital Canada Funding Co.	CAD 500.000	4,60 %	26.01.2022	429.698	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 409.317	4,50 %	20.07.2047	429.594	0,01 %
Xylem, Inc.	\$ 400.000	4,38 %	01.11.2046	428.852	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 427.296	3,00 %	01.02.2047	427.678	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 425.377	3,00 %	01.07.2043	427.267	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 425.000	2,85 %	14.02.2023	426.508	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 425.000	2,55 %	15.10.2019	426.298	0,01 %
Citigroup, Inc.^	\$ 425.000	3,52 %	27.10.2028	426.282	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 410.270	3,50 %	20.04.2044	425.898	0,01 %
Stryker Corp.	\$ 375.000	4,63 %	15.03.2046	425.853	0,01 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	\$ 425.000	2,70 %	01.04.2020	425.645	0,01 %
Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue	\$ 300.000	6,55 %	15.05.2048	425.337	0,01 %
Duke Energy Indiana LLC	\$ 325.000	6,12 %	15.10.2035	424.602	0,01 %
Agilent Technologies, Inc.	\$ 400.000	5,00 %	15.07.2020	424.205	0,01 %
Home Depot, Inc.	\$ 400.000	4,40 %	01.04.2021	423.854	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 412.559	3,50 %	01.07.2046	423.847	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 389.340	5,00 %	20.07.2040	423.807	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 407.253	3,50 %	01.01.2032	423.682	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 419.944	2,50 %	01.06.2028	423.613	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 420.564	3,00 %	01.09.2042	423.535	0,01 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2017	\$ 425.000	2,01 %	15.03.2022	423.468	0,01 %
Honeywell International, Inc.	\$ 400.000	4,25 %	01.03.2021	423.080	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 410.724	3,50 %	01.09.2045	422.162	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 391.636	5,00 %	01.07.2041	421.748	0,01 %
Allergan Funding SCS	\$ 400.000	4,55 %	15.03.2035	421.403	0,01 %
Citigroup, Inc.	\$ 420.000	2,55 %	08.04.2019	421.378	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 406.275	3,50 %	20.01.2047	420.422	0,01 %
Citigroup, Inc.	\$ 425.000	2,70 %	27.10.2022	420.399	0,01 %
Tennessee Valley Authority	\$ 300.000	5,88 %	01.04.2036	418.960	0,01 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	CAD 500.000	4,32 %	15.05.2047	418.919	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 399.109	4,00 %	20.10.2040	418.881	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 395.712	4,00 %	01.08.2044	418.865	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 417.658	3,00 %	01.07.2045	418.674	0,01 %
ConocoPhillips Co.	\$ 400.000	4,20 %	15.03.2021	418.560	0,01 %
Medtronic, Inc.	\$ 400.000	3,63 %	15.03.2024	418.094	0,01 %
Kellogg Co.	\$ 400.000	4,00 %	15.12.2020	417.666	0,01 %
Comcast Corp.	\$ 300.000	7,05 %	15.03.2033	417.598	0,01 %
Anthem, Inc.	\$ 375.000	4,65 %	15.08.2044	417.307	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 400.000	4,25 %	15.05.2023	417.092	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 402.055	3,50 %	01.09.2033	417.034	0,01 %
Municipal Electric Authority of Georgia	\$ 325.000	6,64 %	01.04.2057	416.598	0,01 %
US Treasury Note	\$ 424.000	1,13 %	30.04.2020	416.448	0,01 %
Amgen, Inc.	\$ 400.000	3,63 %	22.05.2024	416.207	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 394.428	4,00 %	01.01.2041	415.381	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 400.000	3,80 %	15.09.2047	414.969	0,01 %
Deere & Co.	\$ 300.000	7,13 %	03.03.2031	414.525	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 425.181	2,00 %	01.12.2031	414.150	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 400.000	3,35 %	25.11.2026	413.976	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 400.478	3,50 %	01.10.2041	413.961	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.^	\$ 400.000	3,96 %	15.11.2048	412.707	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 360.000	4,75 %	15.09.2044	412.293	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Duke Energy Carolinas LLC	\$ 400.000	3,75 %	01.06.2045	412.246	0,01 %
Block Financial LLC	\$ 400.000	4,13 %	01.10.2020	410.703	0,01 %
Priceline Group, Inc.	€ 336.000	1,80 %	03.03.2027	410.357	0,01 %
3M Co.	€ 333.000	0,95 %	15.05.2023	410.129	0,01 %
MetLife, Inc.	\$ 350.000	4,88 %	13.11.2043	410.111	0,01 %
Devon Energy Corp.	\$ 300.000	7,95 %	15.04.2032	409.912	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 398.895	3,50 %	01.06.2046	409.810	0,01 %
McDonald's Corp.	\$ 400.000	3,38 %	26.05.2025	409.224	0,01 %
Intel Corp.	AUD 500.000	4,00 %	01.12.2022	408.744	0,01 %
Fluor Corp.	\$ 400.000	3,38 %	15.09.2021	408.661	0,01 %
Ares Capital Corp.	\$ 415.000	3,50 %	10.02.2023	408.465	0,01 %
Arizona Public Service Co.	\$ 400.000	3,75 %	15.05.2046	408.176	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 400.000	3,70 %	09.05.2023	408.127	0,01 %
Anthem, Inc.	\$ 350.000	5,10 %	15.01.2044	407.962	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 387.572	4,00 %	01.12.2041	407.644	0,01 %
American International Group, Inc.	\$ 400.000	4,38 %	15.01.2055	407.489	0,01 %
Baker Hughes a GE Co. LLC	\$ 400.000	3,20 %	15.08.2021	407.329	0,01 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 400.000	3,58 %	23.07.2020	407.243	0,01 %
City of Houston TX	\$ 345.000	6,29 %	01.03.2032	406.907	0,01 %
Rockwell Collins, Inc.	\$ 400.000	3,50 %	15.03.2027	406.148	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 400.000	3,69 %	05.06.2028	405.614	0,01 %
Apple, Inc.	AUD 500.000	3,70 %	28.08.2022	404.801	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 400.000	3,20 %	13.07.2020	404.472	0,01 %
Perrigo Finance Unlimited Co.	\$ 400.000	3,90 %	15.12.2024	404.259	0,01 %
MetLife, Inc.	\$ 350.000	6,40 %	15.12.2036	404.250	0,01 %
Applied Materials, Inc.	\$ 400.000	2,63 %	01.10.2020	404.188	0,01 %
Bank of America Corp.	AUD 500.000	4,25 %	05.03.2020	403.763	0,01 %
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2013	\$ 400.000	2,96 %	15.04.2046	403.584	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 400.000	2,85 %	15.04.2021	403.358	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 300.000	6,15 %	15.02.2041	403.124	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 389.262	3,50 %	20.04.2046	403.027	0,01 %
Apache Corp.	\$ 400.000	3,25 %	15.04.2022	402.942	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 401.801	3,00 %	01.08.2043	402.716	0,01 %
Merck & Co., Inc.	\$ 400.000	2,80 %	18.05.2023	402.687	0,01 %
Eli Lilly & Co.	\$ 375.000	3,95 %	15.05.2047	401.939	0,01 %
Chevron Corp.	\$ 400.000	2,42 %	17.11.2020	401.766	0,01 %
Coca-Cola Co.	\$ 400.000	2,88 %	27.10.2025	401.680	0,01 %
Walgreen Co.	\$ 400.000	3,10 %	15.09.2022	401.648	0,01 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 400.000	3,20 %	01.02.2027	401.422	0,01 %
Halliburton Co.	\$ 350.000	5,00 %	15.11.2045	401.177	0,01 %
Procter & Gamble Co.	£ 300.000	1,38 %	03.05.2025	400.874	0,01 %
Time Warner Cable LLC	\$ 425.000	4,50 %	15.09.2042	400.843	0,01 %
Corporate Office Properties LP	\$ 400.000	3,60 %	15.05.2023	400.672	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 382.581	4,00 %	01.10.2045	400.588	0,01 %
Union Pacific Corp.	\$ 400.000	2,25 %	19.06.2020	400.580	0,01 %
Comcast Corp.	\$ 400.000	2,75 %	01.03.2023	400.476	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 400.000	2,50 %	09.02.2022	400.388	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	\$ 400.000	2,15 %	14.12.2018	400.360	0,01 %
John Deere Capital Corp.	\$ 400.000	2,80 %	06.03.2023	400.285	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	£ 300.000	3,13 %	02.11.2035	400.233	0,01 %
Time Warner, Inc.	\$ 400.000	3,60 %	15.07.2025	400.142	0,01 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	\$ 400.000	3,55 %	01.04.2025	400.125	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 400.000	2,05 %	01.04.2019	400.029	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 379.812	4,00 %	01.01.2041	399.886	0,01 %
Chevron Corp.	\$ 400.000	1,79 %	16.11.2018	399.506	0,01 %
Aetna, Inc.	\$ 400.000	2,20 %	15.03.2019	399.415	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 400.000	2,67 %	25.12.2024	398.956	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 376.616	4,00 %	01.05.2044	398.822	0,01 %
NBCUniversal Media LLC	\$ 375.000	5,15 %	30.04.2020	398.619	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 400.000	2,46 %	27.03.2020	398.613	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 375.000	4,00 %	15.07.2046	398.574	0,01 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 400.000	1,85 %	20.05.2019	398.572	0,01 %
Citizens Bank NA	\$ 400.000	2,55 %	13.05.2021	398.560	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 369.247	5,00 %	15.03.2039	398.538	0,01 %
DXC Technology Co.	\$ 375.000	4,75 %	15.04.2027	398.271	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	\$ 400.000	2,00 %	27.01.2020	398.156	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 400.000	1,38 %	28.01.2019	398.146	0,01 %
Citigroup, Inc.^	\$ 400.000	2,88 %	24.07.2023	398.029	0,01 %
3M Co.	\$ 400.000	2,88 %	15.10.2027	397.700	0,01 %
Altria Group, Inc.	\$ 375.000	4,00 %	31.01.2024	397.690	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 398.000	2,20 %	22.10.2019	397.549	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 400.000	2,00 %	13.11.2020	397.471	0,01 %
Alabama Power Co.	\$ 400.000	2,45 %	30.03.2022	397.364	0,01 %
DDR Corp.	\$ 400.000	3,38 %	15.05.2023	397.278	0,01 %
Citizens Bank NA	\$ 400.000	2,20 %	26.05.2020	396.862	0,01 %
MassMutual Global Funding II	\$ 400.000	2,75 %	22.06.2024	396.844	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 378.668	4,00 %	20.06.2042	396.842	0,01 %
Capital One Financial Corp.	\$ 400.000	2,40 %	30.10.2020	396.761	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 384.426	3,50 %	01.01.2043	396.506	0,01 %
Citibank NA	\$ 400.000	2,10 %	12.06.2020	396.428	0,01 %
Cargill, Inc.	€ 300.000	2,50 %	15.02.2023	396.403	0,01 %
Capital One Na	\$ 400.000	2,65 %	08.08.2022	395.852	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 380.477	3,50 %	01.11.2031	395.813	0,01 %
Bank of America Corp.	\$ 400.000	2,50 %	21.10.2022	395.716	0,01 %
Simon Property Group LP	\$ 400.000	2,35 %	30.01.2022	395.624	0,01 %
Ford Credit Canada Co.	CAD 500.000	2,71 %	23.02.2022	394.824	0,01 %
Morgan Stanley	\$ 400.000	3,13 %	27.07.2026	394.677	0,01 %
KeyBank NA	\$ 400.000	2,40 %	09.06.2022	394.484	0,01 %
Apple, Inc.	AUD 500.000	2,85 %	28.08.2019	394.151	0,01 %
Cox Communications, Inc.	\$ 400.000	3,50 %	15.08.2027	394.058	0,01 %
American Municipal Power, Inc.	\$ 300.000	5,94 %	15.02.2047	393.954	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 400.000	2,90 %	12.09.2027	393.849	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 400.000	0,88 %	02.08.2019	393.554	0,01 %
Federal Home Loan Banks	\$ 400.000	0,88 %	05.08.2019	393.520	0,01 %
TTX Co.	\$ 400.000	3,90 %	01.02.2045	392.554	0,01 %
ITC Holdings Corp.	\$ 325.000	5,30 %	01.07.2043	392.510	0,01 %
Connecticut Light & Power Co.	\$ 350.000	4,30 %	15.04.2044	392.434	0,01 %
Mastercard, Inc.	€ 300.000	2,10 %	01.12.2027	392.073	0,01 %
Comcast Cable Communications Holdings, Inc.	\$ 300.000	9,46 %	15.11.2022	391.906	0,01 %
Progress Energy, Inc.	\$ 300.000	6,00 %	01.12.2039	391.503	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 375.000	3,70 %	01.04.2024	391.477	0,01 %
Covidien International Finance SA	\$ 375.000	4,20 %	15.06.2020	391.468	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 362.552	5,00 %	01.03.2036	391.172	0,01 %
Ford Motor Co.	\$ 375.000	4,35 %	08.12.2026	390.823	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 374.825	3,50 %	01.10.2025	389.854	0,01 %
Citigroup, Inc.	\$ 244.000	8,13 %	15.07.2039	389.089	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 400.000	2,95 %	01.03.2026	388.802	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 363.848	4,50 %	01.06.2041	388.437	0,01 %
Los Angeles Community College District	\$ 250.000	6,75 %	01.08.2049	388.043	0,01 %
PepsiCo, Inc.	\$ 335.000	4,60 %	17.07.2045	387.825	0,01 %
General Electric Co.	£ 200.000	5,38 %	18.12.2040	387.001	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 371.826	3,50 %	01.05.2032	386.821	0,01 %
New Jersey Turnpike Authority	\$ 250.000	7,41 %	01.01.2040	385.880	0,01 %
United Technologies Corp.	\$ 300.000	6,05 %	01.06.2036	384.902	0,01 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2016	\$ 387.000	2,21 %	15.05.2024	384.612	0,01 %
Xylem, Inc.	€ 300.000	2,25 %	11.03.2023	384.608	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 400.000	2,40 %	15.11.2026	382.804	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 375.000	3,95 %	15.01.2025	382.749	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 359.739	4,50 %	01.10.2046	382.669	0,01 %
Los Angeles Unified School District	\$ 300.000	5,75 %	01.07.2034	382.557	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 377.558	3,00 %	20.03.2045	382.280	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 375.316	3,00 %	01.01.2035	382.056	0,01 %
United Technologies Corp.	\$ 300.000	5,70 %	15.04.2040	381.784	0,01 %
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue	\$ 300.000	5,51 %	01.08.2037	381.675	0,01 %
Georgia-Pacific LLC	\$ 300.000	8,00 %	15.01.2024	381.561	0,01 %
Actavis, Inc.	\$ 370.000	4,63 %	01.10.2042	381.108	0,01 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	\$ 375.000	3,38 %	01.02.2022	381.008	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 368.558	3,50 %	01.10.2044	380.949	0,01 %
North Texas Tollway Authority	\$ 250.000	6,72 %	01.01.2049	380.323	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 367.941	3,50 %	01.10.2026	380.104	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 351.674	5,00 %	01.07.2039	379.549	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Microsoft Corp.	\$ 375.000	2,88 %	06.02.2024	379.407	0,01 %
Bank of America Corp.	€ 300.000	1,63 %	14.09.2022	379.336	0,01 %
Ford Motor Co.	\$ 350.000	5,29 %	08.12.2046	379.294	0,01 %
Newell Brands Inc.	\$ 375.000	3,15 %	01.04.2021	379.212	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 358.169	4,50 %	20.05.2040	379.020	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 370.987	3,00 %	01.05.2031	378.020	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 366.018	3,50 %	01.08.2043	377.749	0,01 %
Wells Fargo & Co.	€ 300.000	1,63 %	02.06.2025	376.970	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 369.842	3,00 %	01.08.2031	376.860	0,01 %
American Airlines 2016-2 Klasse AA Pass Through Trust	\$ 379.200	3,20 %	15.06.2028	376.512	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 375.000	2,45 %	27.11.2020	375.924	0,01 %
Bank of America Corp. ^	€ 300.000	1,78 %	04.05.2027	375.518	0,01 %
Nissan Auto Receivables 2017-B Owner Trust	\$ 378.000	1,75 %	15.10.2021	375.086	0,01 %
Prologis LP	€ 303.000	1,38 %	07.10.2020	375.058	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 352.915	4,00 %	01.11.2031	373.895	0,01 %
AbbVie, Inc.	€ 300.000	2,13 %	17.11.2028	373.395	0,01 %
President & Fellows of Harvard College	\$ 300.000	4,88 %	15.10.2040	373.380	0,01 %
Illinois Tool Works, Inc.	€ 300.000	1,25 %	22.05.2023	373.369	0,01 %
Apple, Inc.	€ 300.000	1,00 %	10.11.2022	373.246	0,01 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 375.000	2,10 %	20.05.2020	373.191	0,01 %
Prologis LP	€ 300.000	1,38 %	13.05.2021	373.061	0,01 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 375.000	2,89 %	06.06.2022	372.979	0,01 %
Johnson & Johnson	\$ 350.000	3,75 %	03.03.2047	372.960	0,01 %
Liberty Property LP	\$ 350.000	4,40 %	15.02.2024	372.864	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 350.000	3,95 %	08.08.2056	372.863	0,01 %
RPM International, Inc.	\$ 375.000	4,25 %	15.01.2048	372.854	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 365.539	3,00 %	01.05.2027	372.476	0,01 %
Liberty Mutual Finance Europe DAC	€ 300.000	1,75 %	27.03.2024	372.430	0,01 %
MassMutual Global Funding II	\$ 376.000	1,55 %	11.10.2019	371.493	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 371.119	3,00 %	01.11.2046	371.391	0,01 %
PepsiCo, Inc.	\$ 375.000	1,85 %	30.04.2020	371.373	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 410.000	3,85 %	01.11.2042	371.302	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 356.048	4,00 %	20.02.2047	371.266	0,01 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 375.000	2,75 %	15.09.2022	370.996	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 359.852	3,50 %	01.11.2041	370.976	0,01 %
SunTrust Bank	\$ 375.000	3,30 %	15.05.2026	370.544	0,01 %
Hospitality Properties Trust	\$ 345.000	5,25 %	15.02.2026	370.308	0,01 %
Hess Corp.	\$ 300.000	7,88 %	01.10.2029	370.304	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 346.927	4,50 %	01.02.2041	370.303	0,01 %
Archer-Daniels-Midland Co.	\$ 305.000	5,38 %	15.09.2035	370.284	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 336.413	5,50 %	01.09.2041	369.894	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 361.835	3,00 %	20.07.2030	369.749	0,01 %
Bank of America Corp.	€ 300.000	1,38 %	26.03.2025	369.584	0,01 %
Intel Corp.	\$ 350.000	3,70 %	29.07.2025	369.531	0,01 %
Huntington Bancshares, Inc.	\$ 375.000	2,30 %	14.01.2022	368.994	0,01 %
Kraft Heinz Foods Co.	€ 300.000	2,25 %	25.05.2028	368.739	0,01 %
Citigroup, Inc.	\$ 350.000	4,40 %	10.06.2025	368.714	0,01 %
Home Depot, Inc.	\$ 350.000	3,90 %	15.06.2047	368.098	0,01 %
Southern Co.	\$ 375.000	3,25 %	01.07.2026	367.771	0,01 %
eBay, Inc.	\$ 400.000	4,00 %	15.07.2042	367.469	0,01 %
Molson Coors Brewing Co.	\$ 375.000	3,00 %	15.07.2026	366.842	0,01 %
Owens Corning	\$ 350.000	4,20 %	15.12.2022	366.805	0,01 %
Norfolk Southern Corp.	\$ 330.000	4,45 %	15.06.2045	366.764	0,01 %
Tennessee Valley Authority	\$ 250.000	6,15 %	15.01.2038	366.322	0,01 %
Southern Power Co.	€ 300.000	1,00 %	20.06.2022	366.315	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 354.180	3,50 %	01.08.2042	366.101	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 341.609	4,50 %	01.09.2038	365.733	0,01 %
Coca-Cola Co.	€ 300.000	0,75 %	09.03.2023	365.618	0,01 %
Johnson & Johnson	\$ 375.000	2,45 %	01.03.2026	364.822	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 346.341	4,00 %	01.08.2039	364.725	0,01 %
PG&E Corp.	\$ 364.000	2,40 %	01.03.2019	364.272	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 343.794	4,00 %	01.12.2043	364.061	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 360.365	2,50 %	01.12.2027	363.789	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 324.506	6,00 %	01.11.2037	363.559	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 346.348	4,00 %	01.12.2044	362.983	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 357.211	3,00 %	20.02.2043	362.902	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Comcast Corp.	\$ 340.000	4,20 %	15.08.2034	362.555	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 354.877	3,00 %	01.10.2032	362.517	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 350.000	3,50 %	15.03.2027	361.562	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 359.165	3,00 %	01.11.2042	361.482	0,01 %
Moody's Corp.	\$ 300.000	5,25 %	15.07.2044	360.759	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 350.954	3,50 %	01.06.2046	360.694	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 342.923	4,00 %	01.01.2041	359.999	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 353.987	3,00 %	01.08.2035	359.926	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 325.000	4,25 %	09.02.2047	359.534	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 349.240	3,50 %	01.03.2046	359.349	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 325.000	8,13 %	15.01.2020	359.045	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 333.752	4,50 %	20.06.2040	358.240	0,01 %
Time Warner Cable LLC	\$ 300.000	6,75 %	15.06.2039	358.229	0,01 %
Total System Services, Inc.	\$ 350.000	3,80 %	01.04.2021	357.878	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	\$ 300.000	5,30 %	01.02.2044	357.662	0,01 %
Government National Mortgage Association	\$ 341.045	4,00 %	20.10.2041	357.416	0,01 %
PPG Industries, Inc.	€ 300.000	0,88 %	03.11.2025	357.120	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 356.687	3,00 %	01.07.2046	356.948	0,01 %
Alabama Power Co.	\$ 350.000	3,70 %	01.12.2047	356.762	0,01 %
Crown Castle International Corp.	\$ 325.000	5,25 %	15.01.2023	355.827	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 343.350	3,50 %	01.06.2041	355.644	0,01 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 340.000	4,03 %	15.10.2047	355.488	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 325.000	5,70 %	01.03.2057	355.310	0,01 %
US Treasury Note	\$ 360.000	1,00 %	31.08.2019	354.938	0,01 %
Allstate Corp.	\$ 350.000	3,28 %	15.12.2026	354.765	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 250.000	6,63 %	15.11.2037	354.730	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 360.388	2,00 %	01.11.2027	354.557	0,01 %
Prudential Financial, Inc.^	\$ 325.000	5,63 %	15.06.2043	354.250	0,01 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 350.000	3,08 %	25.06.2027	353.832	0,01 %
Ford Motor Co.	\$ 350.000	4,75 %	15.01.2043	353.829	0,01 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 351.341	3,00 %	01.09.2042	353.820	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 331.244	4,50 %	01.09.2040	353.720	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 342.151	3,50 %	01.12.2041	353.658	0,01 %
TD Ameritrade Holding Corp.	\$ 350.000	2,95 %	01.04.2022	353.326	0,01 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	\$ 250.000	7,25 %	15.01.2033	353.285	0,01 %
Celgene Corp.	\$ 350.000	2,88 %	15.08.2020	353.220	0,01 %
Mylan NV	\$ 350.000	3,95 %	15.06.2026	353.142	0,01 %
National Oilwell Varco, Inc.	\$ 400.000	3,95 %	01.12.2042	352.834	0,00 %
Baker Hughes a GE Co. LLC	\$ 300.000	5,13 %	15.09.2040	352.339	0,00 %
WEA Finance LLC/Westfield UK & Europe Finance plc	\$ 350.000	2,70 %	17.09.2019	352.129	0,00 %
Sempra Energy	\$ 350.000	2,85 %	15.11.2020	351.635	0,00 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	\$ 250.000	6,50 %	15.09.2037	350.611	0,00 %
Bayer US Finance LLC	\$ 350.000	2,38 %	08.10.2019	350.608	0,00 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 350.000	2,30 %	11.09.2019	350.363	0,00 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	\$ 350.000	2,30 %	01.11.2020	349.719	0,00 %
SunTrust Bank	\$ 350.000	2,25 %	31.01.2020	349.059	0,00 %
Discovery Communications LLC	\$ 350.000	4,88 %	01.04.2043	349.056	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 333.634	4,00 %	01.11.2044	348.956	0,00 %
Sherwin-Williams Co.	\$ 350.000	2,25 %	15.05.2020	348.883	0,00 %
Wells Fargo Bank NA	\$ 250.000	6,60 %	15.01.2038	348.627	0,00 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 350.000	1,60 %	28.02.2019	348.319	0,00 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 350.000	2,35 %	15.12.2022	348.124	0,00 %
Reliance Standard Life Global Funding II	\$ 350.000	2,38 %	04.05.2020	347.993	0,00 %
McDonald's Corp.	\$ 300.000	4,88 %	09.12.2045	347.595	0,00 %
Merck & Co., Inc.	€ 300.000	1,38 %	02.11.2036	347.364	0,00 %
Xerox Corp.	\$ 350.000	2,75 %	01.09.2020	347.160	0,00 %
Arch Capital Finance LLC	\$ 300.000	5,03 %	15.12.2046	346.897	0,00 %
Discovery Communications LLC	\$ 350.000	3,95 %	20.03.2028	346.662	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 327.319	4,00 %	01.10.2044	346.634	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 328.868	4,00 %	01.12.2040	346.372	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 325.077	4,50 %	01.04.2044	345.508	0,00 %
New York Life Global Funding	\$ 350.000	1,50 %	24.10.2019	345.413	0,00 %
Microsoft Corp.	\$ 350.000	1,10 %	08.08.2019	345.218	0,00 %
Amazon.com, Inc.	\$ 325.000	3,88 %	22.08.2037	344.872	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 300.000	4,95 %	01.06.2045	344.701	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 353.885	2,00 %	01.11.2031	344.654	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Government National Mortgage Association	\$ 331.092	3,50 %	20.02.2043	344.429	0,00 %
Marathon Petroleum Corp.	\$ 275.000	6,50 %	01.03.2041	344.241	0,00 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 325.000	6,35 %	15.10.2045	344.190	0,00 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 325.000	5,38 %	15.01.2020	344.147	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 327.166	4,00 %	01.12.2042	343.790	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 331.386	3,50 %	01.12.2040	343.241	0,00 %
Seagate HDD Cayman	\$ 350.000	4,75 %	01.01.2025	343.000	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 335.788	3,00 %	01.10.2030	342.493	0,00 %
CVS Health Corp.	\$ 350.000	2,13 %	01.06.2021	341.934	0,00 %
Cox Communications, Inc.	\$ 350.000	3,35 %	15.09.2026	341.852	0,00 %
Zoetis, Inc.	\$ 350.000	3,00 %	12.09.2027	341.783	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 305.149	6,00 %	01.05.2041	341.071	0,00 %
Dow Chemical Co.	\$ 200.000	9,40 %	15.05.2039	341.055	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 324.752	4,00 %	20.06.2044	340.325	0,00 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 250.000	5,63 %	15.04.2041	340.256	0,00 %
MidAmerican Energy Co.	\$ 300.000	4,40 %	15.10.2044	340.246	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 322.054	4,00 %	01.06.2044	340.057	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 250.000	6,30 %	15.08.2037	339.498	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 314.632	5,00 %	15.04.2039	339.468	0,00 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	\$ 350.000	2,45 %	01.10.2023	339.278	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 250.000	6,45 %	15.03.2037	339.148	0,00 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 325.000	3,90 %	01.10.2025	339.021	0,00 %
Southern Copper Corp.	\$ 250.000	7,50 %	27.07.2035	338.767	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 322.008	4,00 %	01.06.2044	337.849	0,00 %
City of New York NY	\$ 250.000	6,27 %	01.12.2037	337.580	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 334.181	2,50 %	01.10.2027	337.354	0,00 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 250.000	5,63 %	01.04.2040	337.074	0,00 %
Air Lease Corp.	\$ 325.000	3,88 %	01.04.2021	336.626	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2017	\$ 339.000	1,69 %	15.11.2021	336.315	0,00 %
Omega Healthcare Investors, Inc.	\$ 325.000	5,25 %	15.01.2026	335.969	0,00 %
Zoetis, Inc.	\$ 300.000	4,70 %	01.02.2043	335.915	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 335.893	2,50 %	01.08.2031	335.514	0,00 %
Amazon.com, Inc.	\$ 325.000	3,30 %	05.12.2021	335.332	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 326.044	3,50 %	01.11.2045	335.022	0,00 %
Duke Energy Carolinas LLC	\$ 250.000	6,00 %	15.01.2038	334.951	0,00 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	\$ 300.000	4,30 %	15.05.2043	334.554	0,00 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	\$ 300.000	5,88 %	30.06.2026	334.500	0,00 %
DTE Electric Co.	\$ 325.000	3,45 %	01.10.2020	334.187	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 312.213	4,50 %	01.09.2039	333.804	0,00 %
Wal-Mart Stores, Inc.	€ 200.000	4,88 %	21.09.2029	333.772	0,00 %
US Treasury Note	\$ 335.000	2,00 %	31.10.2021	333.587	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 318.903	4,00 %	01.05.2046	333.532	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 325.000	3,85 %	26.01.2027	333.053	0,00 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 300.000	5,80 %	15.03.2035	332.827	0,00 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	\$ 300.000	6,25 %	15.03.2022	332.625	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 250.000	6,20 %	15.06.2036	332.477	0,00 %
AvalonBay Communities, Inc.	\$ 325.000	3,45 %	01.06.2025	332.378	0,00 %
Boeing Co.	\$ 250.000	5,88 %	15.02.2040	332.365	0,00 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates^	\$ 325.000	3,06 %	25.08.2024	332.303	0,00 %
City of San Antonio TX Electric & Gas Systems Revenue	\$ 250.000	5,81 %	01.02.2041	332.303	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 317.941	4,00 %	20.09.2046	331.628	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 316.388	4,00 %	20.05.2046	331.384	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 340.237	2,00 %	01.11.2031	331.357	0,00 %
Cardinal Health, Inc.	\$ 325.000	3,75 %	15.09.2025	331.213	0,00 %
Boeing Co.	\$ 225.000	6,88 %	15.03.2039	330.426	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 319.170	3,50 %	20.07.2047	330.310	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 319.878	3,50 %	01.07.2042	329.948	0,00 %
Los Angeles Department of Water & Power	\$ 250.000	5,72 %	01.07.2039	329.845	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 293.102	6,00 %	01.05.2037	329.115	0,00 %
Roper Technologies, Inc.	\$ 325.000	3,00 %	15.12.2020	328.768	0,00 %
GS Mortgage Securities Trust 2017	\$ 324.000	3,66 %	10.08.2050	328.458	0,00 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 325.000	3,14 %	25.11.2027	328.052	0,00 %
Allstate Corp.	\$ 300.000	4,20 %	15.12.2046	328.020	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 321.000	4,05 %	01.11.2052	327.963	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 317.273	3,50 %	01.10.2042	327.932	0,00 %
Pharmacia LLC	\$ 250.000	6,60 %	01.12.2028	327.906	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeitsdatum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal National Mortgage Association	\$ 320.768	3,00 %	01.06.2030	327.785	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 325.000	3,15 %	01.03.2026	327.688	0,00 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 250.000	6,88 %	26.01.2039	327.658	0,00 %
ConocoPhillips Holding Co.	\$ 250.000	6,95 %	15.04.2029	327.231	0,00 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 325.000	3,00 %	01.04.2025	327.219	0,00 %
Federal Realty Investment Trust	\$ 300.000	4,50 %	01.12.2044	326.701	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 320.261	3,00 %	01.11.2032	326.466	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 302.710	5,00 %	01.09.2033	326.317	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 305.568	4,50 %	01.08.2030	326.196	0,00 %
Pitney Bowes, Inc.	\$ 350.000	3,63 %	01.10.2021	325.634	0,00 %
Chicago Transit Authority	\$ 250.000	6,20 %	01.12.2040	325.462	0,00 %
Eaton Corp.	\$ 325.000	2,75 %	02.11.2022	325.363	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 303.727	4,50 %	01.11.2039	325.287	0,00 %
Parker-Hannifin Corp.	\$ 300.000	4,20 %	21.11.2034	324.844	0,00 %
Energy Transfer LP	\$ 300.000	6,13 %	15.12.2045	324.645	0,00 %
Morgan Stanley	CAD 400.000	3,13 %	05.08.2021	324.335	0,00 %
Bank of America NA	\$ 250.000	6,00 %	15.10.2036	324.331	0,00 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 300.000	4,80 %	20.05.2045	324.305	0,00 %
AbbVie, Inc.	\$ 325.000	3,20 %	14.05.2026	323.941	0,00 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 350.000	4,13 %	15.08.2046	323.483	0,00 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 300.000	4,45 %	15.04.2042	323.282	0,00 %
Apple, Inc.	£ 200.000	3,60 %	31.07.2042	323.253	0,00 %
AmerisourceBergen Corp.	\$ 325.000	4,25 %	01.03.2045	323.233	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 325.000	3,00 %	13.11.2027	323.222	0,00 %
Citigroup, Inc.	\$ 257.000	6,13 %	25.08.2036	322.606	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 319.722	2,50 %	01.09.2028	322.516	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 313.230	3,50 %	01.10.2044	322.497	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 325.000	2,75 %	13.01.2025	322.422	0,00 %
HSBC Bank USA NA	\$ 250.000	5,88 %	01.11.2034	322.215	0,00 %
Metropolitan Transportation Authority	\$ 250.000	5,87 %	15.11.2039	322.178	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 301.708	4,50 %	01.05.2041	322.126	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 320.340	3,00 %	01.08.2043	321.763	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 321.461	3,00 %	01.09.2046	321.696	0,00 %
DTE Electric Co.	\$ 300.000	4,00 %	01.04.2043	321.656	0,00 %
Oracle Corp.	\$ 325.000	2,40 %	15.09.2023	320.982	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 297.877	5,00 %	01.07.2040	320.831	0,00 %
NiSource Finance Corp.	\$ 300.000	5,45 %	15.09.2020	320.773	0,00 %
ConocoPhillips Co.	\$ 325.000	2,40 %	15.12.2022	320.587	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 308.571	3,50 %	01.10.2034	320.090	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 318.472	3,00 %	01.01.2043	319.888	0,00 %
Prudential Financial, Inc.^	\$ 300.000	5,20 %	15.03.2044	319.875	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 301.665	4,00 %	01.10.2045	319.424	0,00 %
Mead Johnson Nutrition Co.	\$ 300.000	4,13 %	15.11.2025	319.274	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 317.064	3,00 %	01.11.2046	319.112	0,00 %
Illinois Tool Works, Inc.	\$ 300.000	3,90 %	01.09.2042	318.997	0,00 %
Lear Corp.	\$ 300.000	5,25 %	15.01.2025	318.750	0,00 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 300.000	4,80 %	15.07.2046	318.694	0,00 %
Phillips 66	\$ 250.000	5,88 %	01.05.2042	318.652	0,00 %
Dollar General Corp.	\$ 300.000	4,15 %	01.11.2025	318.636	0,00 %
Ingersoll-Rand Global Holding Co., Ltd.	\$ 300.000	4,25 %	15.06.2023	318.493	0,00 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 300.000	4,50 %	25.02.2026	318.369	0,00 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 225.000	6,90 %	15.08.2039	317.863	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 297.578	4,50 %	01.04.2041	317.854	0,00 %
Travelers Cos, Inc.	\$ 300.000	4,00 %	30.05.2047	317.531	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 298.961	4,00 %	01.02.2045	317.379	0,00 %
Wells Fargo & Co.	\$ 300.000	4,40 %	14.06.2046	317.357	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 299.135	4,00 %	01.01.2032	316.943	0,00 %
Amazon.com, Inc.	\$ 300.000	3,80 %	05.12.2024	316.925	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 293.852	4,50 %	01.09.2044	316.780	0,00 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 300.000	4,38 %	15.02.2021	316.622	0,00 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 300.000	4,90 %	15.10.2025	316.155	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 300.000	6,65 %	01.04.2019	316.084	0,00 %
Bay Area Toll Authority	\$ 200.000	7,04 %	01.04.2050	315.964	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 314.147	2,50 %	20.02.2028	315.918	0,00 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 250.000	8,10 %	15.07.2036	315.698	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 314.083	3,00 %	01.01.2043	315.283	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Time Warner, Inc.	\$ 300.000	4,88 %	15.03.2020	315.090	0,00 %
Municipal Electric Authority of Georgia	\$ 250.000	6,66 %	01.04.2057	314.900	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 301.046	4,00 %	01.01.2046	314.854	0,00 %
San Diego Gas & Electric Co.	\$ 300.000	3,75 %	01.06.2047	314.618	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 250.000	5,50 %	15.10.2040	314.597	0,00 %
HCP, Inc.	\$ 300.000	4,20 %	01.03.2024	313.832	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 302.074	3,50 %	20.01.2046	313.301	0,00 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	\$ 300.000	4,50 %	18.11.2034	313.241	0,00 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 200.000	7,75 %	01.12.2045	313.170	0,00 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 250.000	6,13 %	15.10.2039	313.133	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 296.879	4,50 %	20.04.2044	312.997	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 297.161	4,00 %	01.11.2040	312.939	0,00 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 300.000	5,20 %	15.08.2019	312.830	0,00 %
Welltower, Inc.	£ 200.000	4,50 %	01.12.2034	312.591	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 300.000	3,43 %	25.01.2027	312.222	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 300.000	3,85 %	04.05.2043	312.194	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 303.721	3,50 %	01.04.2047	312.112	0,00 %
Marathon Oil Corp.	\$ 250.000	6,60 %	01.10.2037	312.021	0,00 %
Bristol-Myers Squibb Co.	\$ 325.000	3,25 %	01.08.2042	311.999	0,00 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 250.000	6,95 %	15.01.2038	311.836	0,00 %
South Carolina Electric & Gas Co.	\$ 300.000	4,50 %	01.06.2064	311.774	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 288.116	5,00 %	01.07.2035	311.505	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 297.529	4,00 %	01.12.2045	311.501	0,00 %
Amgen, Inc.	£ 200.000	4,00 %	13.09.2029	310.842	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 300.000	3,63 %	15.05.2022	310.291	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 306.057	3,00 %	15.07.2043	310.176	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 290.718	4,50 %	20.03.2041	310.062	0,00 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	\$ 250.000	5,25 %	30.09.2040	309.494	0,00 %
Target Corp.	\$ 305.000	2,90 %	15.01.2022	309.479	0,00 %
Metropolitan Transportation Authority	\$ 200.000	7,34 %	15.11.2039	309.478	0,00 %
Home Depot, Inc.	\$ 300.000	3,35 %	15.09.2025	309.155	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 302.844	3,00 %	01.12.2030	308.687	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 288.355	4,50 %	01.02.2040	308.548	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 303.366	3,00 %	01.12.2035	308.505	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 298.805	3,50 %	01.07.2045	308.382	0,00 %
Georgia-Pacific LLC	\$ 200.000	8,88 %	15.05.2031	308.229	0,00 %
Invesco Finance plc	\$ 250.000	5,38 %	30.11.2043	308.200	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 304.157	3,00 %	20.02.2045	307.965	0,00 %
3M Co.	\$ 300.000	3,63 %	15.10.2047	307.724	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 300.000	3,38 %	15.08.2025	307.717	0,00 %
Marathon Petroleum Corp.	\$ 300.000	4,75 %	15.09.2044	307.568	0,00 %
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 250.000	6,45 %	15.09.2036	307.452	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 280.978	5,50 %	01.06.2035	307.355	0,00 %
Wells Fargo & Co.	\$ 300.000	3,55 %	29.09.2025	307.252	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 311.303	2,50 %	01.02.2033	307.141	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 297.954	3,76 %	25.04.2021	306.976	0,00 %
ONEOK Partners LP	\$ 250.000	6,65 %	01.10.2036	306.946	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.^	\$ 300.000	3,88 %	24.07.2038	306.904	0,00 %
Pfizer, Inc.	\$ 200.000	7,20 %	15.03.2039	306.757	0,00 %
Union Pacific Corp.	\$ 300.000	3,25 %	15.01.2025	306.550	0,00 %
Bank 2018-BNK [®]	\$ 300.000	3,75 %	15.09.2060	306.495	0,00 %
Aetna, Inc.	\$ 225.000	6,75 %	15.12.2037	306.335	0,00 %
Swiss Re America Holding Corp.	\$ 250.000	7,00 %	15.02.2026	305.912	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 292.402	4,00 %	01.01.2046	305.842	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 278.863	5,50 %	01.06.2041	305.742	0,00 %
Bank 2018-BNK [®]	\$ 300.000	3,39 %	15.06.2060	305.634	0,00 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 300.000	3,12 %	15.04.2022	305.609	0,00 %
Fifth Third Bancorp	\$ 200.000	8,25 %	01.03.2038	305.592	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 286.038	4,50 %	01.05.2041	305.325	0,00 %
NBCUniversal Media LLC	\$ 225.000	6,40 %	30.04.2040	305.313	0,00 %
Seagate HDD Cayman	\$ 300.000	4,75 %	01.06.2023	305.250	0,00 %
DBJPM 17-C6 Mortgage Trust	\$ 300.000	3,33 %	10.06.2050	305.244	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 291.000	4,00 %	15.10.2041	305.216	0,00 %
American Tower Corp.	\$ 300.000	3,30 %	15.02.2021	305.118	0,00 %
Laboratory Corp. of America Holdings	\$ 300.000	3,60 %	01.02.2025	304.980	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 304.296	2,50 %	01.10.2031	304.817	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
ONEOK, Inc.	\$ 300.000	4,00 %	13.07.2027	304.649	0,00 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 300.000	3,04 %	01.03.2026	304.619	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 290.571	4,00 %	01.03.2042	304.548	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 287.531	4,00 %	01.03.2044	304.486	0,00 %
General Motors Co.	\$ 250.000	6,60 %	01.04.2036	304.430	0,00 %
Sherwin-Williams Co.	\$ 300.000	3,45 %	01.06.2027	304.230	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 296.032	3,50 %	01.08.2046	304.186	0,00 %
MetLife, Inc.	\$ 262.000	4,72 %	15.12.2044	303.890	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 225.000	6,50 %	15.11.2035	303.852	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 301.913	3,00 %	01.09.2042	303.536	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 300.000	3,20 %	11.05.2027	303.523	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 303.129	3,00 %	01.01.2043	303.350	0,00 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	\$ 300.000	3,15 %	15.01.2023	303.000	0,00 %
Intercontinental Exchange, Inc.	\$ 300.000	2,75 %	01.12.2020	302.865	0,00 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 300.000	3,20 %	06.07.2021	302.860	0,00 %
Magellan Midstream Partners LP	\$ 300.000	4,20 %	03.10.2047	302.829	0,00 %
Newell Brands Inc.	\$ 300.000	2,88 %	01.12.2019	302.738	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 294.204	3,50 %	01.07.2043	302.646	0,00 %
Fiserv, Inc.	\$ 300.000	2,70 %	01.06.2020	301.960	0,00 %
Berkshire Hathaway, Inc.	\$ 300.000	2,75 %	15.03.2023	301.955	0,00 %
Starbucks Corp.	\$ 300.000	2,70 %	15.06.2022	301.946	0,00 %
Wyeth LLC	\$ 225.000	5,95 %	01.04.2037	301.946	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 295.292	3,00 %	20.12.2029	301.749	0,00 %
Charles Schwab Corp.	\$ 300.000	3,20 %	02.03.2027	301.518	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 292.311	3,50 %	01.01.2044	301.504	0,00 %
John Deere Capital Corp.	\$ 300.000	2,55 %	08.01.2021	301.260	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 300.000	2,97 %	15.01.2023	301.245	0,00 %
Kraft Heinz Foods Co.	£ 200.000	4,13 %	01.07.2027	301.240	0,00 %
QVC, Inc.	\$ 300.000	5,45 %	15.08.2034	301.180	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 300.000	3,13 %	01.05.2025	301.176	0,00 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	\$ 300.000	3,65 %	01.06.2022	301.100	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 296.042	3,00 %	01.09.2035	301.055	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 274.277	5,50 %	01.12.2032	300.888	0,00 %
AbbVie, Inc.	\$ 300.000	2,90 %	06.11.2022	300.874	0,00 %
Maxim Integrated Products, Inc.	\$ 300.000	3,45 %	15.06.2027	300.851	0,00 %
HCP, Inc.	\$ 300.000	2,63 %	01.02.2020	300.818	0,00 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 300.000	2,96 %	25.02.2027	300.711	0,00 %
Kimberly-Clark Corp.	\$ 300.000	3,05 %	15.08.2025	300.512	0,00 %
JM Smucker Co.	\$ 300.000	2,50 %	15.03.2020	300.449	0,00 %
Eastman Chemical Co.	\$ 292.000	3,60 %	15.08.2022	300.197	0,00 %
Microsoft Corp.	\$ 300.000	2,40 %	06.02.2022	299.942	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 291.856	3,50 %	01.08.2047	299.925	0,00 %
Ventas Realty LP	\$ 300.000	3,10 %	15.01.2023	299.791	0,00 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 300.000	2,22 %	01.03.2021	299.443	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 297.524	3,00 %	01.01.2043	299.434	0,00 %
VMware, Inc.	\$ 300.000	2,95 %	21.08.2022	299.418	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 284.385	4,00 %	01.12.2040	299.416	0,00 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	\$ 300.000	1,74 %	19.01.2021	299.399	0,00 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 300.000	2,13 %	06.06.2019	299.370	0,00 %
Chubb INA Holdings, Inc.	\$ 300.000	2,30 %	03.11.2020	299.350	0,00 %
Wachovia Corp.	\$ 250.000	5,50 %	01.08.2035	299.288	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 300.000	1,70 %	22.02.2019	299.216	0,00 %
Apple, Inc.	£ 200.000	3,05 %	31.07.2029	299.186	0,00 %
SunTrust Banks, Inc.	\$ 300.000	2,70 %	27.01.2022	299.170	0,00 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 300.000	2,35 %	15.10.2019	299.043	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 298.069	3,00 %	01.12.2042	299.025	0,00 %
Federal National Mortgage Corp.^	\$ 300.000	2,79 %	25.05.2025	298.974	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 300.000	1,70 %	15.02.2019	298.966	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 300.000	2,98 %	03.08.2022	298.936	0,00 %
Chevron Corp.	\$ 300.000	1,96 %	03.03.2020	298.809	0,00 %
City of San Francisco CA Public Utilities Commission Water Revenue	\$ 200.000	6,95 %	01.11.2050	298.760	0,00 %
Synchrony Financial	\$ 300.000	3,95 %	01.12.2027	298.666	0,00 %
Exelon Corp.	\$ 275.000	4,45 %	15.04.2046	298.589	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 300.000	3,12 %	25.10.2031	298.342	0,00 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 300.000	2,63 %	17.01.2023	298.319	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Arrow Electronics, Inc.	\$ 300.000	3,88 %	12.01.2028	298.285	0,00 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 300.000	2,40 %	05.06.2020	298.284	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 296.175	3,00 %	01.09.2042	298.269	0,00 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 300.000	1,99 %	17.07.2023	298.131	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 300.000	2,70 %	18.05.2023	298.031	0,00 %
General Mills, Inc.	\$ 300.000	2,60 %	12.10.2022	297.798	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 271.203	5,50 %	01.11.2034	297.759	0,00 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	\$ 300.000	3,15 %	01.04.2022	297.580	0,00 %
KLA-Tencor Corp.	\$ 275.000	4,65 %	01.11.2024	297.441	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 266.072	6,00 %	01.12.2032	297.421	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 285.814	3,50 %	01.02.2026	297.283	0,00 %
Edison International	\$ 300.000	2,13 %	15.04.2020	297.257	0,00 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	\$ 300.000	3,20 %	15.08.2027	297.185	0,00 %
Mylan NV	\$ 275.000	5,25 %	15.06.2046	297.060	0,00 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 300.000	2,93 %	15.01.2025	297.056	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 300.000	2,67 %	25.03.2026	296.907	0,00 %
Amazon.com, Inc.	\$ 300.000	2,40 %	22.02.2023	296.776	0,00 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 300.000	2,78 %	25.02.2027	296.766	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 277.666	4,50 %	01.05.2041	296.736	0,00 %
Duke Energy Corp.	\$ 300.000	3,75 %	01.09.2046	296.672	0,00 %
Flowserve Corp.	€ 250.000	1,25 %	17.03.2022	296.569	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 288.246	3,50 %	01.01.2043	296.341	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 300.000	2,53 %	25.09.2024	296.271	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 283.206	4,00 %	01.01.2047	296.218	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 276.448	4,50 %	01.10.2039	296.067	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 300.000	2,98 %	25.08.2029	296.004	0,00 %
Discover Bank	\$ 300.000	3,45 %	27.07.2026	295.952	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 276.216	4,50 %	01.02.2047	295.028	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 293.396	3,00 %	01.10.2042	294.973	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 275.000	4,30 %	27.01.2045	294.949	0,00 %
United Airlines 2014-2 Klasse A Pass Through Trust	\$ 287.722	3,75 %	03.09.2026	294.938	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 278.565	4,00 %	01.06.2042	294.869	0,00 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	€ 242.000	2,88 %	24.07.2037	294.766	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 288.000	3,13 %	15.07.2022	294.491	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 273.930	5,00 %	01.07.2041	294.321	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 283.191	3,50 %	15.03.2042	294.315	0,00 %
United Airlines 2016-2 Klasse AA Pass Through Trust	\$ 300.000	2,88 %	07.10.2028	294.141	0,00 %
Waste Management, Inc.	\$ 300.000	2,40 %	15.05.2023	294.132	0,00 %
XLIT Ltd.	\$ 280.000	5,50 %	31.03.2045	294.073	0,00 %
Devon Energy Corp.	\$ 250.000	5,60 %	15.07.2041	293.972	0,00 %
CenterPoint Energy Houston Electric LLC	\$ 300.000	1,85 %	01.06.2021	293.807	0,00 %
Federal Home Loan Banks	\$ 300.000	1,38 %	18.02.2021	293.724	0,00 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 250.000	5,25 %	01.08.2033	293.487	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 290.478	2,50 %	01.09.2027	293.239	0,00 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 275.000	4,05 %	03.05.2047	292.986	0,00 %
Southern California Edison Co.	\$ 250.000	4,65 %	01.10.2043	292.701	0,00 %
Reynolds American, Inc.	\$ 275.000	4,45 %	12.06.2025	292.640	0,00 %
Metropolitan Water Reclamation District of Greater Chicago	\$ 225.000	5,72 %	01.12.2038	292.567	0,00 %
Bank of America Corp.	£ 150.000	7,00 %	31.07.2028	292.493	0,00 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 300.000	3,75 %	15.07.2042	292.294	0,00 %
CBS Corp.	\$ 300.000	2,50 %	15.02.2023	292.165	0,00 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 300.000	1,70 %	09.08.2021	291.939	0,00 %
Massachusetts Institute of Technology	\$ 250.000	4,68 %	01.07.2114	291.889	0,00 %
Honeywell International, Inc.	€ 240.000	0,65 %	21.02.2020	291.868	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 285.137	3,00 %	01.03.2027	291.861	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 273.124	4,50 %	01.08.2041	291.605	0,00 %
Exelon Generation Co. LLC	\$ 250.000	6,25 %	01.10.2039	290.983	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 277.243	4,00 %	20.03.2042	290.561	0,00 %
Baxalta, Inc.	\$ 250.000	5,25 %	23.06.2045	290.125	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 280.997	3,50 %	01.03.2045	290.073	0,00 %
SC Johnson & Son, Inc.	\$ 250.000	4,75 %	15.10.2046	289.708	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017^	\$ 286.000	3,67 %	15.07.2050	289.626	0,00 %
JM Smucker Co.	\$ 275.000	4,25 %	15.03.2035	289.307	0,00 %
City of Chicago II	\$ 250.000	7,38 %	01.01.2033	289.245	0,00 %
Verisk Analytics, Inc.	\$ 250.000	5,50 %	15.06.2045	289.010	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 274.763	4,00 %	20.08.2040	288.705	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 272.268	4,00 %	01.10.2031	288.345	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 270.865	4,50 %	01.04.2046	288.148	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 280.271	3,50 %	01.05.2047	288.008	0,00 %
O'Reilly Automotive, Inc.	\$ 275.000	3,85 %	15.06.2023	287.730	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 287.256	3,00 %	01.11.2046	287.508	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 200.000	7,13 %	15.01.2030	287.243	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 275.000	3,87 %	25.04.2021	287.133	0,00 %
Archer-Daniels-Midland Co.	\$ 300.000	2,50 %	11.08.2026	286.393	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 258.000	4,56 %	15.06.2048	286.172	0,00 %
CSX Corp.	\$ 275.000	4,10 %	15.03.2044	286.120	0,00 %
FMR LLC	\$ 250.000	4,95 %	01.02.2033	286.053	0,00 %
Celgene Corp.	\$ 275.000	4,35 %	15.11.2047	285.614	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 276.551	3,50 %	01.01.2045	285.395	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 285.181	3,15 %	25.02.2018	285.132	0,00 %
Metropolitan Life Global Funding I	£ 200.000	2,63 %	05.12.2022	284.994	0,00 %
3M Co.	\$ 300.000	2,25 %	19.09.2026	284.534	0,00 %
International Business Machines Corp.	\$ 275.000	3,45 %	19.02.2026	284.173	0,00 %
Oracle Corp.	\$ 250.000	4,50 %	08.07.2044	283.890	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 274.586	3,50 %	01.03.2042	283.816	0,00 %
BlackRock, Inc.	\$ 275.000	3,38 %	01.06.2022	283.769	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 271.070	4,00 %	01.10.2046	283.515	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 270.107	4,00 %	01.02.2042	283.034	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 275.000	3,75 %	13.11.2047	282.746	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 270.344	4,00 %	15.06.2046	282.658	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 266.952	4,00 %	01.01.2047	282.603	0,00 %
San Diego County Water Authority Financing Corp.	\$ 200.000	6,14 %	01.05.2049	282.542	0,00 %
Ford Holdings LLC	\$ 200.000	9,30 %	01.03.2030	282.519	0,00 %
CGMS Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 275.000	3,46 %	15.08.2050	282.353	0,00 %
Entergy Louisiana LLC	\$ 300.000	2,40 %	01.10.2026	282.154	0,00 %
Nordstrom, Inc.	\$ 250.000	6,95 %	15.03.2028	282.061	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 286.742	2,50 %	01.03.2037	281.612	0,00 %
AT&T, Inc.	\$ 275.000	3,80 %	01.03.2024	281.298	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 256.266	5,50 %	01.04.2034	281.295	0,00 %
FirstEnergy Corp.	\$ 275.000	3,90 %	15.07.2027	281.281	0,00 %
Bank 2018-BNK [®]	\$ 275.000	3,44 %	15.09.2060	281.146	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 280.884	3,00 %	01.12.2046	281.090	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 260.368	5,00 %	01.03.2036	280.918	0,00 %
Pacific LifeCorp	\$ 250.000	5,13 %	30.01.2043	280.905	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 270.849	3,50 %	15.03.2045	280.719	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 273.086	3,50 %	01.11.2047	280.692	0,00 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates [^]	\$ 275.000	3,19 %	25.09.2027	280.508	0,00 %
Massachusetts Institute of Technology	\$ 200.000	5,60 %	01.07.2111	280.456	0,00 %
Home Depot, Inc.	\$ 300.000	2,13 %	15.09.2026	280.366	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 280.056	3,00 %	01.11.2046	280.306	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 274.903	3,00 %	01.11.2026	280.116	0,00 %
Port Authority of New York & New Jersey	\$ 250.000	5,31 %	01.08.2046	280.005	0,00 %
Kroger Co.	\$ 300.000	2,65 %	15.10.2026	279.674	0,00 %
Southern Power Co.	\$ 250.000	5,15 %	15.09.2041	279.628	0,00 %
Baker Hughes a GE Co. LLC/Baker Hughes Co.-Obligor, Inc.	\$ 275.000	4,08 %	15.12.2047	279.558	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 261.633	4,50 %	01.06.2041	279.558	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 261.361	5,00 %	20.04.2038	279.481	0,00 %
Harris Corp.	\$ 250.000	4,85 %	27.04.2035	279.033	0,00 %
Trustees of the University of Pennsylvania	\$ 250.000	4,67 %	01.09.2112	278.700	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 270.520	3,50 %	01.10.2044	278.525	0,00 %
Magellan Midstream Partners LP	\$ 250.000	5,00 %	01.03.2026	278.015	0,00 %
State of Illinois	\$ 250.000	6,63 %	01.02.2035	277.430	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 259.454	4,50 %	01.09.2043	277.137	0,00 %
Agilent Technologies, Inc.	\$ 275.000	3,20 %	01.10.2022	276.987	0,00 %
Conagra Brands, Inc.	\$ 200.000	8,25 %	15.09.2030	276.803	0,00 %
New York City Water & Sewer System	\$ 200.000	5,88 %	15.06.2044	276.682	0,00 %
Los Angeles Unified School District	\$ 200.000	6,76 %	01.07.2034	276.224	0,00 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 275.000	3,36 %	06.06.2024	275.920	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 275.000	2,55 %	29.10.2020	275.802	0,00 %
PepsiCo, Inc.	\$ 275.000	2,25 %	07.01.2019	275.731	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 275.458	3,00 %	01.02.2043	275.703	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 260.209	4,50 %	15.05.2040	275.633	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeitsdatum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Florida Power & Light Co.	\$ 250.000	4,13 %	01.02.2042	275.545	0,00 %
Oracle Corp.	\$ 275.000	2,63 %	15.02.2023	275.373	0,00 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 272.978	2,68 %	25.05.2021	275.225	0,00 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 275.000	2,75 %	15.01.2022	275.158	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 259.655	4,00 %	01.01.2042	274.977	0,00 %
Baker Hughes a GE Co. LLC/Baker Hughes Co.-Obligor, Inc.	\$ 275.000	2,77 %	15.12.2022	274.606	0,00 %
Crown Castle International Corp.	\$ 275.000	3,70 %	15.06.2026	274.512	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 265.529	3,50 %	01.08.2046	274.503	0,00 %
Baker Hughes a GE Co. LLC/Baker Hughes Co.-Obligor, Inc.	\$ 275.000	3,34 %	15.12.2027	274.382	0,00 %
Iraq Government AID Bond	\$ 275.000	2,15 %	18.01.2022	274.093	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 260.389	4,50 %	15.04.2040	274.080	0,00 %
American Express Credit Account Master Trust	\$ 275.000	2,35 %	15.05.2025	274.038	0,00 %
American Express Credit Corp.	\$ 275.000	1,88 %	03.05.2019	273.997	0,00 %
CVS Health Corp.	\$ 266.000	3,88 %	20.07.2025	273.908	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 261.776	4,00 %	01.09.2045	273.756	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 275.000	1,90 %	07.02.2020	273.715	0,00 %
Exelon Generation Co. LLC	\$ 250.000	5,60 %	15.06.2042	273.499	0,00 %
Capital One Financial Corp.	\$ 275.000	3,30 %	30.10.2024	273.426	0,00 %
Intel Corp.	\$ 250.000	4,10 %	19.05.2046	273.118	0,00 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 275.000	2,10 %	04.10.2019	273.012	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 265.336	3,50 %	01.12.2042	272.791	0,00 %
Time Warner Cable LLC	\$ 250.000	5,88 %	15.11.2040	272.726	0,00 %
Duke Energy Corp.	\$ 275.000	3,15 %	15.08.2027	272.638	0,00 %
Wells Fargo & Co.	\$ 250.000	4,65 %	04.11.2044	272.442	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 248.223	5,50 %	01.11.2039	272.231	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 270.000	3,18 %	15.04.2050	271.669	0,00 %
American International Group, Inc.	\$ 250.000	4,88 %	01.06.2022	271.437	0,00 %
LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2008^	\$ 270.762	6,32 %	15.04.2041	271.187	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 257.397	4,00 %	01.02.2041	271.108	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 269.984	3,00 %	01.02.2043	271.055	0,00 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	\$ 275.000	3,40 %	15.11.2026	270.962	0,00 %
George Washington University	\$ 250.000	4,30 %	15.09.2044	270.677	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 254.387	4,50 %	01.01.2045	270.669	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 261.990	3,50 %	01.05.2042	270.389	0,00 %
AT&T, Inc.	\$ 250.000	5,55 %	15.08.2041	270.236	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 261.075	3,50 %	01.07.2042	269.843	0,00 %
Fidelity National Information Services, Inc.	\$ 264.000	3,50 %	15.04.2023	269.687	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 255.935	4,00 %	01.01.2041	269.448	0,00 %
Valero Energy Corp.	\$ 200.000	7,50 %	15.04.2032	268.671	0,00 %
Georgia Power Co.	\$ 250.000	4,30 %	15.03.2042	268.263	0,00 %
Waste Management, Inc.	\$ 250.000	4,10 %	01.03.2045	267.757	0,00 %
PacifiCorp	\$ 200.000	6,00 %	15.01.2039	267.749	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013	\$ 250.000	4,20 %	15.01.2047	267.690	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 259.008	3,50 %	01.07.2044	267.314	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 251.067	4,50 %	01.06.2031	267.111	0,00 %
Target Corp.	\$ 275.000	3,63 %	15.04.2046	267.007	0,00 %
FedEx Corp.	\$ 250.000	4,40 %	15.01.2047	266.936	0,00 %
Time Warner Cable LLC	\$ 250.000	8,75 %	14.02.2019	266.924	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 259.680	3,50 %	01.05.2042	266.817	0,00 %
Duke Energy Carolinas LLC	\$ 250.000	4,00 %	30.09.2042	266.542	0,00 %
Apache Corp.	\$ 275.000	4,25 %	15.01.2044	266.523	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 256.827	3,50 %	01.01.2035	266.355	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 270.321	2,00 %	01.01.2029	265.983	0,00 %
Commonwealth Edison Co.	\$ 275.000	2,55 %	15.06.2026	265.932	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 225.000	4,75 %	15.07.2045	265.874	0,00 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 250.000	4,00 %	15.11.2046	265.815	0,00 %
McDonald's Corp.	\$ 200.000	6,30 %	01.03.2038	265.774	0,00 %
Kinder Morgan, Inc.	\$ 250.000	5,30 %	01.12.2034	265.437	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 250.000	4,25 %	01.10.2027	265.051	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 241.827	5,00 %	20.02.2040	264.796	0,00 %
Commonwealth Edison Co.	\$ 225.000	4,70 %	15.01.2044	264.743	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 252.385	4,00 %	20.12.2041	264.498	0,00 %
Westar Energy, Inc.	\$ 275.000	2,55 %	01.07.2026	264.490	0,00 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 200.000	6,15 %	01.09.2036	264.198	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 270.514	2,50 %	20.09.2046	263.938	0,00 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 250.000	3,88 %	15.09.2023	263.457	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
American International Group, Inc.	\$ 250.000	4,13 %	15.02.2024	263.252	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 250.000	3,75 %	15.07.2025	263.067	0,00 %
Discover Bank	\$ 250.000	4,20 %	08.08.2023	262.946	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 245.896	4,50 %	01.01.2042	262.757	0,00 %
Ascension Health	\$ 250.000	3,95 %	15.11.2046	262.453	0,00 %
Waste Management, Inc.	\$ 250.000	3,90 %	01.03.2035	262.356	0,00 %
Schlumberger Investment SA	\$ 250.000	3,65 %	01.12.2023	262.333	0,00 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 250.000	4,05 %	15.02.2022	262.118	0,00 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 250.000	3,65 %	01.09.2025	262.011	0,00 %
Discovery Communications LLC	\$ 250.000	5,20 %	20.09.2047	261.907	0,00 %
Aon Corp.	\$ 200.000	8,21 %	01.01.2027	261.750	0,00 %
Dow Chemical Co.	\$ 250.000	4,38 %	15.11.2042	261.694	0,00 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 225.000	4,65 %	15.08.2043	261.663	0,00 %
VF Corp.	\$ 200.000	6,45 %	01.11.2037	261.634	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 249.709	4,00 %	20.09.2045	261.546	0,00 %
JPMBDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017	\$ 250.000	3,69 %	15.03.2050	261.437	0,00 %
Johnson Controls International plc	\$ 250.000	3,90 %	14.02.2026	261.421	0,00 %
MetLife, Inc.	\$ 250.000	4,05 %	01.03.2045	261.249	0,00 %
Kite Realty Group LP	\$ 275.000	4,00 %	01.10.2026	261.226	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 252.522	4,00 %	01.07.2025	261.146	0,00 %
PPL Capital Funding, Inc.	\$ 250.000	3,95 %	15.03.2024	261.112	0,00 %
Johnson & Johnson	\$ 250.000	3,38 %	05.12.2023	261.062	0,00 %
International Business Machines Corp.	\$ 250.000	3,63 %	12.02.2024	261.008	0,00 %
NIKE, Inc.	\$ 250.000	3,88 %	01.11.2045	260.968	0,00 %
Branch Banking & Trust Co.	\$ 250.000	3,80 %	30.10.2026	260.880	0,00 %
Citigroup, Inc.	\$ 200.000	5,88 %	30.01.2042	260.740	0,00 %
Digital Realty Trust LP	\$ 250.000	3,95 %	01.07.2022	260.722	0,00 %
Time Warner Cable LLC	\$ 250.000	5,00 %	01.02.2020	260.718	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013	\$ 250.000	3,66 %	15.07.2045	260.695	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 248.541	4,00 %	01.12.2042	260.575	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 246.496	4,50 %	15.03.2041	260.391	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 243.167	4,50 %	01.06.2040	260.209	0,00 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 250.000	4,30 %	13.07.2025	260.201	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 251.576	3,50 %	01.12.2041	260.045	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 258.283	3,00 %	01.09.2043	259.948	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 250.000	3,30 %	25.07.2024	259.945	0,00 %
Packaging Corp. of America	\$ 250.000	3,90 %	15.06.2022	259.784	0,00 %
Celgene Corp.	\$ 225.000	5,25 %	15.08.2043	259.758	0,00 %
CRH America, Inc.	\$ 250.000	3,88 %	18.05.2025	259.593	0,00 %
Deere & Co.	\$ 250.000	4,38 %	16.10.2019	259.452	0,00 %
Honeywell International, Inc.	\$ 200.000	5,70 %	15.03.2036	259.379	0,00 %
American International Group, Inc.	\$ 250.000	3,90 %	01.04.2026	259.317	0,00 %
Buckeye Partners LP	\$ 250.000	4,15 %	01.07.2023	259.011	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 244.426	4,00 %	01.12.2031	258.973	0,00 %
Verisk Analytics, Inc.	\$ 250.000	4,00 %	15.06.2025	258.888	0,00 %
Mosaic Co.	\$ 250.000	4,25 %	15.11.2023	258.855	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 251.910	3,50 %	01.08.2045	258.842	0,00 %
SC Johnson & Son, Inc.	\$ 250.000	4,00 %	15.05.2043	258.758	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 250.000	3,32 %	25.02.2023	258.690	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 250.000	3,25 %	25.04.2023	258.552	0,00 %
Bank of America Corp.	\$ 250.000	3,95 %	21.04.2025	258.413	0,00 %
Occidental Petroleum Corp.	\$ 250.000	3,50 %	15.06.2025	258.212	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 241.075	4,50 %	01.05.2039	258.193	0,00 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 250.000	3,95 %	15.07.2025	258.153	0,00 %
Discovery Communications LLC	\$ 250.000	5,00 %	20.09.2037	258.128	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 275.000	3,40 %	15.07.2046	258.075	0,00 %
AT&T, Inc.	\$ 250.000	5,15 %	15.03.2042	257.929	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 256.749	3,00 %	01.12.2042	257.892	0,00 %
Tyco Electronics Group SA	\$ 250.000	3,70 %	15.02.2026	257.883	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 250.403	3,50 %	01.01.2045	257.787	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 241.194	4,50 %	20.11.2039	257.761	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014	\$ 250.000	3,53 %	15.12.2047	257.623	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 245.935	4,00 %	20.11.2044	257.423	0,00 %
El du Pont de Nemours & Co.	\$ 250.000	4,15 %	15.02.2043	257.355	0,00 %
Illinois Tool Works, Inc.	€ 200.000	2,13 %	22.05.2030	257.300	0,00 %
LyondellBasell Industries NV	\$ 250.000	4,63 %	26.02.2055	257.266	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Macy's Retail Holdings, Inc.	\$ 275.000	2,88 %	15.02.2023	257.109	0,00 %
Florida Power & Light Co.	\$ 250.000	3,25 %	01.06.2024	256.935	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 244.052	4,00 %	01.03.2042	256.725	0,00 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 250.000	4,00 %	15.01.2025	256.718	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 246.705	3,50 %	01.11.2025	256.603	0,00 %
Target Corp.	\$ 250.000	4,00 %	01.07.2042	256.586	0,00 %
American Water Capital Corp.	\$ 250.000	3,75 %	01.09.2047	256.553	0,00 %
CSAIL 2017-CX9 Commercial Mortgage Trust	\$ 250.000	3,45 %	15.09.2050	256.427	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 247.959	3,50 %	01.12.2041	256.302	0,00 %
Adobe Systems, Inc.	\$ 250.000	3,25 %	01.02.2025	256.293	0,00 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 250.000	3,70 %	24.11.2020	256.070	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 236.795	5,00 %	01.06.2035	256.000	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 237.293	5,00 %	01.12.2039	255.719	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 250.000	3,47 %	15.11.2050	255.715	0,00 %
Parker-Hannifin Corp.	\$ 250.000	3,30 %	21.11.2024	255.497	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 238.735	4,50 %	01.06.2039	255.259	0,00 %
Nationwide Mutual Insurance Co.	\$ 150.000	9,38 %	15.08.2039	255.120	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 226.639	6,00 %	01.03.2034	255.054	0,00 %
Bank of New York Mellon Corp. ^	\$ 250.000	3,44 %	07.02.2028	255.044	0,00 %
Commonwealth of Massachusetts	\$ 200.000	5,46 %	01.12.2039	254.826	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 200.000	6,13 %	15.02.2033	254.815	0,00 %
Marathon Petroleum Corp.	\$ 250.000	3,63 %	15.09.2024	254.772	0,00 %
Brighthouse Financial Inc.	\$ 250.000	4,70 %	22.06.2047	254.691	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 242.636	4,00 %	01.08.2043	254.669	0,00 %
Leggett & Platt, Inc.	\$ 250.000	3,80 %	15.11.2024	254.467	0,00 %
Williams Partners LP	\$ 250.000	3,60 %	15.03.2022	254.438	0,00 %
United Parcel Service, Inc.	€ 200.000	1,63 %	15.11.2025	254.223	0,00 %
Anthem, Inc.	\$ 250.000	3,50 %	15.08.2024	254.218	0,00 %
BorgWarner, Inc.	€ 200.000	1,80 %	07.11.2022	254.199	0,00 %
VMware, Inc.	\$ 250.000	3,90 %	21.08.2027	254.125	0,00 %
KeyBank NA	\$ 250.000	3,30 %	01.06.2025	253.873	0,00 %
Coca-Cola Co.	€ 197.000	1,88 %	22.09.2026	253.867	0,00 %
PNC Bank NA	\$ 250.000	3,25 %	01.06.2025	253.846	0,00 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	€ 200.000	2,00 %	15.04.2025	253.701	0,00 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 230.000	5,20 %	15.07.2045	253.573	0,00 %
Kraft Heinz Foods Co.	€ 200.000	2,00 %	30.06.2023	253.530	0,00 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	€ 200.000	2,25 %	20.07.2020	253.462	0,00 %
Citigroup, Inc. ^	\$ 250.000	3,67 %	24.07.2028	253.090	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 239.694	4,00 %	01.02.2042	253.082	0,00 %
Atmos Energy Corp.	\$ 200.000	5,50 %	15.06.2041	253.047	0,00 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 250.000	4,00 %	17.01.2043	253.018	0,00 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 250.000	3,00 %	01.11.2021	252.935	0,00 %
Western Digital Corp.	\$ 235.000	7,38 %	01.04.2023	252.919	0,00 %
Andeavor	\$ 250.000	4,50 %	01.04.2048	252.755	0,00 %
University of California	\$ 250.000	3,06 %	01.07.2025	252.723	0,00 %
Duke Energy Florida LLC	\$ 250.000	3,20 %	15.01.2027	252.654	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 230.302	5,50 %	01.02.2033	252.607	0,00 %
Carlisle Cos, Inc.	\$ 250.000	3,75 %	01.12.2027	252.582	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 244.662	3,50 %	01.03.2042	252.565	0,00 %
Chubb INA Holdings, Inc.	\$ 250.000	3,15 %	15.03.2025	252.333	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	€ 200.000	1,50 %	26.10.2022	252.138	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 250.000	2,80 %	16.06.2020	251.897	0,00 %
Wells Fargo & Co.	\$ 250.000	3,07 %	24.01.2023	251.774	0,00 %
Intel Corp.	\$ 250.000	2,45 %	29.07.2020	251.684	0,00 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 250.000	3,10 %	15.01.2019	251.586	0,00 %
Home Depot, Inc.	\$ 250.000	2,63 %	01.06.2022	251.246	0,00 %
Kinder Morgan, Inc.	\$ 250.000	3,05 %	01.12.2019	251.091	0,00 %
Republic Services, Inc.	\$ 250.000	3,20 %	15.03.2025	251.042	0,00 %
Timken Co.	\$ 250.000	3,88 %	01.09.2024	251.019	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 250.429	3,00 %	01.10.2045	251.001	0,00 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 250.000	3,10 %	03.05.2027	250.912	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 234.911	4,50 %	01.05.2041	250.912	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 246.409	3,00 %	01.08.2033	250.880	0,00 %
Laboratory Corp. of America Holdings	\$ 250.000	2,50 %	01.11.2018	250.827	0,00 %
Stryker Corp.	\$ 250.000	2,63 %	15.03.2021	250.609	0,00 %
Mosaic Co.	\$ 250.000	4,05 %	15.11.2027	250.505	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Exelon Corp.	\$ 250.000	3,40 %	15.04.2026	250.449	0,00 %
Bank of America Corp.	€ 200.000	1,38 %	10.09.2021	250.446	0,00 %
Precision Castparts Corp.	\$ 250.000	2,25 %	15.06.2020	250.420	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 238.943	4,00 %	01.09.2044	250.400	0,00 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 250.000	2,25 %	01.12.2019	250.310	0,00 %
JM Smucker Co.	\$ 250.000	3,38 %	15.12.2027	250.216	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 243.542	3,50 %	01.11.2046	250.207	0,00 %
PNC Bank NA	\$ 250.000	2,45 %	05.11.2020	250.204	0,00 %
Ingersoll-Rand Luxembourg Finance SA	\$ 250.000	2,63 %	01.05.2020	250.119	0,00 %
UDR, Inc.	\$ 250.000	3,50 %	01.07.2027	250.111	0,00 %
Costco Wholesale Corp.	\$ 250.000	3,00 %	18.05.2027	250.107	0,00 %
Laboratory Corp. of America Holdings	\$ 250.000	3,60 %	01.09.2027	250.103	0,00 %
PepsiCo, Inc.	\$ 250.000	2,75 %	30.04.2025	250.086	0,00 %
Huntington National Bank	\$ 250.000	2,38 %	10.03.2020	250.028	0,00 %
Goldman Sachs Capital I	\$ 200.000	6,35 %	15.02.2034	250.000	0,00 %
PPG Industries, Inc.	\$ 250.000	2,30 %	15.11.2019	249.938	0,00 %
Intercontinental Exchange, Inc.	\$ 250.000	3,10 %	15.09.2027	249.897	0,00 %
Laboratory Corp. of America Holdings	\$ 250.000	3,25 %	01.09.2024	249.777	0,00 %
AIG Global Funding	\$ 250.000	2,70 %	15.12.2021	249.768	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	€ 200.000	1,50 %	27.01.2025	249.725	0,00 %
Coca-Cola Co.	€ 200.000	1,13 %	22.09.2022	249.619	0,00 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	\$ 250.000	2,70 %	15.02.2023	249.585	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 250.000	1,75 %	20.06.2019	249.520	0,00 %
PNC Financial Services Group, Inc.	\$ 250.000	3,15 %	19.05.2027	249.502	0,00 %
Sysco Corp.	\$ 250.000	3,25 %	15.07.2027	249.500	0,00 %
Costco Wholesale Corp.	\$ 250.000	2,75 %	18.05.2024	249.496	0,00 %
Citigroup, Inc.	\$ 250.000	2,40 %	18.02.2020	249.488	0,00 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	\$ 250.000	2,35 %	06.03.2020	249.475	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 250.000	2,15 %	09.02.2022	249.464	0,00 %
State Board of Administration Finance Corp.	\$ 250.000	2,16 %	01.07.2019	249.460	0,00 %
Commonwealth Edison Co.	\$ 250.000	2,15 %	15.01.2019	249.458	0,00 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 250.000	2,65 %	17.04.2020	249.395	0,00 %
Honeywell International, Inc.	€ 200.000	1,30 %	22.02.2023	249.389	0,00 %
Dallas Area Rapid Transit	\$ 200.000	5,02 %	01.12.2048	249.380	0,00 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 250.000	2,00 %	29.11.2019	249.287	0,00 %
KeyBank NA	\$ 250.000	2,25 %	16.03.2020	249.255	0,00 %
PNC Bank NA	\$ 250.000	2,30 %	01.06.2020	249.189	0,00 %
American Express Credit Corp.	\$ 250.000	2,20 %	03.03.2020	249.162	0,00 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 250.000	1,75 %	09.10.2019	249.121	0,00 %
Chevron Phillips Chemical Co. LLC/Chevron Phillips Chemical Co. LP	\$ 250.000	2,45 %	01.05.2020	249.104	0,00 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	\$ 250.000	1,70 %	15.03.2019	249.104	0,00 %
MUFG Americas Holdings Corp.	\$ 250.000	2,25 %	10.02.2020	249.035	0,00 %
Microsoft Corp.	\$ 250.000	2,70 %	12.02.2025	248.963	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 240.000	3,31 %	25.05.2023	248.846	0,00 %
Pfizer, Inc.	\$ 250.000	1,70 %	15.12.2019	248.842	0,00 %
Toyota Auto Receivables 2017-D Owner Trust	\$ 250.000	1,93 %	18.01.2022	248.605	0,00 %
Amphenol Corp.	\$ 250.000	2,20 %	01.04.2020	248.591	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 240.491	3,50 %	01.06.2045	248.561	0,00 %
Wells Fargo Bank NA	\$ 250.000	1,75 %	24.05.2019	248.554	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 242.966	3,00 %	20.05.2027	248.540	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 240.000	3,30 %	25.04.2023	248.489	0,00 %
Synchrony Bank	\$ 250.000	3,00 %	15.06.2022	248.429	0,00 %
Duke Energy Carolinas LLC	\$ 250.000	2,95 %	01.12.2026	248.358	0,00 %
General Mills, Inc.	\$ 250.000	3,20 %	10.02.2027	248.345	0,00 %
Bank of America Corp.^	\$ 245.000	3,12 %	20.01.2023	248.276	0,00 %
Xilinx, Inc.	\$ 250.000	2,95 %	01.06.2024	248.198	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 235.751	4,00 %	01.08.2041	248.191	0,00 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 250.000	2,29 %	15.07.2025	248.176	0,00 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 250.000	2,25 %	20.05.2020	248.167	0,00 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 250.000	4,20 %	15.03.2028	248.101	0,00 %
American Financial Group, Inc.	\$ 250.000	3,50 %	15.08.2026	248.073	0,00 %
US Bank NA	\$ 250.000	2,05 %	23.10.2020	247.979	0,00 %
PNC Bank NA	\$ 250.000	2,00 %	19.05.2020	247.934	0,00 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 250.000	2,08 %	15.10.2020	247.928	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Apple, Inc.	\$ 250.000	3,00 %	20.06.2027	247871	0,00 %
VMware, Inc.	\$ 250.000	2,30 %	21.08.2020	247854	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 239.777	3,50 %	01.06.2042	247847	0,00 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 250.000	3,30 %	01.12.2027	247813	0,00 %
3M Co.	\$ 250.000	2,25 %	15.03.2023	247727	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 240.749	3,50 %	01.09.2045	247713	0,00 %
Essex Portfolio LP	\$ 250.000	3,38 %	15.04.2026	247682	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 250.000	1,80 %	11.05.2020	247550	0,00 %
Citizens Bank NA	\$ 250.000	2,25 %	30.10.2020	247500	0,00 %
Mosaic Co.	\$ 250.000	3,25 %	15.11.2022	247498	0,00 %
American Water Capital Corp.	\$ 250.000	2,95 %	01.09.2027	247471	0,00 %
Wells Fargo & Co.	\$ 250.000	3,00 %	19.02.2025	247389	0,00 %
McDonald's Corp.	€ 200.000	1,13 %	26.05.2022	247283	0,00 %
Pfizer, Inc.	\$ 225.000	4,00 %	15.12.2036	247265	0,00 %
Costco Wholesale Corp.	\$ 250.000	1,75 %	15.02.2020	247229	0,00 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	\$ 250.000	3,45 %	01.06.2026	247214	0,00 %
Capital One Financial Corp.	\$ 250.000	3,20 %	05.02.2025	247110	0,00 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 200.000	4,88 %	08.07.2040	247092	0,00 %
Praxair, Inc.	\$ 250.000	2,65 %	05.02.2025	247054	0,00 %
Discovery Communications LLC	\$ 250.000	2,95 %	20.03.2023	246.958	0,00 %
United Technologies Corp.	\$ 250.000	3,75 %	01.11.2046	246.786	0,00 %
Hess Corp.	\$ 250.000	3,50 %	15.07.2024	246.627	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 230.175	5,00 %	01.04.2040	246.605	0,00 %
Kroger Co.	\$ 250.000	1,50 %	30.09.2019	246.379	0,00 %
Union Pacific Corp.	\$ 225.000	4,38 %	15.11.2065	246.346	0,00 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 200.000	4,75 %	02.10.2043	246.312	0,00 %
Energy Transfer LP	\$ 250.000	4,90 %	15.03.2035	246.179	0,00 %
Kimberly-Clark Corp.	\$ 250.000	2,75 %	15.02.2026	246.153	0,00 %
DTE Energy Co.	\$ 250.000	1,50 %	01.10.2019	246.079	0,00 %
Boeing Co.	\$ 250.000	3,30 %	01.03.2035	246.002	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 237.740	3,50 %	01.12.2029	245.966	0,00 %
General Motors Financial International BV	€ 200.000	1,17 %	18.05.2020	245.803	0,00 %
Johnson & Johnson	\$ 235.000	3,70 %	01.03.2046	245.793	0,00 %
Aetna, Inc.	\$ 250.000	3,88 %	15.08.2047	245.715	0,00 %
Wells Fargo & Co.	\$ 250.000	2,10 %	26.07.2021	245.584	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 244.842	3,00 %	01.01.2046	245.399	0,00 %
Ingredion, Inc.	\$ 250.000	3,20 %	01.10.2026	245.226	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 232.068	4,50 %	20.01.2045	244.646	0,00 %
National Retail Properties, Inc.	\$ 250.000	3,50 %	15.10.2027	244.613	0,00 %
PPG Industries, Inc.	€ 200.000	0,88 %	13.03.2022	244.611	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 230.196	4,00 %	01.11.2043	244.514	0,00 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 250.000	3,40 %	01.03.2027	244.505	0,00 %
John Deere Capital Corp.	\$ 250.000	2,15 %	08.09.2022	244.261	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 227.420	5,00 %	01.05.2040	244.108	0,00 %
McDonald's Corp.	\$ 250.000	3,70 %	15.02.2042	243.991	0,00 %
GATX Corp.	\$ 250.000	3,25 %	15.09.2026	243.972	0,00 %
McDonald's Corp.	€ 200.000	1,00 %	15.11.2023	243.814	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 238.000	4,00 %	01.11.2049	243.412	0,00 %
Reynolds American, Inc.	\$ 225.000	8,13 %	23.06.2019	243.340	0,00 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 250.000	1,75 %	15.08.2021	243.259	0,00 %
Southwestern Public Service Co.	\$ 250.000	3,40 %	15.08.2046	243.124	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 231.300	4,00 %	01.10.2043	242.680	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 249.101	2,50 %	01.01.2043	242.439	0,00 %
McDonald's Corp.	€ 200.000	0,50 %	15.01.2021	242.085	0,00 %
Energy Transfer LP	\$ 250.000	5,15 %	15.03.2045	242.049	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 250.000	2,49 %	25.05.2026	241.855	0,00 %
Entergy Louisiana LLC	\$ 250.000	3,05 %	01.06.2031	241.566	0,00 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 250.000	2,49 %	25.12.2026	241.370	0,00 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 175.000	6,65 %	15.11.2037	241.004	0,00 %
Nucor Corp.	\$ 200.000	5,20 %	01.08.2043	240.968	0,00 %
Principal Life Global Funding II	\$ 240.000	2,63 %	19.11.2020	240.699	0,00 %
State of Connecticut	\$ 200.000	5,85 %	15.03.2032	240.532	0,00 %
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 200.000	6,20 %	15.03.2040	240.333	0,00 %
Bristol-Myers Squibb Co.	€ 200.000	1,75 %	15.05.2035	240.137	0,00 %
Energy Transfer LP	\$ 225.000	5,20 %	01.02.2022	239.811	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 238.103	3,00 %	01.01.2043	239.164	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
CBS Corp.	\$ 175.000	7,88 %	30.07.2030	239.096	0,00 %
Verizon Communications, Inc.	€ 200.000	1,88 %	26.10.2029	239.067	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc. ^	CAD 300.000	3,31 %	31.10.2025	238.889	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 218.537	5,00 %	20.11.2039	238.752	0,00 %
Dover Corp.	€ 200.000	1,25 %	09.11.2026	238.509	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 232.104	3,50 %	01.04.2046	238.462	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 223.562	5,00 %	20.09.2041	238.315	0,00 %
Massachusetts Electric Co.	\$ 225.000	4,00 %	15.08.2046	238.082	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 216.370	5,50 %	01.11.2033	237.491	0,00 %
Coca-Cola Co.	\$ 250.000	2,25 %	01.09.2026	237.361	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 236.955	3,00 %	01.12.2042	237.164	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 235.000	2,75 %	23.06.2020	237.021	0,00 %
Noble Energy, Inc.	\$ 200.000	6,00 %	01.03.2041	236.972	0,00 %
AT&T, Inc.	€ 189.000	2,60 %	17.12.2029	236.833	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 218.334	5,00 %	15.07.2040	236.738	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 224.362	4,00 %	01.12.2035	236.562	0,00 %
Raytheon Co.	\$ 200.000	4,70 %	15.12.2041	235.704	0,00 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	€ 190.000	2,13 %	20.11.2026	235.519	0,00 %
Public Service Co. of Colorado	\$ 225.000	3,80 %	15.06.2047	235.484	0,00 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 200.000	5,05 %	15.11.2040	235.145	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 220.565	5,00 %	20.06.2041	234.235	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 220.142	4,50 %	01.01.2044	234.220	0,00 %
Devon Energy Corp.	\$ 225.000	4,00 %	15.07.2021	234.216	0,00 %
Aetna, Inc.	\$ 225.000	4,13 %	01.06.2021	233.851	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 229.003	3,00 %	01.12.2028	233.773	0,00 %
AT&T, Inc.	\$ 221.000	4,45 %	01.04.2024	233.253	0,00 %
Devon Financing Co. LLC	\$ 170.000	7,88 %	30.09.2031	233.100	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 220.762	4,00 %	01.11.2040	233.039	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 214.666	5,00 %	15.10.2034	232.732	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 218.849	4,50 %	01.05.2046	232.671	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 219.340	4,00 %	01.02.2045	232.496	0,00 %
Baxalta, Inc.	\$ 225.000	4,00 %	23.06.2025	232.422	0,00 %
Andeavor	\$ 225.000	5,38 %	01.10.2022	232.313	0,00 %
Berkshire Hathaway, Inc.	€ 200.000	1,63 %	16.03.2035	232.115	0,00 %
XLIT Ltd.	\$ 200.000	6,38 %	15.11.2024	232.111	0,00 %
Clorox Co.	\$ 225.000	3,50 %	15.12.2024	231.232	0,00 %
American International Group, Inc.	\$ 225.000	3,75 %	10.07.2025	231.056	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 200.000	5,15 %	22.05.2045	230.906	0,00 %
Allergan Funding SCS	\$ 217.000	4,75 %	15.03.2045	230.616	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp. ^	\$ 225.000	3,06 %	25.07.2023	230.461	0,00 %
GE Capital UK Funding Unlimited Co.	£ 150.000	4,13 %	13.09.2023	230.321	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 233.827	2,50 %	01.12.2036	230.187	0,00 %
Ecolab, Inc.	€ 190.000	1,00 %	15.01.2024	230.124	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 225.803	3,00 %	01.10.2028	230.089	0,00 %
American International Group, Inc.	\$ 225.000	3,38 %	15.08.2020	229.844	0,00 %
Time Warner Cable LLC	£ 150.000	5,25 %	15.07.2042	229.817	0,00 %
Chubb INA Holdings, Inc.	\$ 225.000	3,35 %	03.05.2026	229.355	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 218.841	4,00 %	20.07.2041	229.342	0,00 %
Vulcan Materials Co.	\$ 225.000	4,50 %	15.06.2047	229.298	0,00 %
Medtronic, Inc.	\$ 200.000	4,63 %	15.03.2044	229.253	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 228.966	2,50 %	01.06.2030	228.812	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 217.421	4,00 %	01.10.2045	228.802	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 221.007	3,50 %	01.04.2032	228.444	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 213.166	4,50 %	01.11.2039	228.315	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 232.182	2,50 %	01.02.2037	228.213	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 221.187	3,50 %	01.06.2042	228.030	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 211.021	4,50 %	01.05.2041	227.797	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 226.378	3,00 %	01.08.2042	227.595	0,00 %
Cox Communications, Inc.	\$ 225.000	4,60 %	15.08.2047	227.425	0,00 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 200.000	4,70 %	01.12.2044	227.098	0,00 %
Kimco Realty Corp.	\$ 225.000	3,80 %	01.04.2027	226.836	0,00 %
Raymond James Financial, Inc.	\$ 200.000	4,95 %	15.07.2046	226.418	0,00 %
CSX Corp.	\$ 225.000	4,25 %	01.11.2066	226.231	0,00 %
Highwoods Realty LP	\$ 225.000	3,88 %	01.03.2027	226.209	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 225.957	3,00 %	01.12.2042	226.121	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 211.299	4,50 %	01.03.2040	226.096	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Eversource Energy	\$ 225.000	3,15 %	15.01.2025	226.066	0,00 %
Alameda County Joint Powers Authority	\$ 150.000	7,05 %	01.12.2044	225.991	0,00 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 200.000	4,45 %	15.02.2044	225.559	0,00 %
Celgene Corp.	\$ 225.000	3,45 %	15.11.2027	225.470	0,00 %
US Bancorp	\$ 225.000	3,15 %	27.04.2027	225.275	0,00 %
Occidental Petroleum Corp.	\$ 200.000	4,63 %	15.06.2045	225.273	0,00 %
Ameren Corp.	\$ 225.000	2,70 %	15.11.2020	225.188	0,00 %
Bank of America Corp. ^	\$ 225.000	2,88 %	24.04.2023	225.165	0,00 %
MidAmerican Energy Co.	\$ 175.000	5,80 %	15.10.2036	225.163	0,00 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 225.000	2,65 %	13.04.2020	224.902	0,00 %
American International Group, Inc.	\$ 175.000	6,25 %	01.05.2036	224.892	0,00 %
Pfizer, Inc.	£ 165.000	2,74 %	15.06.2043	224.806	0,00 %
Abbott Laboratories	\$ 200.000	4,75 %	30.11.2036	224.768	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 217.825	3,50 %	01.10.2042	224.668	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 217.237	3,50 %	01.11.2042	224.537	0,00 %
AbbVie, Inc.	\$ 225.000	2,85 %	14.05.2023	224.499	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 222.234	3,00 %	20.09.2045	224.405	0,00 %
Commonwealth Edison Co.	\$ 200.000	4,35 %	15.11.2045	224.209	0,00 %
Protective Life Global Funding	\$ 225.000	1,72 %	15.04.2019	224.116	0,00 %
BA Credit Card Trust	\$ 225.000	1,95 %	15.08.2022	224.014	0,00 %
American Express Credit Account Master Trust	\$ 225.000	1,93 %	15.09.2022	223.946	0,00 %
Duquesne Light Holdings, Inc.	\$ 225.000	3,62 %	01.08.2027	223.941	0,00 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 225.000	3,88 %	21.08.2042	223.641	0,00 %
Georgia Power Co.	\$ 225.000	2,00 %	30.03.2020	223.535	0,00 %
University of California	\$ 200.000	4,86 %	15.05.2112	223.248	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 215.386	3,50 %	01.12.2035	223.117	0,00 %
State of California	\$ 200.000	5,70 %	01.11.2021	223.008	0,00 %
Federal Farm Credit Banks	\$ 225.000	1,68 %	13.10.2020	222.825	0,00 %
Royal Caribbean Cruises Ltd.	\$ 225.000	3,70 %	15.03.2028	222.469	0,00 %
Wells Fargo & Co.	\$ 200.000	4,75 %	07.12.2046	222.435	0,00 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 200.000	4,11 %	01.03.2046	222.276	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 209.420	4,00 %	01.04.2047	221.796	0,00 %
US Treasury Note	\$ 225.000	1,00 %	30.09.2019	221.695	0,00 %
General Electric Co.	\$ 200.000	4,50 %	11.03.2044	221.557	0,00 %
Abbott Laboratories	\$ 225.000	2,95 %	15.03.2025	221.481	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 211.334	4,00 %	01.09.2044	221.337	0,00 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 200.000	4,90 %	15.05.2046	221.187	0,00 %
Altria Group, Inc.	\$ 220.000	2,85 %	09.08.2022	221.181	0,00 %
S&P Global, Inc.	\$ 205.000	4,40 %	15.02.2026	221.020	0,00 %
Aetna, Inc.	\$ 225.000	2,80 %	15.06.2023	220.920	0,00 %
Occidental Petroleum Corp.	\$ 200.000	4,40 %	15.04.2046	220.722	0,00 %
CVS Health Corp.	\$ 200.000	4,88 %	20.07.2035	220.492	0,00 %
Estee Lauder Cos, Inc.	\$ 225.000	1,70 %	10.05.2021	219.991	0,00 %
Marathon Oil Corp.	\$ 200.000	5,20 %	01.06.2045	219.798	0,00 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 200.000	4,38 %	15.09.2045	219.469	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 202.499	4,50 %	01.03.2046	219.327	0,00 %
NiSource Finance Corp.	\$ 200.000	4,38 %	15.05.2047	218.971	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 214.638	3,00 %	01.10.2030	218.942	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 214.303	3,00 %	01.02.2029	218.765	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 150.000	7,25 %	15.05.2030	218.693	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 212.776	3,50 %	01.09.2046	218.605	0,00 %
Republic Services, Inc.	\$ 200.000	5,25 %	15.11.2021	218.564	0,00 %
Halliburton Co.	\$ 200.000	4,75 %	01.08.2043	218.357	0,00 %
Allstate Corp. ^	\$ 200.000	5,75 %	15.08.2053	218.250	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 208.011	4,00 %	01.08.2046	218.243	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 217.247	3,00 %	01.01.2043	218.213	0,00 %
General Motors Co.	\$ 200.000	5,40 %	01.04.2048	218.154	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 216.694	3,00 %	01.11.2042	218.090	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 213.092	4,50 %	01.10.2024	217.988	0,00 %
MPLX LP	\$ 200.000	5,20 %	01.03.2047	217.873	0,00 %
Verisk Analytics, Inc.	\$ 200.000	5,80 %	01.05.2021	217.834	0,00 %
Kinder Morgan, Inc.	\$ 200.000	5,55 %	01.06.2045	217.768	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 211.163	3,50 %	01.03.2042	217.696	0,00 %
Hyatt Hotels Corp.	\$ 200.000	4,85 %	15.03.2026	217.687	0,00 %
Noble Energy, Inc.	\$ 200.000	5,25 %	15.11.2043	217.653	0,00 %
International Paper Co.	\$ 200.000	4,80 %	15.06.2044	217.595	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 206.407	4,00 %	01.05.2042	217.401	0,00 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 215.000	3,15 %	15.01.2026	217.064	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	5,75 %	01.02.2021	216.711	0,00 %
Kaiser Foundation Hospitals	\$ 200.000	4,15 %	01.05.2047	216.627	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 210.739	3,50 %	01.06.2045	216.607	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 202.600	4,50 %	01.06.2044	216.515	0,00 %
Alabama Power Co.	\$ 200.000	4,15 %	15.08.2044	216.438	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 200.107	5,00 %	01.07.2035	216.345	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 209.410	4,00 %	01.06.2024	216.109	0,00 %
American International Group, Inc.	\$ 200.000	4,50 %	16.07.2044	215.977	0,00 %
Alleghany Corp.	\$ 200.000	4,90 %	15.09.2044	215.828	0,00 %
HP, Inc.	\$ 200.000	6,00 %	15.09.2041	215.812	0,00 %
Buckeye Partners LP	\$ 200.000	5,85 %	15.11.2043	215.577	0,00 %
Western Union Co.	\$ 200.000	6,20 %	17.11.2036	215.468	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 225.000	3,20 %	15.07.2036	215.458	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 203.191	4,00 %	01.11.2046	215.179	0,00 %
General Electric Co.	\$ 200.000	5,30 %	11.02.2021	215.109	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 205.643	4,00 %	01.01.2045	215.102	0,00 %
WR Berkley Corp.	\$ 200.000	4,75 %	01.08.2044	215.055	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 191.358	6,00 %	01.12.2036	214.904	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 204.040	4,00 %	01.10.2040	214.885	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 206.625	3,50 %	01.10.2031	214.839	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 195.656	5,50 %	01.11.2033	214.745	0,00 %
Digital Realty Trust LP	\$ 200.000	5,25 %	15.03.2021	214.543	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 199.259	5,00 %	01.05.2040	214.304	0,00 %
Pioneer Natural Resources Co.	\$ 200.000	4,45 %	15.01.2026	214.152	0,00 %
AbbVie, Inc.	\$ 200.000	4,30 %	14.05.2036	214.120	0,00 %
Cardinal Health, Inc.	\$ 200.000	4,90 %	15.09.2045	214.111	0,00 %
Consumers Energy Co.	\$ 200.000	6,70 %	15.09.2019	214.014	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 204.210	4,00 %	01.01.2041	213.895	0,00 %
Reynolds American, Inc.	\$ 210.000	3,25 %	12.06.2020	213.262	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 205.378	3,50 %	20.02.2044	213.203	0,00 %
General Motors Co.	\$ 200.000	5,15 %	01.04.2038	213.122	0,00 %
Blackstone Holdings Finance Co. LLC	\$ 200.000	4,45 %	15.07.2045	213.090	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 202.971	4,00 %	01.11.2045	212.945	0,00 %
American Water Capital Corp.	\$ 200.000	4,00 %	01.12.2046	212.927	0,00 %
Devon Energy Corp.	\$ 200.000	4,75 %	15.05.2042	212.771	0,00 %
Occidental Petroleum Corp.	\$ 200.000	4,10 %	15.02.2047	212.582	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 207.956	3,00 %	01.04.2032	212.218	0,00 %
Kellogg Co.	\$ 200.000	4,50 %	01.04.2046	212.129	0,00 %
Starbucks Corp.	\$ 200.000	3,85 %	01.10.2023	212.105	0,00 %
Aptiv plc	\$ 200.000	4,25 %	15.01.2026	212.085	0,00 %
Ameriprise Financial, Inc.	\$ 200.000	5,30 %	15.03.2020	212.044	0,00 %
Home Depot, Inc.	\$ 190.000	4,25 %	01.04.2046	212.019	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 207.732	3,00 %	01.09.2030	211.892	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 202.582	4,00 %	01.10.2044	211.851	0,00 %
New York & Presbyterian Hospital	\$ 200.000	4,02 %	01.08.2045	211.717	0,00 %
Ameriprise Financial, Inc.	\$ 200.000	4,00 %	15.10.2023	211.687	0,00 %
Blackstone Holdings Finance Co. LLC	\$ 215.000	4,00 %	02.10.2047	211.540	0,00 %
AT&T, Inc.	\$ 200.000	5,20 %	15.03.2020	211.398	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 193.106	5,50 %	01.07.2037	211.387	0,00 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	\$ 200.000	6,90 %	01.04.2029	211.282	0,00 %
Apple, Inc.	CHF 200.000	0,75 %	25.02.2030	211.239	0,00 %
Masco Corp.	\$ 200.000	4,38 %	01.04.2026	211.190	0,00 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 200.000	7,15 %	15.02.2019	211.008	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 200.000	4,13 %	15.12.2026	210.877	0,00 %
Simon Property Group LP	\$ 200.000	4,25 %	30.11.2046	210.859	0,00 %
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	\$ 200.000	4,50 %	01.06.2021	210.819	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 204.188	3,50 %	01.11.2046	210.737	0,00 %
Phillips 66 Partners LP	\$ 200.000	4,90 %	01.10.2046	210.712	0,00 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	\$ 200.000	4,65 %	01.06.2046	210.608	0,00 %
Cummins, Inc.	\$ 200.000	3,65 %	01.10.2023	210.535	0,00 %
American Express Co.	\$ 200.000	4,05 %	03.12.2042	210.529	0,00 %
McCormick & Co., Inc.	\$ 200.000	4,20 %	15.08.2047	210.340	0,00 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 200.000	4,07 %	15.12.2042	210.184	0,00 %
American Tower Corp.	\$ 200.000	4,40 %	15.02.2026	210.122	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
PepsiCo, Inc.	\$ 200.000	4,00 %	05.03.2042	210.057	0,00 %
Advance Auto Parts, Inc.	\$ 200.000	4,50 %	01.12.2023	209.994	0,00 %
Intercontinental Exchange, Inc.	\$ 200.000	3,75 %	01.12.2025	209.862	0,00 %
Oracle Corp.	\$ 200.000	3,63 %	15.07.2023	209.819	0,00 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 200.000	3,63 %	15.12.2047	209.794	0,00 %
General Mills, Inc.	\$ 200.000	3,65 %	15.02.2024	209.785	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 202.921	3,50 %	01.04.2042	209.745	0,00 %
Dow Chemical Co.	\$ 200.000	4,13 %	15.11.2021	209.607	0,00 %
New York City Water & Sewer System	\$ 150.000	5,95 %	15.06.2042	209.582	0,00 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 171.000	6,13 %	15.11.2041	209.561	0,00 %
International Paper Co.	\$ 150.000	7,30 %	15.11.2039	209.539	0,00 %
EnLink Midstream Partners LP	\$ 200.000	4,85 %	15.07.2026	209.386	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	4,25 %	20.09.2022	209.361	0,00 %
PNC Financial Services Group, Inc.	\$ 200.000	3,90 %	29.04.2024	209.313	0,00 %
JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017	\$ 200.000	3,72 %	15.03.2050	209.304	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 196.029	4,50 %	01.02.2041	209.240	0,00 %
Apple, Inc.	CHF 200.000	0,38 %	25.11.2024	209.236	0,00 %
Walt Disney Co.	\$ 150.000	7,00 %	01.03.2032	209.157	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 199.886	4,00 %	01.09.2046	209.034	0,00 %
El du Pont de Nemours & Co.	\$ 200.000	4,63 %	15.01.2020	209.026	0,00 %
Expedia, Inc.	\$ 200.000	4,50 %	15.08.2024	208.896	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 190.219	5,50 %	01.02.2037	208.869	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 200.000	3,90 %	15.07.2025	208.835	0,00 %
Dow Chemical Co.	\$ 200.000	4,25 %	15.11.2020	208.778	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 201.473	3,50 %	01.10.2035	208.712	0,00 %
Merck Sharp & Dohme Corp.	\$ 200.000	5,00 %	30.06.2019	208.555	0,00 %
Analog Devices, Inc.	\$ 200.000	3,90 %	15.12.2025	208.550	0,00 %
AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2017	\$ 210.000	1,90 %	18.03.2022	208.467	0,00 %
Textron, Inc.	\$ 200.000	4,00 %	15.03.2026	208.452	0,00 %
McDonald's Corp.	\$ 200.000	3,70 %	30.01.2026	208.446	0,00 %
Newmont Mining Corp.	\$ 200.000	5,13 %	01.10.2019	208.331	0,00 %
Medtronic, Inc.	\$ 200.000	5,60 %	15.03.2019	208.287	0,00 %
Duke Energy Florida LLC	\$ 150.000	6,35 %	15.09.2037	208.262	0,00 %
CCRE26Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 200.000	3,63 %	10.10.2048	208.204	0,00 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 200.000	5,00 %	30.06.2019	207.775	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 197.229	4,00 %	01.12.2040	207.620	0,00 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 200.000	3,55 %	15.01.2026	207.590	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 194.714	4,50 %	01.10.2047	207.552	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 220.000	2,35 %	15.01.2027	207.511	0,00 %
eBay, Inc.	\$ 200.000	3,80 %	09.03.2022	207.319	0,00 %
Celgene Corp.	\$ 200.000	3,95 %	15.10.2020	207.313	0,00 %
Public Service Co. of Colorado	\$ 200.000	5,13 %	01.06.2019	207.278	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 200.000	5,70 %	01.02.2019	207.274	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 207.123	3,00 %	01.12.2042	207.274	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 193.398	4,50 %	01.03.2034	207.206	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	4,13 %	04.08.2025	207.104	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 190.246	5,00 %	20.05.2040	207.096	0,00 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 200.000	3,65 %	01.03.2026	207.076	0,00 %
GE Capital UK Funding Unlimited Co.	£ 100.000	6,25 %	05.05.2038	207.039	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 200.000	3,64 %	15.03.2050	207.006	0,00 %
Citigroup, Inc.	\$ 150.000	6,68 %	13.09.2043	206.959	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 193.592	4,50 %	01.07.2041	206.844	0,00 %
Howard Hughes Medical Institute	\$ 200.000	3,50 %	01.09.2023	206.591	0,00 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 200.000	3,85 %	15.11.2024	206.400	0,00 %
General Electric Co.	\$ 200.000	3,45 %	15.05.2024	206.178	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 196.370	4,00 %	15.01.2041	206.108	0,00 %
Valero Energy Corp.	\$ 200.000	3,65 %	15.03.2025	206.072	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 200.000	3,21 %	25.03.2025	205.980	0,00 %
John Deere Capital Corp.	\$ 200.000	3,35 %	12.06.2024	205.911	0,00 %
General Motors Co.	\$ 200.000	4,20 %	01.10.2027	205.877	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017	\$ 200.000	3,85 %	15.05.2050	205.836	0,00 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	\$ 200.000	4,10 %	15.08.2047	205.779	0,00 %
Israel Government AID Bond	\$ 175.000	5,50 %	26.04.2024	205.704	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 200.000	3,38 %	15.02.2025	205.618	0,00 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 200.000	3,35 %	15.09.2021	205.577	0,00 %
Kimco Realty Corp.	\$ 200.000	4,45 %	01.09.2047	205.540	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Time Warner Cable LLC	\$ 200.000	4,00 %	01.09.2021	205.427	0,00 %
EPR Properties	\$ 200.000	4,75 %	15.12.2026	205.360	0,00 %
Hashemite Kingdom of Jordan Government AID Bond	\$ 200.000	3,00 %	30.06.2025	205.215	0,00 %
Occidental Petroleum Corp.	\$ 200.000	3,40 %	15.04.2026	205.165	0,00 %
Apple, Inc.	€ 156.000	2,00 %	17.09.2027	204.952	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 200.000	3,42 %	15.09.2050	204.858	0,00 %
National Retail Properties, Inc.	\$ 200.000	4,00 %	15.11.2025	204.819	0,00 %
Simon Property Group LP	\$ 200.000	3,50 %	01.09.2025	204.665	0,00 %
Pioneer Natural Resources Co.	\$ 200.000	3,45 %	15.01.2021	204.664	0,00 %
Precision Castparts Corp.	\$ 200.000	3,25 %	15.06.2025	204.598	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 200.000	3,75 %	12.09.2047	204.518	0,00 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 200.000	3,72 %	15.06.2050	204.448	0,00 %
Marathon Petroleum Corp.	\$ 200.000	3,40 %	15.12.2020	204.348	0,00 %
Johnson & Johnson	\$ 200.000	3,50 %	15.01.2048	204.342	0,00 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	\$ 200.000	3,80 %	18.11.2024	204.314	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 196.955	3,50 %	01.02.2034	204.296	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	3,81 %	09.01.2024	204.273	0,00 %
Johnson & Johnson	\$ 200.000	3,40 %	15.01.2038	204.262	0,00 %
Visa, Inc.	\$ 200.000	3,65 %	15.09.2047	204.246	0,00 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 200.000	3,43 %	15.08.2050	204.050	0,00 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	\$ 200.000	4,25 %	01.04.2024	204.030	0,00 %
Marriott International, Inc.	\$ 200.000	3,38 %	15.10.2020	203.920	0,00 %
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	\$ 200.000	3,95 %	15.01.2028	203.914	0,00 %
eBay, Inc.	\$ 200.000	3,25 %	15.10.2020	203.902	0,00 %
International Business Machines Corp.	\$ 200.000	3,30 %	27.01.2027	203.861	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 200.000	3,12 %	25.09.2026	203.798	0,00 %
NiSource Finance Corp.	\$ 200.000	3,95 %	30.03.2048	203.768	0,00 %
General Mills, Inc.	\$ 200.000	3,15 %	15.12.2021	203.765	0,00 %
BlackRock, Inc.	€ 165.000	1,25 %	06.05.2025	203.749	0,00 %
Zoetis, Inc.	\$ 200.000	3,95 %	12.09.2047	203.734	0,00 %
Anthem, Inc.	\$ 200.000	3,65 %	01.12.2027	203.588	0,00 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 200.000	3,25 %	11.09.2024	203.522	0,00 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 200.000	3,05 %	15.03.2022	203.517	0,00 %
NiSource Finance Corp.	\$ 200.000	3,49 %	15.05.2027	203.448	0,00 %
Physicians Realty LP	\$ 200.000	4,30 %	15.03.2027	203.422	0,00 %
Chicago Transit Authority	\$ 150.000	6,90 %	01.12.2040	203.383	0,00 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	\$ 200.000	2,90 %	15.10.2020	203.328	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 198.635	3,00 %	01.03.2027	203.317	0,00 %
Tyson Foods, Inc.	\$ 200.000	3,55 %	02.06.2027	203.292	0,00 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 200.000	3,30 %	15.10.2022	203.143	0,00 %
Willis North America, Inc.	\$ 200.000	3,60 %	15.05.2024	203.133	0,00 %
Mead Johnson Nutrition Co.	\$ 200.000	3,00 %	15.11.2020	202.974	0,00 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 200.000	3,50 %	10.07.2019	202.952	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 201.623	3,00 %	01.04.2043	202.923	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 200.000	2,91 %	25.07.2049	202.818	0,00 %
Perrigo Finance Unlimited Co.	\$ 200.000	3,50 %	15.03.2021	202.811	0,00 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 200.000	3,13 %	15.09.2024	202.785	0,00 %
Omega Healthcare Investors, Inc.	\$ 200.000	4,38 %	01.08.2023	202.750	0,00 %
Dover Corp.	\$ 200.000	3,15 %	15.11.2025	202.723	0,00 %
Microsoft Corp.	\$ 200.000	3,50 %	15.11.2042	202.533	0,00 %
General Dynamics Corp.	\$ 200.000	3,60 %	15.11.2042	202.506	0,00 %
Pepsi-Cola Metropolitan Bottling Co., Inc.	\$ 150.000	7,00 %	01.03.2029	202.388	0,00 %
Archer-Daniels-Midland Co.	\$ 200.000	3,75 %	15.09.2047	202.372	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 189.264	4,50 %	01.06.2039	202.366	0,00 %
Westlake Chemical Corp.	\$ 200.000	3,60 %	15.08.2026	202.297	0,00 %
AmerisourceBergen Corp.	\$ 200.000	4,30 %	15.12.2047	202.228	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 200.000	3,63 %	01.12.2027	202.167	0,00 %
Sherwin-Williams Co.	\$ 200.000	3,45 %	01.08.2025	202.068	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 197.435	3,00 %	20.06.2027	201.962	0,00 %
FedEx Corp.	\$ 200.000	4,10 %	01.02.2045	201.853	0,00 %
Brixmor Operating Partnership LP	\$ 200.000	4,13 %	15.06.2026	201.853	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 188.344	4,50 %	01.03.2034	201.787	0,00 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	\$ 200.000	4,38 %	01.09.2023	201.690	0,00 %
Boston Properties LP	\$ 200.000	3,13 %	01.09.2023	201.655	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 179.027	6,00 %	01.03.2036	201.450	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 192.213	4,00 %	20.07.2043	201.444	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Marriott International, Inc.	\$ 200.000	2,88 %	01.03.2021	201.384	0,00 %
Boeing Co.	\$ 200.000	2,85 %	30.10.2024	201.301	0,00 %
eBay, Inc.	\$ 200.000	2,88 %	01.08.2021	201.288	0,00 %
Florida Power & Light Co.	\$ 150.000	5,95 %	01.02.2038	201.274	0,00 %
Baxalta, Inc.	\$ 200.000	2,88 %	23.06.2020	201.074	0,00 %
Flowserve Corp.	\$ 200.000	3,50 %	15.09.2022	201.074	0,00 %
Perrigo Finance Unlimited Co.	\$ 200.000	4,90 %	15.12.2044	201.067	0,00 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 200.000	2,80 %	01.11.2018	201.036	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 200.000	3,10 %	15.03.2026	200.940	0,00 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	\$ 200.000	3,45 %	15.01.2021	200.924	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 188.195	4,50 %	01.06.2041	200.920	0,00 %
Stanley Black & Decker, Inc.	\$ 200.000	2,90 %	01.11.2022	200.851	0,00 %
Simon Property Group LP	\$ 200.000	2,50 %	01.09.2020	200.823	0,00 %
Priceline Group, Inc.	\$ 200.000	3,60 %	01.06.2026	200.797	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 200.598	3,00 %	01.09.2042	200.744	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 195.373	3,50 %	01.08.2044	200.727	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 200.000	2,10 %	06.05.2019	200.491	0,00 %
Williams Partners LP	\$ 200.000	3,75 %	15.06.2027	200.401	0,00 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 200.000	2,95 %	28.02.2026	200.364	0,00 %
Pfizer, Inc.	\$ 200.000	2,10 %	15.05.2019	200.312	0,00 %
Amphenol Corp.	\$ 200.000	2,55 %	30.01.2019	200.287	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	2,68 %	09.01.2020	200.281	0,00 %
Darden Restaurants, Inc.	\$ 150.000	6,80 %	15.10.2037	200.244	0,00 %
Mid-America Apartments LP	\$ 200.000	3,60 %	01.06.2027	200.242	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 200.000	2,22 %	25.12.2018	200.106	0,00 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 150.000	6,40 %	15.12.2035	200.099	0,00 %
Ecolab, Inc.	\$ 200.000	3,25 %	01.12.2027	200.089	0,00 %
Valero Energy Corp.	\$ 200.000	3,40 %	15.09.2026	200.076	0,00 %
Discover Card Execution Note Trust	\$ 200.000	2,39 %	15.07.2024	199.999	0,00 %
Marathon Oil Corp.	\$ 200.000	2,70 %	01.06.2020	199.863	0,00 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 200.000	2,65 %	15.12.2024	199.807	0,00 %
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 200.000	2,65 %	08.04.2022	199.798	0,00 %
JM Smucker Co.	\$ 200.000	2,20 %	06.12.2019	199.725	0,00 %
Hashemite Kingdom of Jordan Government AID Bond	\$ 200.000	1,95 %	23.06.2019	199.700	0,00 %
Huntington National Bank	\$ 200.000	2,40 %	01.04.2020	199.654	0,00 %
El du Pont de Nemours & Co.	\$ 200.000	2,20 %	01.05.2020	199.641	0,00 %
State of California	\$ 125.000	7,60 %	01.11.2040	199.616	0,00 %
Illinois Tool Works, Inc.	\$ 200.000	1,95 %	01.03.2019	199.557	0,00 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 200.000	1,88 %	15.01.2019	199.556	0,00 %
American Express Co.	\$ 200.000	3,00 %	30.10.2024	199.504	0,00 %
Vornado Realty LP	\$ 200.000	3,50 %	15.01.2025	199.447	0,00 %
Mercedes-Benz Auto Lease Trust 2017	\$ 200.000	2,01 %	17.01.2023	199.389	0,00 %
Occidental Petroleum Corp.	\$ 200.000	2,70 %	15.02.2023	199.383	0,00 %
Chevron Corp.	\$ 200.000	1,69 %	28.02.2019	199.325	0,00 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 200.000	3,40 %	18.01.2023	199.215	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	3,82 %	02.11.2027	199.189	0,00 %
Microsoft Corp.	\$ 200.000	1,30 %	03.11.2018	199.187	0,00 %
Life Storage LP	\$ 200.000	3,88 %	15.12.2027	199.185	0,00 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 200.000	1,85 %	20.09.2019	199.178	0,00 %
SL Green Operating Partnership LP	\$ 200.000	3,25 %	15.10.2022	199.161	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 190.398	4,00 %	01.04.2045	199.102	0,00 %
Honeywell International, Inc.	\$ 200.000	1,80 %	30.10.2019	198.989	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 200.000	2,37 %	25.05.2022	198.976	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	2,02 %	03.05.2019	198.947	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 200.000	2,40 %	07.06.2021	198.940	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016	\$ 200.000	3,10 %	15.11.2049	198.818	0,00 %
Discover Card Execution Note Trust	\$ 200.000	1,90 %	17.10.2022	198.749	0,00 %
CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016^	\$ 200.000	3,22 %	10.11.2049	198.696	0,00 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 200.000	1,90 %	15.12.2020	198.691	0,00 %
Regions Financial Corp.	\$ 200.000	2,75 %	14.08.2022	198.691	0,00 %
IBM Credit LLC	\$ 200.000	1,63 %	06.09.2019	198.661	0,00 %
Crown Castle International Corp.	\$ 200.000	3,65 %	01.09.2027	198.630	0,00 %
Amazon.com, Inc.	\$ 200.000	1,90 %	21.08.2020	198.578	0,00 %
NIKE, Inc.	\$ 200.000	2,25 %	01.05.2023	198.558	0,00 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 200.000	2,80 %	15.11.2024	198.547	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Fifth Third Bank	\$ 200.000	2,20 %	30.10.2020	198.538	0,00 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 200.000	2,50 %	01.04.2023	198.519	0,00 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	\$ 200.000	3,95 %	01.10.2046	198.502	0,00 %
American Express Co.	\$ 200.000	2,20 %	30.10.2020	198.430	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 180.716	5,50 %	01.09.2034	198.412	0,00 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 125.000	8,20 %	15.01.2039	198.366	0,00 %
Brixmor Operating Partnership LP	\$ 200.000	3,65 %	15.06.2024	198.358	0,00 %
Ukraine Government AID Bonds	\$ 200.000	1,85 %	29.05.2020	198.317	0,00 %
Abbott Laboratories	\$ 200.000	2,00 %	15.03.2020	198.297	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 180.579	5,50 %	01.06.2033	198.201	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 200.000	2,13 %	15.03.2021	198.101	0,00 %
PepsiCo, Inc.	\$ 175.000	4,45 %	14.04.2046	198.094	0,00 %
Costco Wholesale Corp.	\$ 200.000	2,30 %	18.05.2022	198.065	0,00 %
Enterprise Products Operating LLC^	\$ 200.000	5,25 %	16.08.2077	198.058	0,00 %
United Technologies Corp.	\$ 200.000	1,90 %	04.05.2020	197.968	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	2,34 %	02.11.2020	197.961	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 186.216	4,50 %	01.05.2031	197.957	0,00 %
Athene Global Funding	\$ 200.000	3,00 %	01.07.2022	197.886	0,00 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 200.000	1,15 %	15.04.2019	197.823	0,00 %
Coca-Cola Co.	\$ 200.000	2,20 %	25.05.2022	197.806	0,00 %
CMS Energy Corp.	\$ 200.000	3,00 %	15.05.2026	197.449	0,00 %
Applied Materials, Inc.	\$ 175.000	4,35 %	01.04.2047	197.130	0,00 %
CNA Financial Corp.	\$ 200.000	3,45 %	15.08.2027	197.092	0,00 %
PACCAR Financial Corp.	\$ 200.000	2,30 %	10.08.2022	196.943	0,00 %
State of Texas	\$ 150.000	5,52 %	01.04.2039	196.920	0,00 %
John Deere Capital Corp.	\$ 200.000	1,25 %	09.10.2019	196.884	0,00 %
Cardinal Health, Inc.	\$ 200.000	2,62 %	15.06.2022	196.865	0,00 %
MUFG Americas Holdings Corp.	\$ 200.000	3,00 %	10.02.2025	196.792	0,00 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 200.000	1,85 %	04.09.2020	196.768	0,00 %
CenterPoint Energy, Inc.	\$ 200.000	2,50 %	01.09.2022	196.576	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 189.393	3,50 %	01.06.2037	196.465	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 174.412	6,00 %	01.08.2034	196.381	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 189.148	3,50 %	20.11.2044	196.349	0,00 %
Duke Energy Corp.	\$ 200.000	2,40 %	15.08.2022	196.345	0,00 %
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016	\$ 200.000	2,87 %	15.08.2049	196.306	0,00 %
Capital One Na	\$ 200.000	2,25 %	13.09.2021	196.215	0,00 %
University of California	\$ 150.000	5,77 %	15.05.2043	196.194	0,00 %
Boeing Co.	\$ 200.000	2,60 %	30.10.2025	196.174	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 200.000	2,57 %	25.07.2026	195.978	0,00 %
Cardinal Health, Inc.	\$ 200.000	3,41 %	15.06.2027	195.650	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 189.758	3,50 %	01.02.2042	195.628	0,00 %
Blackstone Holdings Finance Co. LLC	\$ 200.000	3,15 %	02.10.2027	195.477	0,00 %
Coca-Cola Co.	\$ 200.000	1,55 %	01.09.2021	195.141	0,00 %
Apple, Inc.	€ 153.000	1,63 %	10.11.2026	195.054	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 194.909	3,00 %	01.08.2046	195.052	0,00 %
LyondellBasell Industries NV	\$ 190.000	5,00 %	15.04.2019	195.048	0,00 %
Appalachian Power Co.	\$ 175.000	4,45 %	01.06.2045	194.780	0,00 %
CSX Corp.	\$ 150.000	6,15 %	01.05.2037	194.709	0,00 %
Enbridge Energy Partners LP	\$ 150.000	7,50 %	15.04.2038	194.392	0,00 %
Visa, Inc.	\$ 175.000	4,15 %	14.12.2035	194.187	0,00 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 200.000	3,00 %	30.10.2028	193.958	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 178.404	4,50 %	01.05.2039	193.946	0,00 %
American International Group, Inc.	\$ 175.000	6,40 %	15.12.2020	193.874	0,00 %
New York Life Global Funding	\$ 200.000	1,70 %	14.09.2021	193.865	0,00 %
Ventas Realty LP	\$ 200.000	3,25 %	15.10.2026	193.816	0,00 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 200.000	2,45 %	25.09.2026	193.782	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 181.511	4,50 %	01.01.2044	193.614	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 184.809	4,00 %	20.06.2046	193.566	0,00 %
Expedia, Inc.	\$ 200.000	3,80 %	15.02.2028	193.226	0,00 %
Amgen, Inc.	€ 150.000	2,00 %	25.02.2026	193.218	0,00 %
Honeywell International, Inc.	\$ 200.000	2,50 %	01.11.2026	192.676	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 171.606	6,00 %	01.03.2034	192.539	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 142.000	6,40 %	15.05.2038	192.463	0,00 %
Wal-Mart Stores, Inc.	£ 100.000	5,25 %	28.09.2035	192.383	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 182.618	4,00 %	01.02.2041	192.328	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 192.114	3,00 %	01.09.2046	192.254	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anthem, Inc.	\$ 190.000	3,35 %	01.12.2024	192.101	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 191.192	3,00 %	01.10.2042	191.716	0,00 %
Ecolab, Inc.	\$ 200.000	2,70 %	01.11.2026	191.695	0,00 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 200.000	2,37 %	25.07.2026	191.688	0,00 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 200.000	3,75 %	15.02.2028	191.623	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 200.000	2,60 %	19.08.2026	191.531	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 182.358	4,00 %	01.12.2044	190.947	0,00 %
Bunge Ltd. Finance Corp.	\$ 200.000	3,25 %	15.08.2026	190.919	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 187.240	3,00 %	01.03.2031	190.791	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 185.235	3,50 %	01.08.2045	190.391	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 178.236	4,50 %	01.08.2044	190.282	0,00 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 150.000	5,95 %	15.06.2035	189.673	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 182.904	3,50 %	01.06.2036	189.620	0,00 %
Fidelity National Information Services, Inc.	£ 140.000	1,70 %	30.06.2022	189.537	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 177.541	5,00 %	20.11.2041	189.470	0,00 %
Sysco Corp.	\$ 175.000	4,50 %	01.04.2046	189.290	0,00 %
Dominion Energy, Inc.^	\$ 175.000	5,75 %	01.10.2054	189.234	0,00 %
United Airlines 2015-1 Klasse AA Pass Through Trust	\$ 185.494	3,45 %	01.12.2027	188.425	0,00 %
University of Southern California	\$ 200.000	3,03 %	01.10.2039	188.416	0,00 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	\$ 150.000	5,30 %	01.06.2042	187.970	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 179.004	4,00 %	01.09.2040	187.937	0,00 %
Kimco Realty Corp.	\$ 200.000	2,80 %	01.10.2026	187.874	0,00 %
Whirlpool Corp.	\$ 175.000	4,70 %	01.06.2022	187.841	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 181.571	4,00 %	01.08.2025	187.764	0,00 %
Colgate-Palmolive Co.	\$ 175.000	4,00 %	15.08.2045	187.699	0,00 %
State of California	\$ 125.000	7,35 %	01.11.2039	187.590	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 186.182	3,00 %	01.08.2042	187.182	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 174.372	4,50 %	20.07.2040	187.169	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 187.028	3,00 %	01.10.2046	187.166	0,00 %
Kimberly-Clark Corp.	\$ 200.000	3,20 %	30.07.2046	186.681	0,00 %
Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 180.000	3,57 %	15.02.2050	186.264	0,00 %
US Treasury Note	\$ 191.000	1,50 %	31.01.2022	186.255	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 184.909	3,00 %	01.09.2042	186.216	0,00 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 150.000	5,40 %	01.10.2043	185.967	0,00 %
Energy Transfer LP	\$ 150.000	7,50 %	01.07.2038	185.928	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 170.555	5,50 %	20.08.2039	185.887	0,00 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 175.000	4,50 %	01.04.2021	185.754	0,00 %
NVIDIA Corp.	\$ 185.000	3,20 %	16.09.2026	185.072	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 172.342	5,00 %	01.01.2044	185.071	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 178.919	3,50 %	01.12.2041	184.936	0,00 %
General Electric Co.	\$ 172.000	4,65 %	17.10.2021	184.287	0,00 %
Johnson & Johnson	\$ 175.000	3,63 %	03.03.2037	184.205	0,00 %
Adobe Systems, Inc. ¹	\$ 175.000	4,75 %	01.02.2020	184.199	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 172.578	4,50 %	01.03.2047	184.186	0,00 %
Dover Corp.	\$ 150.000	5,38 %	01.03.2041	183.956	0,00 %
Tapestry Inc.	\$ 180.000	4,25 %	01.04.2025	183.883	0,00 %
Interpublic Group of Cos, Inc.	\$ 175.000	4,20 %	15.04.2024	183.617	0,00 %
Commonwealth of Massachusetts	\$ 175.000	4,20 %	01.12.2021	183.509	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 181.430	4,00 %	01.10.2025	183.297	0,00 %
Liberty Mutual Insurance Co.	\$ 125.000	7,70 %	15.10.2097	183.219	0,00 %
Crane Co.	\$ 175.000	4,45 %	15.12.2023	183.142	0,00 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 175.000	3,70 %	01.02.2024	182.901	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 166.696	5,50 %	01.12.2039	182.772	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 175.000	4,00 %	15.08.2047	182.586	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 166.003	5,50 %	01.04.2034	182.199	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 176.194	3,50 %	01.12.2044	182.118	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 166.028	5,50 %	01.01.2039	182.041	0,00 %
Analog Devices, Inc.	\$ 180.000	3,50 %	05.12.2026	182.002	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 179.866	2,50 %	01.11.2027	181.575	0,00 %
Eaton Corp.	\$ 175.000	4,15 %	02.11.2042	181.536	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 170.929	4,00 %	01.11.2041	181.461	0,00 %
Mylan, Inc.	\$ 175.000	4,20 %	29.11.2023	181.435	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 169.865	4,50 %	01.03.2041	181.307	0,00 %
Apache Corp.	\$ 175.000	4,75 %	15.04.2043	181.200	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 181.535	2,49 %	25.11.2024	181.014	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anheuser-Busch Cos LLC	\$ 175.000	5,00 %	01.03.2019	180.719	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 171.167	4,00 %	01.08.2046	180.703	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 169.528	4,50 %	01.03.2044	180.580	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 186.978	2,50 %	01.10.2046	180.551	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 177.146	4,00 %	01.05.2020	180.416	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 160.288	6,00 %	01.08.2034	180.377	0,00 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	\$ 175.000	3,65 %	15.12.2025	180.184	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 170.678	4,00 %	01.10.2040	180.162	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 169.118	4,50 %	01.05.2031	179.942	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 172.579	3,50 %	01.09.2032	179.642	0,00 %
Nissan Auto Lease Trust 2017	\$ 180.000	2,05 %	15.09.2020	179.492	0,00 %
Northwell Healthcare, Inc.	\$ 175.000	4,26 %	01.11.2047	179.366	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 168.242	4,50 %	01.09.2046	179.106	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 170.458	4,00 %	15.01.2041	178.786	0,00 %
Halliburton Co.	\$ 125.000	7,45 %	15.09.2039	178.760	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 173.053	3,50 %	01.10.2043	178.495	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 177.542	3,00 %	01.12.2042	178.192	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 169.735	4,00 %	20.09.2040	178.137	0,00 %
Intel Corp.	\$ 175.000	3,15 %	11.05.2027	178.062	0,00 %
International Paper Co.	\$ 153.000	7,50 %	15.08.2021	177.995	0,00 %
Citrix Systems, Inc.	\$ 175.000	4,50 %	01.12.2027	177.844	0,00 %
Motorola Solutions, Inc.	\$ 175.000	3,75 %	15.05.2022	177.641	0,00 %
Delta Air Lines, Inc.	\$ 175.000	3,63 %	15.03.2022	177.588	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 167.539	4,00 %	01.10.2041	177.423	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 170.919	3,50 %	01.09.2029	177.199	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 175.000	3,34 %	28.03.2022	177.045	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 176.234	3,00 %	01.08.2043	177.016	0,00 %
US Treasury Note	\$ 175.000	2,75 %	15.02.2019	176.723	0,00 %
Tennessee Valley Authority	\$ 150.000	4,25 %	15.09.2065	176.634	0,00 %
NBCUniversal Media LLC	\$ 175.000	2,88 %	15.01.2023	176.557	0,00 %
Johnson & Johnson	\$ 175.000	2,95 %	03.03.2027	176.195	0,00 %
Tennessee Valley Authority	\$ 125.000	5,38 %	01.04.2056	176.101	0,00 %
Citigroup, Inc.	\$ 175.000	3,30 %	27.04.2025	175.964	0,00 %
Delta Air Lines, Inc.	\$ 175.000	2,88 %	13.03.2020	175.871	0,00 %
Mylan NV	\$ 175.000	3,15 %	15.06.2021	175.712	0,00 %
DXC Technology Co.	\$ 175.000	2,88 %	27.03.2020	175.697	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 175.000	2,30 %	15.12.2019	175.461	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 169.698	3,50 %	01.06.2026	175.421	0,00 %
Jackson National Life Global Funding	\$ 175.000	2,60 %	09.12.2020	175.249	0,00 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 175.000	2,92 %	25.10.2025	175.234	0,00 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2017	\$ 175.000	2,62 %	15.10.2025	175.226	0,00 %
Newell Brands Inc.	\$ 150.000	5,38 %	01.04.2036	175.158	0,00 %
CMS Energy Corp.	\$ 150.000	4,88 %	01.03.2044	175.099	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 174.807	3,00 %	01.01.2043	174.962	0,00 %
Branch Banking & Trust Co.	\$ 175.000	2,25 %	01.06.2020	174.803	0,00 %
Smithfield Foods, Inc.	\$ 175.000	3,35 %	01.02.2022	174.767	0,00 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 175.000	2,75 %	15.03.2023	174.704	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 175.000	1,90 %	10.05.2019	174.620	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 175.000	2,65 %	11.05.2022	174.535	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 175.000	2,20 %	11.05.2020	174.404	0,00 %
Boston Properties LP	\$ 175.000	3,20 %	15.01.2025	174.396	0,00 %
World Financial Network Credit Card Master Trust	\$ 175.000	2,31 %	15.08.2024	174.237	0,00 %
General Electric Co.	£ 100.000	5,25 %	07.12.2028	174.190	0,00 %
Citizens Bank NA	\$ 175.000	2,25 %	02.03.2020	174.085	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 175.000	2,13 %	01.05.2020	174.036	0,00 %
Intel Corp.	\$ 175.000	1,85 %	11.05.2020	174.002	0,00 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 175.000	3,95 %	01.12.2047	173.968	0,00 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 175.000	2,00 %	21.02.2020	173.771	0,00 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	\$ 175.000	2,19 %	20.11.2023	173.675	0,00 %
NetApp, Inc.	\$ 175.000	2,00 %	27.09.2019	173.543	0,00 %
American Campus Communities Operating Partnership LP	\$ 175.000	3,63 %	15.11.2027	173.417	0,00 %
Capital One Na	\$ 175.000	1,85 %	13.09.2019	173.284	0,00 %
NVIDIA Corp.	\$ 175.000	2,20 %	16.09.2021	173.245	0,00 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 175.000	2,50 %	22.08.2022	173.220	0,00 %
Honeywell International, Inc.	\$ 175.000	1,40 %	30.10.2019	173.117	0,00 %
Wells Fargo & Co.	£ 100.000	4,63 %	02.11.2035	173.055	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal National Mortgage Association	\$ 169.761	3,00 %	01.12.2031	173.028	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 162.597	4,50 %	01.07.2031	172.993	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 164.161	4,00 %	01.06.2044	172.943	0,00 %
Travelers Cos, Inc.	\$ 150.000	4,60 %	01.08.2043	172.925	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 164.983	4,00 %	20.03.2041	172.908	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 169.725	3,00 %	01.04.2035	172.807	0,00 %
GATX Corp.	\$ 175.000	3,50 %	15.03.2028	172.715	0,00 %
Honeywell International, Inc.	€ 130.000	2,25 %	22.02.2028	172.390	0,00 %
International Lease Finance Corp.	\$ 167.000	7,13 %	01.09.2018	172.219	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 171.248	2,50 %	20.06.2028	172.213	0,00 %
New Jersey Transportation Trust Fund Authority	\$ 150.000	5,75 %	15.12.2028	172.205	0,00 %
Ecolab, Inc.	\$ 162.000	4,35 %	08.12.2021	172.184	0,00 %
Amazon.com, Inc.	\$ 150.000	5,20 %	03.12.2025	172.125	0,00 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 175.000	2,45 %	01.11.2022	172.057	0,00 %
Valero Energy Corp.	\$ 150.000	4,90 %	15.03.2045	171.618	0,00 %
International Lease Finance Corp.	\$ 164.000	6,25 %	15.05.2019	171.585	0,00 %
Cargill, Inc.	\$ 145.000	4,76 %	23.11.2045	171.508	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 165.149	3,50 %	20.10.2043	171.446	0,00 %
Oracle Corp.	\$ 125.000	6,13 %	08.07.2039	171.206	0,00 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 175.000	4,20 %	01.11.2046	171.193	0,00 %
Johnson & Johnson	\$ 150.000	4,38 %	05.12.2033	170.969	0,00 %
Amgen, Inc.	£ 100.000	5,50 %	07.12.2026	170.953	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 164.633	3,50 %	20.09.2043	170.907	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 150.000	4,75 %	21.10.2045	170.876	0,00 %
Norfolk Southern Corp.	\$ 150.000	4,65 %	15.01.2046	170.655	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 158.164	5,00 %	01.03.2038	170.512	0,00 %
Wyeth LLC	\$ 125.000	6,50 %	01.02.2034	170.363	0,00 %
NiSource Finance Corp.	\$ 150.000	4,80 %	15.02.2044	170.286	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 170.367	2,50 %	01.08.2031	170.175	0,00 %
Rockwell Collins, Inc.	\$ 170.000	2,80 %	15.03.2022	170.166	0,00 %
Cigna Corp.	\$ 140.000	5,38 %	15.02.2042	169.882	0,00 %
MetLife, Inc.	\$ 125.000	6,38 %	15.06.2034	169.781	0,00 %
Johnson & Johnson	\$ 125.000	5,85 %	15.07.2038	169.686	0,00 %
Wells Fargo & Co.	\$ 150.000	4,90 %	17.11.2045	169.676	0,00 %
Northern States Power Co.	\$ 125.000	6,20 %	01.07.2037	169.529	0,00 %
Travelers Cos, Inc.	\$ 125.000	6,25 %	15.06.2037	169.275	0,00 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	£ 120.000	2,88 %	20.11.2020	169.179	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 166.631	3,00 %	15.09.2042	168.978	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 161.404	4,00 %	15.05.2046	168.745	0,00 %
Arizona Public Service Co.	\$ 150.000	4,50 %	01.04.2042	168.736	0,00 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 125.000	6,38 %	16.05.2038	168.559	0,00 %
Puget Sound Energy, Inc.	\$ 125.000	6,27 %	15.03.2037	168.235	0,00 %
Federal National Mortgage Association [^]	\$ 175.000	2,42 %	25.10.2026	168.142	0,00 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	\$ 150.000	4,50 %	01.02.2045	168.100	0,00 %
Precision Castparts Corp.	\$ 150.000	4,38 %	15.06.2045	167.910	0,00 %
Estee Lauder Cos, Inc.	\$ 150.000	4,38 %	15.06.2045	167.810	0,00 %
HCP, Inc.	\$ 156.000	5,38 %	01.02.2021	167.550	0,00 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 175.000	2,50 %	15.04.2026	167.446	0,00 %
General Dynamics Corp.	\$ 175.000	1,88 %	15.08.2023	167.214	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 167.216	2,50 %	01.12.2030	167.028	0,00 %
Pfizer, Inc.	\$ 150.000	4,30 %	15.06.2043	166.767	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 156.308	4,50 %	20.10.2041	166.703	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 156.249	4,50 %	01.02.2046	166.698	0,00 %
Eaton Capital Unlimited Co.	€ 141.000	0,75 %	20.09.2024	166.687	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 159.985	3,50 %	20.07.2026	166.384	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 155.875	4,50 %	01.07.2041	166.353	0,00 %
US Treasury Note	\$ 170.000	1,38 %	30.04.2021	166.308	0,00 %
Merck & Co., Inc.	\$ 150.000	4,15 %	18.05.2043	166.202	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 170.636	2,00 %	01.08.2031	166.184	0,00 %
United Technologies Corp.	\$ 125.000	6,13 %	15.07.2038	166.091	0,00 %
US Treasury Bond	\$ 125.000	7,50 %	15.11.2024	165.957	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 160.156	3,50 %	01.12.2028	165.694	0,00 %
General Electric Co.	\$ 115.000	6,88 %	10.01.2039	165.384	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 155.535	4,50 %	01.05.2044	165.339	0,00 %
Connecticut Light & Power Co.	\$ 150.000	4,15 %	01.06.2045	165.301	0,00 %
PPL Electric Utilities Corp.	\$ 150.000	4,13 %	15.06.2044	165.158	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Westar Energy, Inc.	\$ 150.000	4,25 %	01.12.2045	165.007	0,00 %
Moody's Corp.	\$ 150.000	4,88 %	15.02.2024	164.863	0,00 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	\$ 125.000	5,75 %	15.01.2040	164.656	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 158.050	3,50 %	01.08.2032	164.537	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 155.236	4,00 %	01.03.2042	164.392	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 159.532	3,50 %	01.04.2046	163.928	0,00 %
MetLife, Inc.	\$ 125.000	5,88 %	06.02.2041	163.871	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 168.322	2,50 %	01.01.2043	163.823	0,00 %
Motorola Solutions, Inc.	\$ 160.000	4,00 %	01.09.2024	163.807	0,00 %
Tyson Foods, Inc.	\$ 150.000	4,55 %	02.06.2047	163.535	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 162.615	3,00 %	01.02.2044	163.338	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 158.824	3,50 %	01.07.2044	163.180	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 159.615	3,00 %	20.07.2029	163.123	0,00 %
McDonald's Corp.	\$ 150.000	4,45 %	01.03.2047	163.083	0,00 %
Johnson Controls International plc	\$ 150.000	4,50 %	15.02.2047	162.739	0,00 %
Apache Finance Canada Corp.	\$ 125.000	7,75 %	15.12.2029	162.712	0,00 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 150.000	6,88 %	15.11.2019	162.541	0,00 %
Harley-Davidson, Inc.	\$ 150.000	4,63 %	28.07.2045	162.532	0,00 %
Protective Life Corp.	\$ 150.000	7,38 %	15.10.2019	162.468	0,00 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates	\$ 160.000	3,12 %	25.06.2027	162.451	0,00 %
Bank of America Corp. ^	CAD 200.000	3,41 %	20.09.2025	162.393	0,00 %
Bunge Ltd. Finance Corp.	\$ 150.000	8,50 %	15.06.2019	162.391	0,00 %
Aon plc	\$ 150.000	4,60 %	14.06.2044	162.133	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 161.290	3,00 %	01.11.2043	162.007	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 150.512	5,00 %	01.02.2041	161.918	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 156.401	3,50 %	01.05.2042	161.657	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 161.669	2,50 %	01.03.2032	161.486	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 152.944	4,00 %	01.06.2034	161.480	0,00 %
Johns Hopkins University	\$ 150.000	4,08 %	01.07.2053	161.463	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 151.133	4,50 %	01.09.2041	161.387	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 155.785	3,50 %	01.03.2041	161.335	0,00 %
Southern California Edison Co.	\$ 150.000	4,00 %	01.04.2047	161.250	0,00 %
Target Corp.	\$ 160.000	2,30 %	26.06.2019	160.457	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 160.233	3,00 %	01.08.2045	160.350	0,00 %
Forest Laboratories LLC	\$ 150.000	5,00 %	15.12.2021	160.259	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 143.025	6,00 %	01.07.2033	160.207	0,00 %
EQT Corp.	\$ 150.000	4,88 %	15.11.2021	160.051	0,00 %
Welltower, Inc.	\$ 150.000	4,50 %	15.01.2024	159.989	0,00 %
MidAmerican Energy Co.	\$ 150.000	3,95 %	01.08.2047	159.965	0,00 %
Boston Scientific Corp.	\$ 150.000	6,00 %	15.01.2020	159.946	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 151.032	4,00 %	01.03.2031	159.945	0,00 %
City of Chicago II	\$ 150.000	6,31 %	01.01.2044	159.862	0,00 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 150.000	5,00 %	01.10.2021	159.806	0,00 %
Columbia Pipeline Group, Inc.	\$ 150.000	4,50 %	01.06.2025	159.769	0,00 %
NiSource Finance Corp.	\$ 125.000	5,95 %	15.06.2041	159.762	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 165.303	2,50 %	01.10.2046	159.746	0,00 %
MetLife, Inc.	\$ 140.000	4,60 %	13.05.2046	159.581	0,00 %
Host Hotels & Resorts LP	\$ 150.000	4,75 %	01.03.2023	159.544	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 125.000	5,85 %	15.03.2036	159.321	0,00 %
Wells Fargo Bank NA	£ 100.000	5,25 %	01.08.2023	159.220	0,00 %
General Electric Co.	\$ 150.000	5,50 %	08.01.2020	159.213	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 157.685	2,50 %	01.10.2027	159.182	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 147.545	5,00 %	15.04.2041	159.150	0,00 %
Children's Hospital Corp.	\$ 150.000	4,12 %	01.01.2047	158.976	0,00 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	\$ 150.000	4,40 %	01.06.2043	158.925	0,00 %
Appalachian Power Co.	\$ 150.000	4,60 %	30.03.2021	158.857	0,00 %
Welltower, Inc.	£ 100.000	4,80 %	20.11.2028	158.776	0,00 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	\$ 150.000	4,25 %	17.01.2023	158.745	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 150.969	4,00 %	01.09.2043	158.472	0,00 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	\$ 150.000	4,25 %	15.01.2021	158.320	0,00 %
Oglethorpe Power Corp.	\$ 125.000	5,95 %	01.11.2039	158.268	0,00 %
US Treasury Note	\$ 159.000	1,75 %	31.10.2020	158.106	0,00 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 150.000	4,25 %	15.03.2046	157.953	0,00 %
Avnet, Inc.	\$ 150.000	4,88 %	01.12.2022	157.881	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 140.866	6,00 %	01.02.2034	157.839	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 150.000	3,95 %	01.03.2043	157.773	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Southern California Edison Co.	\$ 125.000	5,63 %	01.02.2036	157.771	0,00 %
Federal Home Loan Banks	\$ 150.000	5,13 %	15.08.2019	157.644	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 156.863	3,00 %	01.08.2043	157.560	0,00 %
Kilroy Realty LP	\$ 150.000	4,38 %	01.10.2025	157.432	0,00 %
General Motors Co.	\$ 150.000	5,20 %	01.04.2045	157.290	0,00 %
Caterpillar, Inc.	\$ 150.000	3,90 %	27.05.2021	157.178	0,00 %
NVR, Inc.	\$ 150.000	3,95 %	15.09.2022	156.972	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 150.000	4,08 %	25.11.2020	156.799	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 146.440	5,00 %	20.07.2034	156.760	0,00 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 125.000	5,00 %	25.10.2040	156.699	0,00 %
Entergy Corp.	\$ 150.000	4,00 %	15.07.2022	156.671	0,00 %
International Flavors & Fragrances, Inc.	\$ 148.000	4,38 %	01.06.2047	156.648	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	CAD 200.000	2,43 %	26.04.2023	156.595	0,00 %
Southern Natural Gas Co. LLC/Southern Natural Issuing Corp.	\$ 150.000	4,40 %	15.06.2021	156.484	0,00 %
Prologis International Funding II SA	€ 125.000	1,88 %	17.04.2025	156.478	0,00 %
Verisk Analytics, Inc.	\$ 150.000	4,13 %	12.09.2022	156.429	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 155.885	3,00 %	01.10.2045	156.264	0,00 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 150.000	4,35 %	17.01.2027	155.974	0,00 %
Sysco Corp.	\$ 150.000	3,75 %	01.10.2025	155.881	0,00 %
American International Group, Inc.	£ 100.000	5,00 %	26.04.2023	155.860	0,00 %
Southern California Gas Co.	\$ 150.000	3,75 %	15.09.2042	155.813	0,00 %
Avnet, Inc.	\$ 150.000	4,63 %	15.04.2026	155.748	0,00 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 150.000	3,68 %	15.12.2050	155.742	0,00 %
CNH Industrial Capital LLC	\$ 150.000	4,38 %	06.11.2020	155.625	0,00 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 150.000	5,13 %	01.04.2019	155.290	0,00 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016	\$ 150.000	3,62 %	10.02.2049	155.199	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 144.000	5,00 %	01.08.2040	155.108	0,00 %
Roper Technologies, Inc.	\$ 150.000	3,85 %	15.12.2025	154.936	0,00 %
Welltower, Inc.	\$ 150.000	4,00 %	01.06.2025	154.910	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 151.999	3,00 %	01.10.2026	154.882	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 150.000	3,58 %	15.10.2050	154.788	0,00 %
Humana, Inc.	\$ 150.000	3,95 %	15.03.2027	154.615	0,00 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 150.000	3,50 %	01.02.2025	154.608	0,00 %
Colgate-Palmolive Co.	\$ 150.000	3,25 %	15.03.2024	154.552	0,00 %
Republic Services, Inc.	\$ 150.000	3,55 %	01.06.2022	154.543	0,00 %
Bank 2018-BNK ³	\$ 150.000	3,54 %	15.11.2054	154.515	0,00 %
Cboe Global Markets Inc.	\$ 150.000	3,65 %	12.01.2027	154.502	0,00 %
Consumers Energy Co.	\$ 150.000	3,38 %	15.08.2023	154.414	0,00 %
Fiserv, Inc.	\$ 150.000	3,50 %	01.10.2022	154.397	0,00 %
Stryker Corp.	\$ 150.000	3,38 %	15.05.2024	154.337	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	£ 100.000	4,25 %	29.01.2026	154.140	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 142.786	5,00 %	01.05.2035	154.060	0,00 %
Marriott International, Inc.	\$ 150.000	3,75 %	15.03.2025	154.052	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 144.413	4,50 %	20.06.2041	154.021	0,00 %
Bank 2018-BNK ³	\$ 150.000	3,49 %	15.11.2050	153.883	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 150.000	3,75 %	25.02.2026	153.875	0,00 %
Duke Energy Corp.	\$ 150.000	3,95 %	15.08.2047	153.873	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 147.509	3,50 %	01.08.2031	153.837	0,00 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 150.000	3,56 %	15.10.2050	153.816	0,00 %
Nasdaq, Inc.	\$ 150.000	3,85 %	30.06.2026	153.795	0,00 %
CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust	\$ 150.000	3,46 %	15.11.2050	153.756	0,00 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 150.000	3,49 %	15.08.2050	153.749	0,00 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 150.000	3,47 %	12.10.2050	153.592	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 139.869	5,50 %	01.12.2035	153.573	0,00 %
Allergan Funding SCS	\$ 150.000	3,85 %	15.06.2024	153.521	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 143.456	4,50 %	01.02.2041	153.494	0,00 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 150.000	3,50 %	06.06.2022	153.492	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 148.336	4,00 %	01.06.2025	153.358	0,00 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 150.000	4,40 %	13.07.2027	153.346	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 149.134	3,50 %	01.05.2045	153.252	0,00 %
JM Smucker Co.	\$ 150.000	3,50 %	15.03.2025	153.213	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 148.815	3,50 %	01.11.2045	153.122	0,00 %
Digital Realty Trust LP	\$ 150.000	3,40 %	01.10.2020	153.039	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 150.000	3,75 %	15.10.2047	152.877	0,00 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 150.000	3,50 %	01.03.2021	152.856	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 152.343	3,00 %	01.12.2042	152.832	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Appalachian Power Co.	\$ 150.000	3,40 %	01.06.2025	152.812	0,00 %
Enable Midstream Partners LP	\$ 150.000	4,40 %	15.03.2027	152.784	0,00 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	\$ 150.000	4,50 %	15.12.2026	152.715	0,00 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 100.000	8,15 %	17.10.2036	152.636	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 145.389	4,00 %	15.01.2041	152.498	0,00 %
Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri	\$ 150.000	3,65 %	15.08.2057	152.453	0,00 %
Realty Income Corp.	\$ 150.000	3,25 %	15.10.2022	152.428	0,00 %
Verizon Communications, Inc.	£ 100.000	4,07 %	18.06.2024	152.289	0,00 %
Eli Lilly & Co.	\$ 150.000	3,10 %	15.05.2027	152.141	0,00 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 150.000	3,50 %	15.06.2025	152.120	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 151.062	3,00 %	01.11.2042	152.036	0,00 %
Kroger Co.	\$ 150.000	2,95 %	01.11.2021	151.654	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 150.000	2,70 %	15.07.2020	151.545	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 151.118	3,00 %	01.11.2045	151.462	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 146.037	3,50 %	01.09.2025	151.394	0,00 %
Bayer US Finance LLC	\$ 150.000	3,00 %	08.10.2021	151.388	0,00 %
Bank 2018-BNK [®]	\$ 150.000	3,28 %	15.11.2054	151.275	0,00 %
Juniper Networks, Inc.	\$ 150.000	3,30 %	15.06.2020	151.199	0,00 %
Motorola Solutions, Inc.	\$ 150.000	5,50 %	01.09.2044	151.179	0,00 %
Procter & Gamble Co.	\$ 150.000	3,50 %	25.10.2047	151.001	0,00 %
Intel Corp.	\$ 150.000	2,88 %	11.05.2024	150.996	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 135.750	6,50 %	01.11.2036	150.994	0,00 %
Coca-Cola Co.	\$ 150.000	2,45 %	01.11.2020	150.984	0,00 %
SunTrust Banks, Inc.	\$ 150.000	2,90 %	03.03.2021	150.892	0,00 %
TD Ameritrade Holding Corp.	\$ 150.000	3,30 %	01.04.2027	150.775	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 125.000	5,30 %	01.03.2035	150.701	0,00 %
AXIS Specialty Finance plc	\$ 150.000	4,00 %	06.12.2027	150.675	0,00 %
Simon Property Group LP	\$ 150.000	3,38 %	01.12.2027	150.635	0,00 %
Union Pacific Corp.	\$ 150.000	3,38 %	01.02.2035	150.614	0,00 %
Protective Life Global Funding	\$ 150.000	2,70 %	25.11.2020	150.460	0,00 %
International Lease Finance Corp.	\$ 131.000	8,25 %	15.12.2020	150.322	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 143.274	4,00 %	15.10.2041	150.282	0,00 %
Danaher Corp.	\$ 150.000	2,40 %	15.09.2020	150.275	0,00 %
Arizona Public Service Co.	\$ 150.000	3,15 %	15.05.2025	150.247	0,00 %
Eli Lilly & Co.	\$ 145.000	3,70 %	01.03.2045	150.214	0,00 %
LYB International Finance II BV	\$ 150.000	3,50 %	02.03.2027	150.188	0,00 %
CD Mortgage Trust 2017	\$ 144.000	3,63 %	10.02.2050	150.172	0,00 %
CenterPoint Energy Houston Electric LLC	\$ 150.000	3,55 %	01.08.2042	150.150	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 141.594	4,00 %	01.01.2041	150.089	0,00 %
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 150.000	2,50 %	03.12.2020	150.087	0,00 %
Molex Electronic Technologies LLC	\$ 150.000	2,88 %	15.04.2020	150.059	0,00 %
USAA Capital Corp.	\$ 150.000	2,45 %	01.08.2020	150.003	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 150.000	2,85 %	25.01.2026	149.967	0,00 %
Starbucks Corp.	\$ 150.000	2,20 %	22.11.2020	149.961	0,00 %
Discover Card Execution Note Trust	\$ 150.000	2,19 %	17.04.2023	149.940	0,00 %
Interstate Power & Light Co.	\$ 150.000	3,70 %	15.09.2046	149.895	0,00 %
American Express Credit Corp.	\$ 150.000	2,38 %	26.05.2020	149.880	0,00 %
Brixmor Operating Partnership LP	\$ 150.000	3,85 %	01.02.2025	149.863	0,00 %
Chase Issuance Trust	\$ 150.000	1,36 %	15.04.2020	149.846	0,00 %
Aviation Capital Group LLC	\$ 150.000	2,88 %	20.01.2022	149.716	0,00 %
Massachusetts Mutual Life Insurance Co.	\$ 91.000	8,88 %	01.06.2039	149.711	0,00 %
CSX Corp.	\$ 150.000	3,25 %	01.06.2027	149.702	0,00 %
Procter & Gamble Co.	\$ 150.000	1,90 %	01.11.2019	149.669	0,00 %
Sysco Corp.	\$ 150.000	1,90 %	01.04.2019	149.608	0,00 %
Kilroy Realty LP	\$ 150.000	3,45 %	15.12.2024	149.589	0,00 %
Delta Air Lines, Inc.	\$ 150.000	2,60 %	04.12.2020	149.567	0,00 %
Procter & Gamble Co.	\$ 150.000	1,75 %	25.10.2019	149.565	0,00 %
Georgia Power Co.	\$ 150.000	2,40 %	01.04.2021	149.557	0,00 %
Simon Property Group LP	\$ 150.000	2,75 %	01.06.2023	149.515	0,00 %
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A	\$ 150.000	1,76 %	15.02.2021	149.508	0,00 %
Walt Disney Co.	\$ 150.000	1,85 %	30.05.2019	149.496	0,00 %
Charles Schwab Corp.	\$ 150.000	2,65 %	25.01.2023	149.485	0,00 %
Protective Life Global Funding	\$ 150.000	2,26 %	08.04.2020	149.482	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 150.000	1,55 %	08.02.2019	149.475	0,00 %
AutoZone, Inc.	\$ 150.000	3,25 %	15.04.2025	149.470	0,00 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 150.000	2,43 %	15.01.2025	149.439	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 150.000	2,95 %	15.10.2027	149.435	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 150.000	2,75 %	25.01.2026	149.407	0,00 %
Eli Lilly & Co.	\$ 150.000	2,35 %	15.05.2022	149.351	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 139.136	4,50 %	20.07.2039	149.349	0,00 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 150.000	2,00 %	17.01.2023	149.250	0,00 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 150.000	2,35 %	16.05.2022	149.228	0,00 %
Lazard Group LLC	\$ 150.000	3,63 %	01.03.2027	149.191	0,00 %
Fortive Corp.	\$ 150.000	3,15 %	15.06.2026	149.178	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 137.855	4,50 %	01.03.2039	149.161	0,00 %
Merck & Co., Inc.	\$ 150.000	1,85 %	10.02.2020	149.143	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 142.566	4,00 %	01.07.2047	149.137	0,00 %
Intel Corp.	\$ 150.000	2,35 %	11.05.2022	149.107	0,00 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 150.000	2,71 %	06.03.2025	149.104	0,00 %
Cardinal Health, Inc.	\$ 150.000	1,95 %	14.06.2019	149.097	0,00 %
American Tower Corp.	\$ 150.000	3,60 %	15.01.2028	149.085	0,00 %
AvalonBay Communities, Inc.	\$ 150.000	3,20 %	15.01.2028	149.052	0,00 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 150.000	2,05 %	01.04.2021	148.998	0,00 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 150.000	2,40 %	06.06.2022	148.971	0,00 %
Select Income	\$ 150.000	4,25 %	15.05.2024	148.966	0,00 %
Exelon Corp.	\$ 150.000	2,45 %	15.04.2021	148.944	0,00 %
AmerisourceBergen Corp.	\$ 150.000	3,45 %	15.12.2027	148.941	0,00 %
Smithfield Foods, Inc.	\$ 150.000	2,70 %	31.01.2020	148.941	0,00 %
EQT Corp.	\$ 150.000	3,90 %	01.10.2027	148.739	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 141.427	4,00 %	15.08.2039	148.727	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 150.000	1,95 %	15.10.2020	148.629	0,00 %
Sempra Energy	\$ 150.000	3,25 %	15.06.2027	148.618	0,00 %
Chase Issuance Trust	\$ 150.000	1,37 %	15.06.2021	148.546	0,00 %
Altria Group, Inc.	\$ 150.000	3,88 %	16.09.2046	148.485	0,00 %
Public Service Enterprise Group, Inc.	\$ 150.000	2,65 %	15.11.2022	148.476	0,00 %
BB&T Corp.	\$ 150.000	2,15 %	01.02.2021	148.459	0,00 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 150.000	1,34 %	15.04.2022	148.419	0,00 %
Johnson & Johnson	\$ 150.000	2,63 %	15.01.2025	148.378	0,00 %
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 150.000	1,55 %	13.09.2019	148.353	0,00 %
CSX Corp.	\$ 150.000	3,95 %	01.05.2050	148.285	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 147.406	2,50 %	01.05.2027	148.284	0,00 %
United Technologies Corp.	\$ 150.000	1,50 %	01.11.2019	148.226	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 145.746	3,00 %	01.06.2035	148.214	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 141.679	4,00 %	01.01.2046	148.177	0,00 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 150.000	1,33 %	15.06.2022	148.141	0,00 %
Martin Marietta Materials, Inc.	\$ 150.000	3,45 %	01.06.2027	148.044	0,00 %
Crown Castle International Corp.	\$ 150.000	3,20 %	01.09.2024	148.003	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 147.347	3,00 %	01.10.2042	148.002	0,00 %
Priceline Group, Inc.	\$ 150.000	2,75 %	15.03.2023	147.812	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 147.655	3,00 %	01.08.2046	147.763	0,00 %
Emerson Electric Co.	\$ 125.000	5,25 %	15.11.2039	147.752	0,00 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 150.000	2,38 %	17.08.2022	147.734	0,00 %
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 150.000	3,00 %	19.09.2027	147.700	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 145.856	3,00 %	20.09.2044	147.683	0,00 %
Cardinal Health, Inc.	\$ 150.000	3,08 %	15.06.2024	147.620	0,00 %
Pricoa Global Funding I	\$ 150.000	1,45 %	13.09.2019	147.614	0,00 %
Corning, Inc.	\$ 150.000	4,38 %	15.11.2057	147.534	0,00 %
Piedmont Natural Gas Co., Inc.	\$ 150.000	3,64 %	01.11.2046	147.524	0,00 %
Allegion US Holding Co., Inc.	\$ 150.000	3,55 %	01.10.2027	147.510	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 150.000	2,15 %	25.01.2023	147.450	0,00 %
CBS Corp.	\$ 150.000	2,90 %	01.06.2023	147.375	0,00 %
Eaton Corp.	\$ 150.000	3,10 %	15.09.2027	147.332	0,00 %
Owens Corning	\$ 150.000	3,40 %	15.08.2026	147.305	0,00 %
American Tower Corp.	\$ 150.000	3,38 %	15.10.2026	147.090	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 139.786	4,00 %	01.11.2041	147.048	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 141.965	3,50 %	01.11.2044	146.737	0,00 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 150.000	2,75 %	25.02.2026	146.726	0,00 %
General Dynamics Corp.	\$ 150.000	2,38 %	15.11.2024	146.361	0,00 %
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 150.000	1,95 %	15.09.2021	146.348	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 136.475	5,00 %	01.03.2041	146.209	0,00 %
GS Mortgage Securities Trust 2016	\$ 150.000	2,85 %	10.10.2049	146.151	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 141.982	3,50 %	01.02.2044	146.145	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Bank One Capital III	\$ 100.000	8,75 %	01.09.2030	146.133	0,00 %
District of Columbia Water & Sewer Authority	\$ 125.000	4,81 %	01.10.2114	146.120	0,00 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	\$ 150.000	2,95 %	19.09.2026	146.111	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 146.201	2,50 %	01.11.2031	146.036	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 146.125	2,50 %	01.12.2030	146.027	0,00 %
Microsoft Corp.	€ 100.000	3,13 %	06.12.2028	145.615	0,00 %
Ukraine Government AID Bonds	\$ 150.000	1,47 %	29.09.2021	145.468	0,00 %
Duke Energy Corp.	\$ 125.000	4,80 %	15.12.2045	145.365	0,00 %
Target Corp.	\$ 100.000	7,00 %	15.01.2038	145.254	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 133.780	5,00 %	15.11.2034	145.073	0,00 %
Abbott Laboratories	\$ 125.000	5,30 %	27.05.2040	144.954	0,00 %
Brown-Forman Corp.	€ 120.000	1,20 %	07.07.2026	144.923	0,00 %
Southwest Airlines Co.	\$ 150.000	3,00 %	15.11.2026	144.828	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 139.974	3,50 %	01.01.2042	144.671	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 133.886	5,00 %	15.03.2039	144.410	0,00 %
Johnson & Johnson	\$ 125.000	4,50 %	01.09.2040	144.360	0,00 %
Home Depot, Inc.	\$ 150.000	3,50 %	15.09.2056	143.753	0,00 %
Metropolitan Life Global Funding I	€ 100.000	2,88 %	11.01.2023	143.570	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 135.315	4,00 %	01.04.2031	143.412	0,00 %
Bristol-Myers Squibb Co.	\$ 125.000	4,50 %	01.03.2044	143.408	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 131.021	5,50 %	01.12.2036	143.358	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 133.949	4,50 %	01.03.2042	143.070	0,00 %
Viacom, Inc.	\$ 125.000	6,88 %	30.04.2036	143.052	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 133.498	5,00 %	20.05.2042	142.787	0,00 %
Tosco Corp.	\$ 100.000	8,13 %	15.02.2030	142.713	0,00 %
NIKE, Inc.	\$ 150.000	2,38 %	01.11.2026	142.611	0,00 %
Philip Morris International, Inc.	€ 100.000	3,13 %	03.06.2033	142.527	0,00 %
GE Capital UK Funding Unlimited Co.	£ 100.000	4,38 %	31.07.2019	142.244	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 129.806	5,50 %	01.12.2034	142.007	0,00 %
Boston Properties LP	\$ 150.000	2,75 %	01.10.2026	141.644	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 133.636	4,50 %	15.07.2040	141.566	0,00 %
Coca-Cola Co.	€ 130.000	1,10 %	02.09.2036	141.396	0,00 %
Prudential Financial, Inc.	\$ 100.000	6,63 %	21.06.2040	141.036	0,00 %
Humana, Inc.	\$ 125.000	4,80 %	15.03.2047	140.888	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 132.589	4,00 %	01.06.2031	140.507	0,00 %
General Dynamics Corp.	\$ 150.000	2,13 %	15.08.2026	140.485	0,00 %
Citigroup, Inc.	£ 100.000	5,13 %	12.12.2018	140.443	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 127.736	5,50 %	01.06.2038	140.440	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 133.876	4,00 %	15.10.2041	140.424	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 135.981	3,50 %	01.09.2044	140.344	0,00 %
Citigroup, Inc.	\$ 140.000	2,70 %	30.03.2021	140.247	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 133.514	4,00 %	01.05.2042	140.123	0,00 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	\$ 150.000	4,70 %	15.06.2044	140.033	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 130.825	5,00 %	20.02.2044	139.457	0,00 %
General Electric Co.	\$ 130.000	5,55 %	04.05.2020	139.186	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 100.000	6,38 %	24.07.2042	138.973	0,00 %
US Treasury Note	\$ 140.000	1,13 %	28.02.2019	138.863	0,00 %
Simon Property Group LP	\$ 100.000	6,75 %	01.02.2040	138.722	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 131.212	4,00 %	15.09.2044	138.646	0,00 %
Brown-Forman Corp.	£ 100.000	2,60 %	07.07.2028	138.608	0,00 %
Georgia Power Co.	\$ 125.000	4,75 %	01.09.2040	138.605	0,00 %
Voya Financial, Inc.	\$ 125.000	4,80 %	15.06.2046	138.419	0,00 %
Wells Fargo & Co.	€ 100.000	2,13 %	22.04.2022	138.413	0,00 %
Lincoln National Corp.	\$ 100.000	7,00 %	15.06.2040	138.390	0,00 %
American Water Capital Corp.	\$ 125.000	4,30 %	01.09.2045	138.159	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 127.386	4,50 %	01.02.2040	138.013	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 124.561	5,50 %	15.10.2039	137.978	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 124.932	5,50 %	15.06.2033	137.933	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 137.356	2,50 %	01.09.2030	137.708	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 128.491	5,00 %	01.04.2040	137.692	0,00 %
Intel Corp.	\$ 125.000	4,00 %	15.12.2032	137.676	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 100.000	7,25 %	01.04.2032	137.613	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 127.531	5,00 %	01.03.2034	137.480	0,00 %
Tyco Electronics Group SA	€ 112.000	1,10 %	01.03.2023	137.458	0,00 %
Host Hotels & Resorts LP	\$ 125.000	6,00 %	01.10.2021	137.322	0,00 %
AbbVie, Inc.	\$ 125.000	4,50 %	14.05.2035	137.321	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal National Mortgage Association	\$ 137.202	3,00 %	01.11.2042	137.302	0,00 %
Transatlantic Holdings, Inc.	\$ 100.000	8,00 %	30.11.2039	137.279	0,00 %
Royal Caribbean Cruises Ltd.	\$ 125.000	5,25 %	15.11.2022	137.188	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 135.000	3,13 %	25.06.2021	137.176	0,00 %
Reynolds American, Inc.	\$ 125.000	6,88 %	01.05.2020	137.081	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 100.000	6,40 %	15.05.2038	137.060	0,00 %
American International Group, Inc.^	\$ 100.000	8,18 %	15.05.2058	137.041	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 130.969	4,00 %	01.08.2045	136.954	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 133.165	3,50 %	01.09.2046	136.834	0,00 %
Phillips 66	\$ 125.000	4,65 %	15.11.2034	136.775	0,00 %
Johnson & Johnson	\$ 100.000	5,95 %	15.08.2037	136.743	0,00 %
Target Corp.	\$ 100.000	6,50 %	15.10.2037	136.569	0,00 %
Dominion Energy Gas Holdings LLC	\$ 125.000	4,60 %	15.12.2044	136.563	0,00 %
New York City Water & Sewer System	\$ 100.000	5,75 %	15.06.2041	136.516	0,00 %
Morgan Stanley	€ 100.000	5,38 %	10.08.2020	136.508	0,00 %
Florida Power & Light Co.	\$ 100.000	5,96 %	01.04.2039	136.396	0,00 %
Florida Power & Light Co.	\$ 125.000	4,05 %	01.06.2042	136.354	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 134.320	3,00 %	15.05.2043	136.214	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 129.844	4,00 %	15.12.2040	136.192	0,00 %
Dallas Convention Center Hotel Development Corp.	\$ 100.000	7,09 %	01.01.2042	135.862	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 125.000	4,25 %	15.01.2033	135.836	0,00 %
Home Depot, Inc.	\$ 120.000	4,40 %	15.03.2045	135.809	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 127.866	4,50 %	15.07.2039	135.626	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 129.977	3,50 %	01.08.2032	135.225	0,00 %
Apache Corp.	\$ 125.000	5,10 %	01.09.2040	135.200	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 122.712	5,50 %	01.02.2035	134.725	0,00 %
AT&T, Inc.	€ 100.000	3,55 %	17.12.2032	134.668	0,00 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 135.000	2,08 %	15.03.2023	134.662	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 124.425	5,50 %	20.05.2036	134.639	0,00 %
Northwestern Mutual Life Insurance Co.	\$ 100.000	6,06 %	30.03.2040	134.427	0,00 %
Unum Group	\$ 125.000	5,63 %	15.09.2020	134.423	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 125.000	4,88 %	01.11.2022	134.395	0,00 %
Valero Energy Corp.	\$ 125.000	6,13 %	01.02.2020	134.119	0,00 %
Kroger Co.	\$ 125.000	6,15 %	15.01.2020	134.095	0,00 %
Parker-Hannifin Corp.	\$ 125.000	4,10 %	01.03.2047	134.014	0,00 %
Home Depot, Inc.	\$ 100.000	5,95 %	01.04.2041	133.863	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 127.620	4,00 %	01.02.2026	133.850	0,00 %
Prudential Financial, Inc.	\$ 125.000	5,38 %	21.06.2020	133.640	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 118.215	6,00 %	15.12.2039	133.566	0,00 %
Life Technologies Corp.	\$ 125.000	6,00 %	01.03.2020	133.492	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	€ 100.000	2,75 %	01.02.2023	133.490	0,00 %
Halliburton Co.	\$ 100.000	6,70 %	15.09.2038	133.447	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 127.083	4,00 %	01.12.2040	133.438	0,00 %
MetLife Capital Trust IV	\$ 100.000	7,88 %	15.12.2037	133.375	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 123.075	4,50 %	01.12.2043	133.365	0,00 %
Aon plc	€ 100.000	2,88 %	14.05.2026	133.349	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 125.000	7,30 %	13.05.2019	133.264	0,00 %
Charles Schwab Corp.	\$ 130.000	3,45 %	13.02.2026	133.204	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 128.773	3,50 %	01.09.2042	133.109	0,00 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 125.000	5,25 %	01.10.2020	133.000	0,00 %
Wyeth LLC	\$ 100.000	6,00 %	15.02.2036	132.947	0,00 %
Aspen Insurance Holdings Ltd.	\$ 125.000	4,65 %	15.11.2023	132.732	0,00 %
McDonald's Corp.	\$ 100.000	6,30 %	15.10.2037	132.642	0,00 %
Citigroup, Inc.	\$ 125.000	4,60 %	09.03.2026	132.562	0,00 %
South Carolina Electric & Gas Co.	\$ 130.000	4,10 %	15.06.2046	132.556	0,00 %
Hartford Financial Services Group, Inc.	\$ 100.000	6,10 %	01.10.2041	132.303	0,00 %
NBCUniversal Media LLC	\$ 125.000	4,38 %	01.04.2021	132.278	0,00 %
Aetna, Inc.	\$ 100.000	6,63 %	15.06.2036	132.252	0,00 %
Quest Diagnostics, Inc.	\$ 125.000	4,70 %	01.04.2021	132.214	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 125.000	7,50 %	15.02.2019	132.144	0,00 %
Fifth Third Bancorp	\$ 125.000	4,30 %	16.01.2024	132.097	0,00 %
Wells Fargo & Co.	€ 100.000	2,63 %	16.08.2022	132.066	0,00 %
Simon Property Group LP	\$ 125.000	4,38 %	01.03.2021	132.059	0,00 %
QVC, Inc.	\$ 125.000	5,13 %	02.07.2022	132.028	0,00 %
Phillips 66	\$ 125.000	4,30 %	01.04.2022	132.015	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 127.797	3,50 %	01.12.2042	131.811	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 117.296	6,00 %	01.05.2040	131.744	0,00 %
Keysight Technologies, Inc.	\$ 125.000	4,60 %	06.04.2027	131.694	0,00 %
Kroger Co.	\$ 100.000	7,50 %	01.04.2031	131.636	0,00 %
Bank of America Corp.	€ 100.000	2,38 %	19.06.2024	131.625	0,00 %
HP, Inc.	\$ 125.000	4,38 %	15.09.2021	131.623	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 125.000	5,70 %	01.07.2019	131.448	0,00 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 100.000	6,00 %	15.05.2037	131.370	0,00 %
Bank of America Corp.	\$ 100.000	5,88 %	07.02.2042	131.320	0,00 %
DDR Corp.	\$ 125.000	4,63 %	15.07.2022	131.303	0,00 %
Commercial Mortgage Pass Through Certificates	\$ 125.000	3,76 %	10.02.2049	131.289	0,00 %
Illinois Tool Works, Inc.	\$ 125.000	6,25 %	01.04.2019	131.266	0,00 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 125.000	4,25 %	15.05.2021	131.255	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 116.588	6,00 %	01.11.2034	131.248	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 121.719	5,00 %	01.03.2034	131.224	0,00 %
Tech Data Corp.	\$ 125.000	4,95 %	15.02.2027	131.219	0,00 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 125.000	3,78 %	10.09.2058	131.041	0,00 %
Metropolitan Life Global Funding I	€ 100.000	2,38 %	11.01.2023	131.033	0,00 %
General Electric Co.	\$ 125.000	4,13 %	09.10.2042	130.999	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 125.000	3,53 %	25.10.2023	130.964	0,00 %
Wells Fargo & Co.	€ 100.000	2,25 %	02.05.2023	130.512	0,00 %
Oracle Corp.	\$ 125.000	5,00 %	08.07.2019	130.486	0,00 %
AT&T, Inc.	€ 100.000	2,50 %	15.03.2023	130.474	0,00 %
KLA-Tencor Corp.	\$ 125.000	4,13 %	01.11.2021	130.438	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 126.101	3,50 %	01.04.2027	130.382	0,00 %
Johnson & Johnson	\$ 125.000	3,55 %	01.03.2036	130.219	0,00 %
Republic Services, Inc.	\$ 100.000	6,20 %	01.03.2040	130.138	0,00 %
Arch Capital Finance LLC	\$ 125.000	4,01 %	15.12.2026	130.119	0,00 %
GS Mortgage Securities Trust 2017	\$ 125.000	3,67 %	10.03.2050	130.105	0,00 %
Southern California Edison Co.	\$ 125.000	3,88 %	01.06.2021	130.024	0,00 %
Citigroup, Inc.	\$ 125.000	4,05 %	30.07.2022	130.015	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 118.391	5,50 %	01.05.2036	129.982	0,00 %
Enbridge Energy Partners LP	\$ 125.000	4,20 %	15.09.2021	129.924	0,00 %
Pfizer, Inc.	\$ 125.000	3,40 %	15.05.2024	129.903	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 125.000	4,10 %	22.05.2023	129.881	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 125.000	3,39 %	25.03.2024	129.834	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 122.610	4,50 %	20.04.2040	129.792	0,00 %
Tennessee Valley Authority	\$ 100.000	4,88 %	15.01.2048	129.784	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 115.489	6,00 %	01.01.2038	129.775	0,00 %
Citigroup, Inc.	€ 100.000	5,00 %	02.08.2019	129.758	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 125.000	3,33 %	25.08.2025	129.732	0,00 %
Humana, Inc.	\$ 120.000	4,63 %	01.12.2042	129.708	0,00 %
Commonwealth Edison Co.	\$ 125.000	3,75 %	15.08.2047	129.701	0,00 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	\$ 125.000	3,75 %	01.04.2045	129.699	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 123.401	4,00 %	01.09.2040	129.555	0,00 %
Coca-Cola Co.	\$ 125.000	3,20 %	01.11.2023	129.477	0,00 %
Procter & Gamble Co.	€ 100.000	2,00 %	16.08.2022	129.436	0,00 %
Duke Energy Indiana LLC	\$ 125.000	3,75 %	15.07.2020	129.157	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 128.039	2,50 %	01.06.2028	129.156	0,00 %
Kellogg Co.	\$ 125.000	4,15 %	15.11.2019	129.099	0,00 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 125.000	4,95 %	15.02.2019	129.087	0,00 %
Air Lease Corp.	\$ 125.000	3,75 %	01.02.2022	129.082	0,00 %
Stryker Corp.	\$ 125.000	3,50 %	15.03.2026	129.009	0,00 %
Microsoft Corp.	€ 100.000	2,13 %	06.12.2021	129.006	0,00 %
Boston Scientific Corp.	\$ 100.000	7,00 %	15.11.2035	128.962	0,00 %
Pitney Bowes, Inc.	\$ 125.000	6,25 %	15.03.2019	128.933	0,00 %
State of Illinois	\$ 125.000	5,88 %	01.03.2019	128.895	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 122.851	4,00 %	01.05.2042	128.741	0,00 %
Digital Euro Finco LLC	€ 100.000	2,63 %	15.04.2024	128.734	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 121.057	4,50 %	01.03.2044	128.662	0,00 %
Duke Energy Carolinas LLC	\$ 125.000	3,70 %	01.12.2047	128.578	0,00 %
Wal-Mart Stores, Inc.	€ 100.000	1,90 %	08.04.2022	128.574	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 123.712	3,50 %	15.11.2041	128.570	0,00 %
Nordstrom, Inc.	\$ 125.000	4,00 %	15.10.2021	128.556	0,00 %
Blackstone Holdings Finance Co. LLC	€ 100.000	2,00 %	19.05.2025	128.484	0,00 %
Wells Fargo & Co.	€ 100.000	2,00 %	27.04.2026	128.471	0,00 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	€ 100.000	2,15 %	21.07.2022	128.357	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Celgene Corp.	\$ 125.000	3,55 %	15.08.2022	128.350	0,00 %
Ameren Illinois Co.	\$ 125.000	3,70 %	01.12.2047	128.347	0,00 %
Southern California Edison Co.	\$ 100.000	5,50 %	15.03.2040	128.263	0,00 %
Anadarko Finance Co.	\$ 100.000	7,50 %	01.05.2031	128.246	0,00 %
Discovery Communications LLC	€ 100.000	2,38 %	07.03.2022	128.149	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 100.000	5,60 %	15.07.2041	128.104	0,00 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates	\$ 125.000	3,24 %	25.08.2027	128.100	0,00 %
John Deere Capital Corp.	\$ 125.000	3,15 %	15.10.2021	128.028	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 100.000	6,45 %	01.05.2036	128.027	0,00 %
Air Products & Chemicals, Inc.	\$ 125.000	3,35 %	31.07.2024	127.998	0,00 %
WEC Energy Group, Inc.	\$ 125.000	3,55 %	15.06.2025	127.841	0,00 %
Public Service Electric & Gas Co.	\$ 125.000	3,65 %	01.09.2042	127.790	0,00 %
Dominion Energy Gas Holdings LLC	\$ 125.000	3,60 %	15.12.2024	127.666	0,00 %
Carnival Corp.	€ 100.000	1,88 %	07.11.2022	127.663	0,00 %
Colgate-Palmolive Co.	\$ 125.000	3,70 %	01.08.2047	127.634	0,00 %
Kentucky Utilities Co.	\$ 125.000	3,25 %	01.11.2020	127.614	0,00 %
Harley-Davidson, Inc.	\$ 125.000	3,50 %	28.07.2025	127.548	0,00 %
PepsiCo, Inc.	\$ 125.000	3,00 %	25.08.2021	127.536	0,00 %
Nissan Auto Receivables 2017-B Owner Trust	\$ 129.000	1,95 %	16.10.2023	127.509	0,00 %
Bank of America Corp.	€ 100.000	2,50 %	27.07.2020	127.500	0,00 %
Praxair, Inc.	€ 100.000	1,63 %	01.12.2025	127.491	0,00 %
Arrow Electronics, Inc.	\$ 125.000	4,00 %	01.04.2025	127.490	0,00 %
ManpowerGroup, Inc.	€ 100.000	1,88 %	11.09.2022	127.461	0,00 %
Progressive Corp.	\$ 100.000	6,63 %	01.03.2029	127.337	0,00 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 100.000	7,50 %	15.11.2040	127.321	0,00 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 125.000	3,25 %	12.11.2020	127.225	0,00 %
CME Group, Inc.	\$ 125.000	3,00 %	15.09.2022	127.184	0,00 %
Covidien International Finance SA	\$ 125.000	3,20 %	15.06.2022	127.106	0,00 %
Wells Fargo & Co.	€ 100.000	2,25 %	03.09.2020	127.013	0,00 %
Clorox Co.	\$ 125.000	3,05 %	15.09.2022	126.945	0,00 %
International Business Machines Corp.	\$ 125.000	2,90 %	01.11.2021	126.928	0,00 %
County of Cook IL	\$ 100.000	6,23 %	15.11.2034	126.888	0,00 %
South Carolina Electric & Gas Co.	\$ 100.000	6,63 %	01.02.2032	126.869	0,00 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 125.000	2,95 %	15.01.2022	126.786	0,00 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2012	\$ 125.000	3,02 %	10.09.2045	126.725	0,00 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 125.000	3,30 %	15.10.2050	126.633	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 125.000	3,95 %	23.04.2027	126.605	0,00 %
HCP, Inc.	\$ 125.000	3,75 %	01.02.2019	126.579	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 112.952	6,00 %	01.04.2035	126.558	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 120.394	4,00 %	01.10.2040	126.361	0,00 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 124.000	3,00 %	15.06.2022	126.360	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 121.297	3,50 %	01.01.2032	126.309	0,00 %
International Business Machines Corp.	€ 100.000	1,88 %	06.11.2020	126.234	0,00 %
State of Washington	\$ 100.000	5,14 %	01.08.2040	126.225	0,00 %
Kimberly-Clark Corp.	\$ 100.000	5,30 %	01.03.2041	126.118	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 117.906	4,50 %	01.01.2042	125.996	0,00 %
Seagate HDD Cayman	\$ 125.000	4,25 %	01.03.2022	125.938	0,00 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	\$ 125.000	3,88 %	15.01.2022	125.883	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 124.656	2,50 %	01.12.2027	125.840	0,00 %
Hasbro, Inc.	\$ 125.000	3,15 %	15.05.2021	125.814	0,00 %
Cintas Corp.No 2	\$ 125.000	2,90 %	01.04.2022	125.770	0,00 %
Marriott International, Inc.	\$ 125.000	3,00 %	01.03.2019	125.747	0,00 %
Government Properties Income Trust	\$ 125.000	4,00 %	15.07.2022	125.696	0,00 %
AT&T, Inc.	€ 100.000	1,88 %	04.12.2020	125.696	0,00 %
Prudential Financial, Inc.	\$ 100.000	5,70 %	14.12.2036	125.601	0,00 %
Harris Corp.	\$ 100.000	6,15 %	15.12.2040	125.572	0,00 %
Oracle Corp.	\$ 125.000	2,38 %	15.01.2019	125.537	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 100.000	5,40 %	06.01.2042	125.502	0,00 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	\$ 125.000	5,35 %	07.02.2020	125.453	0,00 %
Carnival Corp.	€ 100.000	1,63 %	22.02.2021	125.408	0,00 %
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.^	\$ 125.000	4,80 %	01.12.2077	125.313	0,00 %
Georgia Power Co.	\$ 125.000	3,25 %	30.03.2027	125.150	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 118.088	4,00 %	01.07.2031	125.145	0,00 %
Tech Data Corp.	\$ 125.000	3,70 %	15.02.2022	125.116	0,00 %
Athene Global Funding	\$ 125.000	2,75 %	20.04.2020	125.055	0,00 %
CBS Corp.	\$ 125.000	2,30 %	15.08.2019	125.052	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anthem, Inc.	\$ 125.000	2,95 %	01.12.2022	125.027	0,00 %
Kroger Co.	\$ 125.000	4,45 %	01.02.2047	124.932	0,00 %
Huntington Ingalls Industries, Inc.	\$ 125.000	3,48 %	01.12.2027	124.687	0,00 %
Honda Auto Receivables 2017-4 Owner Trust	\$ 125.000	2,05 %	22.11.2021	124.618	0,00 %
Discover Card Execution Note Trust	\$ 125.000	1,45 %	15.03.2021	124.579	0,00 %
General Electric Co.	\$ 125.000	2,20 %	09.01.2020	124.562	0,00 %
Sysco Corp.	\$ 125.000	2,50 %	15.07.2021	124.560	0,00 %
Cleveland Electric Illuminating Co.	\$ 100.000	5,95 %	15.12.2036	124.454	0,00 %
Procter & Gamble Co.	\$ 125.000	2,30 %	06.02.2022	124.443	0,00 %
Bristol-Myers Squibb Co.	\$ 125.000	1,60 %	27.02.2019	124.415	0,00 %
Philip Morris International, Inc.	€ 100.000	1,75 %	19.03.2020	124.378	0,00 %
Coca-Cola European Partners US LLC	€ 100.000	1,88 %	18.03.2030	124.344	0,00 %
Kellogg Co.	\$ 125.000	3,40 %	15.11.2027	124.328	0,00 %
Avangrid, Inc.	\$ 125.000	3,15 %	01.12.2024	124.304	0,00 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 125.000	1,63 %	21.02.2019	124.236	0,00 %
Merck & Co., Inc.	€ 100.000	1,13 %	15.10.2021	124.190	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 120.840	3,50 %	01.08.2044	124.189	0,00 %
PNC Bank NA	\$ 125.000	2,95 %	23.02.2025	124.165	0,00 %
Cigna Corp.	\$ 125.000	3,25 %	15.04.2025	124.158	0,00 %
Fortive Corp.	\$ 125.000	1,80 %	15.06.2019	124.143	0,00 %
Pfizer, Inc.	\$ 125.000	1,45 %	03.06.2019	124.108	0,00 %
AbbVie, Inc.	\$ 125.000	2,30 %	14.05.2021	124.098	0,00 %
New York Life Global Funding	\$ 125.000	2,00 %	09.04.2020	124.096	0,00 %
Microsoft Corp.	€ 100.000	4,75 %	03.11.2055	123.808	0,00 %
Mastercard, Inc.	€ 100.000	1,10 %	01.12.2022	123.784	0,00 %
Abbott Laboratories	\$ 125.000	2,55 %	15.03.2022	123.744	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 122.306	4,00 %	01.06.2019	123.744	0,00 %
Chase Issuance Trust	\$ 125.000	2,16 %	16.09.2024	123.695	0,00 %
Priceline Group, Inc.	\$ 125.000	3,55 %	15.03.2028	123.679	0,00 %
Martin Marietta Materials, Inc.	\$ 125.000	4,25 %	15.12.2047	123.677	0,00 %
BB&T Corp.	\$ 125.000	2,85 %	26.10.2024	123.666	0,00 %
Eli Lilly & Co.	€ 100.000	1,00 %	02.06.2022	123.653	0,00 %
Pfizer, Inc.	\$ 125.000	1,95 %	03.06.2021	123.632	0,00 %
Home Depot, Inc.	\$ 125.000	2,00 %	01.04.2021	123.621	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 122.430	2,50 %	20.06.2027	123.608	0,00 %
Viacom, Inc.	\$ 124.000	3,88 %	01.04.2024	123.590	0,00 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	\$ 125.000	5,30 %	01.04.2044	123.536	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 117.864	4,00 %	20.06.2041	123.516	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 121.206	3,00 %	01.01.2027	123.508	0,00 %
Schlumberger Investment SA	\$ 125.000	2,40 %	01.08.2022	123.506	0,00 %
International Business Machines Corp.	€ 100.000	1,38 %	19.11.2019	123.489	0,00 %
McKesson Corp.	\$ 125.000	2,70 %	15.12.2022	123.486	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 125.000	1,55 %	07.02.2020	123.474	0,00 %
Guardian Life Global Funding	\$ 125.000	2,50 %	08.05.2022	123.399	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 122.743	3,00 %	01.11.2042	123.251	0,00 %
BB&T Corp.	\$ 125.000	2,05 %	10.05.2021	123.231	0,00 %
CBS Corp.	\$ 125.000	3,70 %	01.06.2028	123.140	0,00 %
Masco Corp.	\$ 125.000	3,50 %	15.11.2027	123.103	0,00 %
IBM Credit LLC	\$ 125.000	1,80 %	20.01.2021	123.009	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 112.174	5,50 %	01.07.2040	123.003	0,00 %
Public Service Co. of Colorado	\$ 125.000	2,25 %	15.09.2022	122.885	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 118.751	3,50 %	01.10.2028	122.853	0,00 %
Mondelez International, Inc.	€ 100.000	1,00 %	07.03.2022	122.847	0,00 %
Rutgers The State University of New Jersey	\$ 100.000	5,67 %	01.05.2040	122.812	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 118.045	3,50 %	01.09.2025	122.784	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 125.000	2,65 %	25.08.2026	122.777	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 115.001	4,50 %	01.02.2045	122.661	0,00 %
IBM Credit LLC	\$ 125.000	2,20 %	08.09.2022	122.566	0,00 %
Metropolitan Life Global Funding I	€ 100.000	0,88 %	20.01.2022	122.507	0,00 %
0,00 % Federal National Mortgage Association	\$ 119.870	3,00 %	01.01.2030	122.472	0,00 %
Broadridge Financial Solutions, Inc.	\$ 125.000	3,40 %	27.06.2026	122.429	0,00 %
Molson Coors Brewing Co.	\$ 125.000	2,10 %	15.07.2021	122.386	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 115.526	4,00 %	01.12.2040	122.342	0,00 %
Kraft Heinz Foods Co.	€ 100.000	1,50 %	24.05.2024	122.298	0,00 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 125.000	1,93 %	01.10.2021	122.231	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 125.000	2,53 %	25.05.2026	122.224	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 125.000	3,45 %	09.02.2045	122.113	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal National Mortgage Association	\$ 121.506	3,00 %	01.12.2042	122.046	0,00 %
Flowers Foods, Inc.	\$ 125.000	3,50 %	01.10.2026	121.914	0,00 %
National Grid North America, Inc.	€ 100.000	0,75 %	11.02.2022	121.885	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 117.982	3,50 %	01.11.2042	121.693	0,00 %
Whirlpool Corp.	€ 100.000	0,63 %	12.03.2020	121.431	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 108.355	6,00 %	01.11.2035	121.414	0,00 %
Bristol-Myers Squibb Co.	€ 100.000	1,00 %	15.05.2025	121.393	0,00 %
Northwestern University	\$ 100.000	4,64 %	01.12.2044	121.333	0,00 %
KeySpan Gas East Corp.	\$ 125.000	2,74 %	15.08.2026	121.318	0,00 %
International Business Machines Corp.	\$ 125.000	1,88 %	01.08.2022	121.298	0,00 %
Boeing Co.	\$ 100.000	8,75 %	15.08.2021	121.268	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 117.132	3,50 %	01.03.2026	121.078	0,00 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 120.000	2,63 %	21.02.2020	120.933	0,00 %
National Grid North America, Inc.	€ 100.000	1,00 %	12.07.2024	120.925	0,00 %
Coca-Cola Co.	€ 100.000	1,63 %	09.03.2035	120.859	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 118.886	3,00 %	15.12.2042	120.560	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 114.501	4,00 %	01.01.2041	120.507	0,00 %
AHS Hospital Corp.	\$ 100.000	5,02 %	01.07.2045	120.502	0,00 %
Applied Materials, Inc.	\$ 100.000	5,10 %	01.10.2035	120.372	0,00 %
AT&T, Inc.	CAD 150.000	4,85 %	25.05.2047	120.332	0,00 %
State of Oregon	\$ 100.000	5,89 %	01.06.2027	120.269	0,00 %
Kansas City Power & Light Co.	\$ 100.000	5,30 %	01.10.2041	120.257	0,00 %
VF Corp.	€ 100.000	0,63 %	20.09.2023	120.132	0,00 %
Allstate Corp.^	\$ 100.000	6,50 %	15.05.2057	120.000	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 119.670	3,00 %	01.09.2045	119.943	0,00 %
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012	\$ 119.459	2,83 %	15.10.2045	119.941	0,00 %
Hasbro, Inc.	\$ 100.000	6,35 %	15.03.2040	119.881	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 119.498	3,00 %	01.12.2042	119.880	0,00 %
Duke University Health System, Inc.	\$ 115.000	3,92 %	01.06.2047	119.806	0,00 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 100.000	6,83 %	23.10.2055	119.780	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 124.000	1,63 %	15.01.2022	119.747	0,00 %
Bank of America Corp.	\$ 100.000	4,88 %	01.04.2044	119.707	0,00 %
Santander Drive Auto Receivables Trust 2017	\$ 120.000	1,87 %	15.06.2021	119.516	0,00 %
Walt Disney Co.	CAD 150.000	2,76 %	07.10.2024	119.489	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 111.755	4,50 %	01.03.2041	119.298	0,00 %
Coventry Health Care, Inc.	\$ 110.000	5,45 %	15.06.2021	119.089	0,00 %
Bank of America Corp.^	CAD 150.000	2,60 %	15.03.2023	118.867	0,00 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 100.000	4,95 %	15.09.2041	118.847	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 120.000	1,25 %	01.08.2019	118.767	0,00 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 120.000	2,56 %	25.07.2024	118.562	0,00 %
South Carolina Electric & Gas Co.	\$ 100.000	5,45 %	01.02.2041	118.457	0,00 %
Sysco Corp.	\$ 100.000	5,38 %	21.09.2035	118.399	0,00 %
Kaiser Foundation Hospitals	\$ 100.000	4,88 %	01.04.2042	118.272	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 110.902	4,50 %	20.06.2042	118.266	0,00 %
Cummins, Inc.	\$ 100.000	4,88 %	01.10.2043	118.224	0,00 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 100.000	4,95 %	15.10.2045	118.219	0,00 %
Whirlpool Corp.	\$ 112.500	4,50 %	01.06.2046	118.142	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 109.922	5,00 %	01.09.2039	118.102	0,00 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	\$ 100.000	7,00 %	01.09.2022	118.014	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 107.312	5,50 %	01.07.2033	117.792	0,00 %
Molson Coors International LP	CAD 150.000	3,44 %	15.07.2026	117.774	0,00 %
Mondelez International, Inc.	€ 100.000	2,38 %	06.03.2035	117.621	0,00 %
International Business Machines Corp.	\$ 100.000	4,70 %	19.02.2046	117.507	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 108.323	5,00 %	15.03.2035	117.493	0,00 %
AT&T, Inc.	\$ 100.000	6,35 %	15.03.2040	117.467	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 108.846	5,00 %	01.07.2035	117.382	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 107.145	5,50 %	01.01.2039	117.313	0,00 %
Williams Partners LP	\$ 100.000	5,80 %	15.11.2043	117.298	0,00 %
Ameren Corp.	\$ 115.000	3,65 %	15.02.2026	117.230	0,00 %
Nationwide Financial Services, Inc.	\$ 100.000	5,30 %	18.11.2044	116.665	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 107.922	5,00 %	15.08.2038	116.662	0,00 %
AT&T, Inc.	CAD 150.000	2,85 %	25.05.2024	116.647	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 109.996	4,50 %	15.05.2041	116.273	0,00 %
CVS Health Corp.	\$ 100.000	5,30 %	05.12.2043	116.165	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 112.118	3,50 %	01.10.2042	115.888	0,00 %
FedEx Corp.	\$ 100.000	5,10 %	15.01.2044	115.677	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Ally Auto Receivables Trust 2017	\$ 117.000	1,96 %	15.07.2022	115.644	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 112.153	3,50 %	01.06.2042	115.628	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 111.770	3,50 %	01.12.2026	115.475	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 102.516	6,00 %	01.06.2036	115.356	0,00 %
International Paper Co.	\$ 100.000	5,15 %	15.05.2046	115.234	0,00 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 100.000	4,75 %	01.06.2043	115.156	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 109.789	4,00 %	20.08.2042	115.059	0,00 %
Kroger Co.	\$ 125.000	3,88 %	15.10.2046	115.045	0,00 %
NYU Hospitals Center	\$ 100.000	4,78 %	01.07.2044	114.995	0,00 %
Fidelity National Information Services, Inc.	\$ 112.000	3,63 %	15.10.2020	114.972	0,00 %
Humana, Inc.	\$ 100.000	4,95 %	01.10.2044	114.733	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 105.353	5,50 %	20.07.2038	114.647	0,00 %
ONE Gas, Inc.	\$ 100.000	4,66 %	01.02.2044	114.409	0,00 %
Indiana Michigan Power Co.	\$ 100.000	4,55 %	15.03.2046	114.344	0,00 %
RPM International, Inc.	\$ 100.000	5,25 %	01.06.2045	114.260	0,00 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 100.000	4,65 %	15.04.2042	114.203	0,00 %
Wells Fargo Capital X	\$ 100.000	5,95 %	15.12.2036	114.125	0,00 %
South Carolina Electric & Gas Co.	\$ 100.000	5,10 %	01.06.2065	114.022	0,00 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 100.000	4,85 %	15.09.2041	113.867	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 106.660	4,50 %	01.04.2041	113.854	0,00 %
Honda Auto Receivables 2017-2 Owner Trust	\$ 115.000	1,87 %	15.09.2023	113.745	0,00 %
Allstate Corp.	\$ 100.000	4,50 %	15.06.2043	113.593	0,00 %
Walt Disney Co.	\$ 105.000	4,13 %	01.12.2041	113.026	0,00 %
Sysco Corp.	\$ 100.000	4,85 %	01.10.2045	112.825	0,00 %
Puget Sound Energy, Inc.	\$ 100.000	4,30 %	20.05.2045	112.802	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 105.426	5,00 %	20.02.2043	112.770	0,00 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 112.723	2,17 %	25.09.2019	112.746	0,00 %
FedEx Corp.	\$ 100.000	4,75 %	15.11.2045	112.650	0,00 %
Brown-Forman Corp.	\$ 100.000	4,50 %	15.07.2045	112.368	0,00 %
Nationwide Mutual Insurance Co.	\$ 100.000	4,95 %	22.04.2044	112.317	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 100.000	4,60 %	15.08.2045	112.256	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 106.914	4,00 %	01.05.2026	111.997	0,00 %
JobsOhio Beverage System	\$ 100.000	4,53 %	01.01.2035	111.934	0,00 %
Markel Corp.	\$ 100.000	5,00 %	05.04.2046	111.852	0,00 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 100.000	4,50 %	15.05.2036	111.817	0,00 %
Medtronic, Inc.	\$ 100.000	4,50 %	15.03.2042	111.792	0,00 %
PPL Capital Funding, Inc.	\$ 100.000	4,70 %	01.06.2043	111.720	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 107.345	3,50 %	20.10.2026	111.717	0,00 %
International Paper Co.	\$ 104.000	4,75 %	15.02.2022	111.643	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 104.163	4,50 %	01.06.2039	111.560	0,00 %
Mead Johnson Nutrition Co.	\$ 100.000	4,60 %	01.06.2044	111.232	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 107.143	3,50 %	01.02.2034	111.141	0,00 %
Abbott Laboratories	\$ 100.000	4,75 %	15.04.2043	111.112	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 107.232	3,50 %	01.01.2041	111.043	0,00 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 100.000	5,00 %	12.11.2040	110.991	0,00 %
Aon plc	\$ 100.000	4,75 %	15.05.2045	110.923	0,00 %
Ingersoll-Rand Luxembourg Finance SA	\$ 100.000	4,65 %	01.11.2044	110.915	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 102.108	5,00 %	15.08.2033	110.719	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 100.000	4,50 %	15.01.2043	110.670	0,00 %
International Lease Finance Corp.	\$ 100.000	5,88 %	15.08.2022	110.625	0,00 %
Time Warner, Inc.	\$ 100.000	5,38 %	15.10.2041	110.463	0,00 %
Anthem, Inc.	\$ 100.000	4,63 %	15.05.2042	110.442	0,00 %
WW Grainger, Inc.	\$ 100.000	4,60 %	15.06.2045	110.416	0,00 %
McDonald's Corp.	\$ 100.000	4,60 %	26.05.2045	110.394	0,00 %
California Institute of Technology	\$ 100.000	4,70 %	01.11.2111	110.283	0,00 %
Starbucks Corp.	\$ 100.000	4,30 %	15.06.2045	110.218	0,00 %
Massachusetts Institute of Technology	\$ 100.000	3,96 %	01.07.2038	109.972	0,00 %
FedEx Corp.	\$ 100.000	4,55 %	01.04.2046	109.913	0,00 %
American Airlines 2015-1 Klasse A Pass Through Trust	\$ 109.832	3,38 %	01.05.2027	109.898	0,00 %
Delmarva Power & Light Co.	\$ 100.000	4,15 %	15.05.2045	109.820	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.577	4,50 %	01.02.2046	109.813	0,00 %
Guardian Life Insurance Co. of America	\$ 100.000	4,85 %	24.01.2077	109.812	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 109.049	3,00 %	01.10.2043	109.753	0,00 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 100.000	5,25 %	01.03.2026	109.687	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 103.170	4,50 %	15.09.2034	109.627	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 100.000	5,50 %	28.07.2021	109.350	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal National Mortgage Association	\$ 105.758	3,50 %	01.07.2042	109.312	0,00 %
Hartford Financial Services Group, Inc.	\$ 100.000	5,13 %	15.04.2022	109.046	0,00 %
Potomac Electric Power Co.	\$ 100.000	4,15 %	15.03.2043	108.991	0,00 %
Dow Chemical Co.	\$ 100.000	4,63 %	01.10.2044	108.924	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 100.000	5,75 %	25.01.2021	108.895	0,00 %
Estee Lauder Cos, Inc.	\$ 100.000	4,15 %	15.03.2047	108.859	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 103.669	4,00 %	01.12.2040	108.839	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 107.806	2,50 %	01.12.2027	108.831	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 102.498	4,00 %	01.05.2031	108.628	0,00 %
CMS Energy Corp.	\$ 100.000	8,75 %	15.06.2019	108.614	0,00 %
Digital Realty Trust LP	\$ 100.000	4,75 %	01.10.2025	108.450	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 100.000	5,25 %	27.07.2021	108.393	0,00 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 100.000	4,15 %	01.04.2045	108.341	0,00 %
PacifiCorp	\$ 100.000	4,10 %	01.02.2042	108.278	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 105.000	3,35 %	15.07.2022	108.234	0,00 %
Deere & Co.	\$ 100.000	3,90 %	09.06.2042	108.186	0,00 %
PPL Electric Utilities Corp.	\$ 100.000	3,95 %	01.06.2047	107.956	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 100.000	6,00 %	15.06.2020	107.946	0,00 %
Moody's Corp.	\$ 100.000	5,50 %	01.09.2020	107.676	0,00 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 100.000	4,65 %	20.05.2035	107.642	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 100.775	4,50 %	01.12.2041	107.610	0,00 %
Mosaic Co.	\$ 100.000	5,63 %	15.11.2043	107.583	0,00 %
Packaging Corp. of America	\$ 100.000	4,50 %	01.11.2023	107.548	0,00 %
Westar Energy, Inc.	\$ 100.000	4,13 %	01.03.2042	107.516	0,00 %
Westar Energy, Inc.	\$ 100.000	4,10 %	01.04.2043	107.485	0,00 %
NYU Hospitals Center	\$ 100.000	4,37 %	01.07.2047	107.463	0,00 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	\$ 100.000	4,40 %	30.05.2047	107.351	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 106.400	2,50 %	01.09.2027	107.328	0,00 %
Dr Pepper Snapple Group, Inc.	\$ 100.000	4,50 %	15.11.2045	107.232	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.855	4,50 %	01.08.2040	107.220	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 100.000	5,50 %	24.07.2020	107.160	0,00 %
Leucadia National Corp.	\$ 100.000	5,50 %	18.10.2023	107.121	0,00 %
Legg Mason, Inc.	\$ 100.000	4,75 %	15.03.2026	107.111	0,00 %
Union Pacific Corp.	\$ 100.000	4,16 %	15.07.2022	107.109	0,00 %
Prudential Financial, Inc.^	\$ 100.000	5,38 %	15.05.2045	107.083	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 99.277	5,00 %	01.08.2035	107.039	0,00 %
Moody's Corp.	\$ 100.000	4,50 %	01.09.2022	106.994	0,00 %
Expedia, Inc.	\$ 100.000	5,00 %	15.02.2026	106.908	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 100.000	4,50 %	24.01.2022	106.746	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 97.334	5,50 %	01.08.2038	106.714	0,00 %
Southern Co.	\$ 100.000	4,40 %	01.07.2046	106.698	0,00 %
University of Southern California	\$ 100.000	3,84 %	01.10.2047	106.637	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 100.000	4,63 %	10.05.2021	106.485	0,00 %
Block Financial LLC	\$ 100.000	5,25 %	01.10.2025	106.435	0,00 %
Vulcan Materials Co.	\$ 100.000	4,50 %	01.04.2025	106.316	0,00 %
Wells Fargo & Co.	\$ 100.000	4,60 %	01.04.2021	106.302	0,00 %
Masco Corp.	\$ 100.000	4,45 %	01.04.2025	106.140	0,00 %
PNC Financial Services Group, Inc.	\$ 100.000	6,70 %	10.06.2019	106.130	0,00 %
Mastercard, Inc.	\$ 100.000	3,80 %	21.11.2046	106.115	0,00 %
JM Smucker Co.	\$ 100.000	4,38 %	15.03.2045	106.113	0,00 %
Keysight Technologies, Inc.	\$ 100.000	4,55 %	30.10.2024	106.044	0,00 %
Textron, Inc.	\$ 100.000	4,30 %	01.03.2024	106.020	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 100.000	5,38 %	15.03.2020	105.961	0,00 %
Flowers Foods, Inc.	\$ 100.000	4,38 %	01.04.2022	105.910	0,00 %
General Electric Co.	\$ 100.000	4,63 %	07.01.2021	105.904	0,00 %
Noble Energy, Inc.	\$ 100.000	4,95 %	15.08.2047	105.898	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013	\$ 100.000	4,04 %	15.11.2046	105.894	0,00 %
Bio-Rad Laboratories, Inc.	\$ 100.000	4,88 %	15.12.2020	105.779	0,00 %
Southern Co.^	\$ 100.000	5,50 %	15.03.2057	105.750	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 103.732	3,00 %	01.03.2031	105.727	0,00 %
Nevada Power Co.	\$ 100.000	7,13 %	15.03.2019	105.682	0,00 %
Trinity Health Corp.	\$ 100.000	4,13 %	01.12.2045	105.679	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 98.015	5,00 %	01.04.2035	105.676	0,00 %
Mayo Clinic	\$ 100.000	4,13 %	15.11.2052	105.666	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 100.000	4,95 %	25.03.2020	105.655	0,00 %
McKesson Corp.	\$ 100.000	7,50 %	15.02.2019	105.636	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Vereit Operating Partnership LP	\$ 100.000	4,88 %	01.06.2026	105.625	0,00 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 100.000	4,00 %	01.09.2036	105.625	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 97.046	5,50 %	20.03.2038	105.603	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 98.524	4,50 %	01.12.2039	105.512	0,00 %
Dr Pepper Snapple Group, Inc.	\$ 100.000	4,42 %	15.12.2046	105.502	0,00 %
Hospitality Properties Trust	\$ 100.000	4,95 %	15.02.2027	105.438	0,00 %
Indiana Michigan Power Co.	\$ 100.000	7,00 %	15.03.2019	105.437	0,00 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 100.000	3,63 %	04.03.2024	105.429	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 100.000	5,63 %	23.09.2019	105.416	0,00 %
Wyndham Worldwide Corp.	\$ 100.000	5,10 %	01.10.2025	105.388	0,00 %
Western Union Co.	\$ 100.000	5,25 %	01.04.2020	105.388	0,00 %
EnLink Midstream Partners LP	\$ 100.000	5,60 %	01.04.2044	105.292	0,00 %
DR Horton, Inc.	\$ 100.000	4,38 %	15.09.2022	105.288	0,00 %
Southern Power Co.	\$ 100.000	4,15 %	01.12.2025	105.272	0,00 %
Xerox Corp.	\$ 100.000	5,63 %	15.12.2019	105.181	0,00 %
CenterPoint Energy Resources Corp.	\$ 100.000	4,10 %	01.09.2047	105.053	0,00 %
Whirlpool Corp.	\$ 100.000	4,00 %	01.03.2024	105.041	0,00 %
BB&T Corp.	\$ 100.000	5,25 %	01.11.2019	105.020	0,00 %
CSX Corp.	\$ 100.000	4,50 %	01.08.2054	104.938	0,00 %
Archer-Daniels-Midland Co.	\$ 100.000	4,02 %	16.04.2043	104.924	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 100.000	4,25 %	15.10.2020	104.842	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp. ^	\$ 100.000	3,53 %	25.07.2023	104.808	0,00 %
Activision Blizzard, Inc.	\$ 100.000	4,50 %	15.06.2047	104.802	0,00 %
L3 Technologies, Inc.	\$ 100.000	5,20 %	15.10.2019	104.797	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015	\$ 100.000	3,82 %	15.07.2048	104.760	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 99.198	4,50 %	20.06.2045	104.732	0,00 %
Brown & Brown, Inc.	\$ 100.000	4,20 %	15.09.2024	104.726	0,00 %
Highmark, Inc.	\$ 100.000	4,75 %	15.05.2021	104.663	0,00 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 100.000	4,60 %	15.01.2020	104.626	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 98.371	4,50 %	01.06.2031	104.574	0,00 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	\$ 100.000	3,75 %	14.03.2026	104.563	0,00 %
WP Carey, Inc.	\$ 100.000	4,60 %	01.04.2024	104.549	0,00 %
Illinois Tool Works, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	01.03.2024	104.542	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 100.000	3,88 %	15.06.2047	104.524	0,00 %
Microsoft Corp.	\$ 100.000	3,75 %	01.05.2043	104.452	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 96.468	5,00 %	15.04.2040	104.438	0,00 %
HCP, Inc.	\$ 100.000	4,00 %	01.12.2022	104.418	0,00 %
Anthem, Inc.	\$ 100.000	4,35 %	15.08.2020	104.400	0,00 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 100.000	3,70 %	15.10.2025	104.368	0,00 %
Realty Income Corp.	\$ 100.000	4,13 %	15.10.2026	104.345	0,00 %
Amphenol Corp.	\$ 100.000	4,00 %	01.02.2022	104.338	0,00 %
Aon plc	\$ 100.000	3,88 %	15.12.2025	104.315	0,00 %
CF Industries, Inc.	\$ 100.000	4,50 %	01.12.2026	104.290	0,00 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	\$ 100.000	4,20 %	01.04.2027	104.243	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 104.263	2,50 %	01.06.2031	104.193	0,00 %
Boston Properties LP	\$ 100.000	3,85 %	01.02.2023	104.191	0,00 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 100.000	3,70 %	15.09.2024	104.189	0,00 %
Florida Power & Light Co.	\$ 100.000	3,70 %	01.12.2047	104.184	0,00 %
DXC Technology Co.	\$ 100.000	4,25 %	15.04.2024	104.110	0,00 %
Lam Research Corp.	\$ 100.000	3,80 %	15.03.2025	104.060	0,00 %
American Campus Communities Operating Partnership LP	\$ 100.000	4,13 %	01.07.2024	104.048	0,00 %
UDR, Inc.	\$ 100.000	4,00 %	01.10.2025	104.020	0,00 %
Time Warner, Inc.	\$ 100.000	4,05 %	15.12.2023	103.995	0,00 %
Hanover Insurance Group, Inc.	\$ 100.000	4,50 %	15.04.2026	103.960	0,00 %
PepsiCo, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	17.07.2025	103.937	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 100.000	3,64 %	15.06.2048	103.903	0,00 %
Fidelity National Information Services, Inc.	\$ 100.000	4,50 %	15.08.2046	103.880	0,00 %
Southern Copper Corp.	\$ 100.000	3,88 %	23.04.2025	103.870	0,00 %
AT&T, Inc.	\$ 100.000	5,80 %	15.02.2019	103.797	0,00 %
Colonial Pipeline Co.	\$ 100.000	3,75 %	01.10.2025	103.781	0,00 %
Hospitality Properties Trust	\$ 100.000	4,50 %	15.03.2025	103.765	0,00 %
DTE Electric Co.	\$ 100.000	3,75 %	15.08.2047	103.760	0,00 %
Kansas City Southern	\$ 100.000	4,30 %	15.05.2043	103.723	0,00 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 100.000	3,55 %	23.09.2021	103.692	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 100.000	3,75 %	25.02.2023	103.683	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015	\$ 100.000	3,64 %	15.10.2048	103.680	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeitsdatum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Welltower, Inc.	\$ 100.000	3,75 %	15.03.2023	103.658	0,00 %
CA, Inc.	\$ 100.000	4,70 %	15.03.2027	103.588	0,00 %
Precision Castparts Corp.	\$ 100.000	3,90 %	15.01.2043	103.524	0,00 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017^	\$ 100.000	4,06 %	15.12.2050	103.471	0,00 %
Viacom, Inc.	\$ 100.000	5,85 %	01.09.2043	103.468	0,00 %
Spectra Energy Partners LP	\$ 100.000	4,50 %	15.03.2045	103.449	0,00 %
Newell Brands Inc.	\$ 100.000	3,85 %	01.04.2023	103.431	0,00 %
Biogen, Inc.	\$ 100.000	3,63 %	15.09.2022	103.407	0,00 %
International Paper Co.	\$ 100.000	3,65 %	15.06.2024	103.402	0,00 %
Mohawk Industries, Inc.	\$ 100.000	3,85 %	01.02.2023	103.364	0,00 %
Kroger Co.	\$ 100.000	4,00 %	01.02.2024	103.354	0,00 %
International Paper Co.	\$ 100.000	3,80 %	15.01.2026	103.328	0,00 %
International Business Machines Corp.	\$ 100.000	3,38 %	01.08.2023	103.290	0,00 %
American Financial Group, Inc.	\$ 100.000	4,50 %	15.06.2047	103.266	0,00 %
Duke Energy Progress LLC	\$ 100.000	5,30 %	15.01.2019	103.229	0,00 %
SSM Health Care Corp.	\$ 100.000	3,82 %	01.06.2027	103.214	0,00 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates	\$ 100.000	3,29 %	25.11.2050	103.179	0,00 %
Branch Banking & Trust Co.	\$ 100.000	3,63 %	16.09.2025	103.165	0,00 %
Wells Fargo & Co.	\$ 100.000	3,50 %	08.03.2022	103.131	0,00 %
John Deere Capital Corp.	\$ 100.000	3,40 %	11.09.2025	103.111	0,00 %
Automatic Data Processing, Inc.	\$ 100.000	3,38 %	15.09.2025	103.083	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017	\$ 100.000	3,54 %	15.11.2052	103.071	0,00 %
Loews Corp.	\$ 100.000	4,13 %	15.05.2043	103.057	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.000	3,17 %	25.10.2024	102.937	0,00 %
Kaiser Foundation Hospitals	\$ 100.000	3,50 %	01.04.2022	102.923	0,00 %
L3 Technologies, Inc.	\$ 100.000	3,85 %	15.12.2026	102.866	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 100.000	3,63 %	22.01.2023	102.851	0,00 %
Kohl's Corp.	\$ 100.000	4,00 %	01.11.2021	102.840	0,00 %
ConocoPhillips Co.	\$ 100.000	3,35 %	15.11.2024	102.816	0,00 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 100.000	3,38 %	15.09.2025	102.805	0,00 %
BorgWarner, Inc.	\$ 100.000	4,38 %	15.03.2045	102.763	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.000	3,11 %	25.02.2023	102.713	0,00 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 100.000	3,95 %	01.09.2022	102.676	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 100.000	3,54 %	15.05.2048	102.653	0,00 %
Fluor Corp.	\$ 100.000	3,50 %	15.12.2024	102.644	0,00 %
Smithfield Foods, Inc.	\$ 100.000	4,25 %	01.02.2027	102.617	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.000	3,15 %	25.11.2025	102.585	0,00 %
Kroger Co.	\$ 100.000	4,65 %	15.01.2048	102.549	0,00 %
Johns Hopkins Health System Corp.	\$ 100.000	3,84 %	15.05.2046	102.502	0,00 %
Duke Energy Progress LLC	\$ 100.000	3,70 %	15.10.2046	102.436	0,00 %
International Lease Finance Corp.	\$ 85.000	8,63 %	15.01.2022	102.425	0,00 %
Packaging Corp. of America	\$ 100.000	3,65 %	15.09.2024	102.421	0,00 %
PPL Capital Funding, Inc.	\$ 100.000	4,00 %	15.09.2047	102.390	0,00 %
Flowserve Corp.	\$ 100.000	4,00 %	15.11.2023	102.283	0,00 %
AEP Transmission Co. LLC	\$ 100.000	3,75 %	01.12.2047	102.282	0,00 %
Wm Wrigley Jr Co.	\$ 100.000	3,38 %	21.10.2020	102.271	0,00 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 100.000	3,50 %	15.07.2022	102.254	0,00 %
JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017	\$ 100.000	3,74 %	15.07.2050	102.222	0,00 %
Cimarex Energy Co.	\$ 100.000	3,90 %	15.05.2027	102.201	0,00 %
CA, Inc.	\$ 100.000	3,60 %	01.08.2020	102.152	0,00 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 100.000	3,47 %	15.11.2050	102.138	0,00 %
American Tower Corp.	\$ 100.000	3,50 %	31.01.2023	102.116	0,00 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 100.000	4,75 %	01.11.2041	102.097	0,00 %
International Lease Finance Corp.	\$ 98.000	5,88 %	01.04.2019	102.078	0,00 %
Brandywine Operating Partnership LP	\$ 100.000	3,95 %	15.02.2023	102.066	0,00 %
Crown Castle International Corp.	\$ 100.000	3,40 %	15.02.2021	102.033	0,00 %
Brooklyn Union Gas Co.	\$ 100.000	3,41 %	10.03.2026	102.024	0,00 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 100.000	3,25 %	01.08.2023	102.024	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 100.000	3,25 %	23.09.2022	102.010	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.000	3,02 %	25.01.2025	102.002	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 100.000	3,70 %	15.09.2050	101.961	0,00 %
First Horizon National Corp.	\$ 100.000	3,50 %	15.12.2020	101.948	0,00 %
Wells Fargo & Co.	\$ 100.000	3,45 %	13.02.2023	101.915	0,00 %
Merck & Co., Inc.	\$ 100.000	3,60 %	15.09.2042	101.911	0,00 %
PPL Capital Funding, Inc.	\$ 100.000	3,40 %	01.06.2023	101.909	0,00 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	\$ 100.000	6,38 %	15.03.2037	101.901	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Welltower, Inc.	\$ 100.000	4,13 %	01.04.2019	101.861	0,00 %
Eaton Vance Corp.	\$ 100.000	3,50 %	06.04.2027	101.825	0,00 %
Alabama Power Co.	\$ 100.000	3,75 %	01.03.2045	101.819	0,00 %
AmerisourceBergen Corp.	\$ 100.000	3,40 %	15.05.2024	101.809	0,00 %
Healthcare Trust of America Holdings LP	\$ 100.000	3,38 %	15.07.2021	101.804	0,00 %
Constellation Brands, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	09.05.2027	101.720	0,00 %
Total System Services, Inc.	\$ 100.000	3,75 %	01.06.2023	101.691	0,00 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 100.000	2,90 %	04.03.2021	101.654	0,00 %
GATX Corp.	\$ 100.000	3,85 %	30.03.2027	101.596	0,00 %
General Electric Co.	\$ 100.000	3,15 %	07.09.2022	101.589	0,00 %
Zoetis, Inc.	\$ 100.000	3,25 %	01.02.2023	101.571	0,00 %
PacifiCorp	\$ 100.000	2,95 %	01.02.2022	101.559	0,00 %
Snap-on, Inc.	\$ 100.000	3,25 %	01.03.2027	101.550	0,00 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 100.000	3,30 %	25.02.2021	101.539	0,00 %
Allergan Funding SCS	\$ 100.000	3,45 %	15.03.2022	101.505	0,00 %
Citigroup, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	15.05.2023	101.505	0,00 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 100.000	3,05 %	01.09.2022	101.500	0,00 %
AutoZone, Inc.	\$ 100.000	3,75 %	01.06.2027	101.470	0,00 %
General Electric Co.	\$ 100.000	3,10 %	09.01.2023	101.466	0,00 %
Time Warner, Inc.	\$ 100.000	3,88 %	15.01.2026	101.453	0,00 %
AT&T, Inc.	£ 50.000	7,00 %	30.04.2040	101.438	0,00 %
Bank 2018-BNK [®]	\$ 100.000	3,62 %	15.06.2060	101.420	0,00 %
Wells Fargo & Co.	\$ 100.000	3,30 %	09.09.2024	101.411	0,00 %
State of Wisconsin	\$ 100.000	3,15 %	01.05.2027	101.398	0,00 %
Starbucks Corp.	\$ 100.000	3,75 %	01.12.2047	101.373	0,00 %
JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017	\$ 100.000	3,05 %	15.07.2050	101.371	0,00 %
JB Hunt Transport Services, Inc.	\$ 100.000	3,30 %	15.08.2022	101.348	0,00 %
WP Carey, Inc.	\$ 100.000	4,00 %	01.02.2025	101.325	0,00 %
Scripps Networks Interactive, Inc.	\$ 100.000	3,95 %	15.06.2025	101.324	0,00 %
Aflac, Inc.	\$ 100.000	3,25 %	17.03.2025	101.318	0,00 %
Aetna, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	15.11.2024	101.313	0,00 %
State Board of Administration Finance Corp.	\$ 100.000	3,00 %	01.07.2020	101.309	0,00 %
Dollar General Corp.	\$ 100.000	3,25 %	15.04.2023	101.285	0,00 %
Interstate Power & Light Co.	\$ 100.000	3,25 %	01.12.2024	101.271	0,00 %
eBay, Inc.	\$ 100.000	3,45 %	01.08.2024	101.266	0,00 %
NSTAR Electric Co.	\$ 100.000	3,20 %	15.05.2027	101.176	0,00 %
ConocoPhillips Co.	\$ 75.000	5,95 %	15.03.2046	101.157	0,00 %
Marriott International, Inc.	\$ 100.000	3,13 %	15.10.2021	101.140	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.000	2,79 %	25.01.2022	101.136	0,00 %
XLIT Ltd.	\$ 100.000	4,45 %	31.03.2025	101.069	0,00 %
Dr Pepper Snapple Group, Inc.	\$ 100.000	3,13 %	15.12.2023	101.058	0,00 %
Keysight Technologies, Inc.	\$ 100.000	3,30 %	30.10.2019	101.054	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 100.000	3,32 %	15.10.2050	101.037	0,00 %
Andeavor Logistics LP/Tesoro Logistics Finance Corp.	\$ 100.000	4,25 %	01.12.2027	101.000	0,00 %
RPM International, Inc.	\$ 100.000	3,75 %	15.03.2027	100.971	0,00 %
University of Notre Dame du Lac	\$ 100.000	3,44 %	15.02.2045	100.947	0,00 %
Dr Pepper Snapple Group, Inc.	\$ 100.000	3,40 %	15.11.2025	100.931	0,00 %
Emerson Electric Co.	\$ 100.000	2,63 %	01.12.2021	100.929	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.000	2,72 %	25.06.2022	100.927	0,00 %
Air Lease Corp.	\$ 100.000	3,38 %	15.01.2019	100.904	0,00 %
Fortune Brands Home & Security, Inc.	\$ 100.000	3,00 %	15.06.2020	100.898	0,00 %
Microsoft Corp.	\$ 100.000	2,65 %	03.11.2022	100.883	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 92.181	5,50 %	01.12.2038	100.857	0,00 %
Parker-Hannifin Corp.	\$ 100.000	3,25 %	01.03.2027	100.832	0,00 %
FedEx Corp.	\$ 100.000	3,25 %	01.04.2026	100.831	0,00 %
DBJPM 17-C6 Mortgage Trust [^]	\$ 100.000	3,56 %	10.06.2050	100.806	0,00 %
Southwest Gas Corp.	\$ 100.000	3,80 %	29.09.2046	100.805	0,00 %
Highwoods Realty LP	\$ 100.000	3,20 %	15.06.2021	100.798	0,00 %
AmerisourceBergen Corp.	\$ 100.000	3,25 %	01.03.2025	100.797	0,00 %
Xilinx, Inc.	\$ 100.000	3,00 %	15.03.2021	100.775	0,00 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 100.000	3,14 %	10.02.2048	100.767	0,00 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 100.000	2,50 %	23.11.2020	100.753	0,00 %
Federal National Mortgage Association [^]	\$ 100.000	3,09 %	25.04.2027	100.728	0,00 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 100.000	2,60 %	17.08.2020	100.713	0,00 %
Kroger Co.	\$ 100.000	3,70 %	01.08.2027	100.685	0,00 %
Chevron Corp.	\$ 100.000	2,90 %	03.03.2024	100.677	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
O'Reilly Automotive, Inc.	\$ 100.000	3,55 %	15.03.2026	100.674	0,00 %
CA, Inc.	\$ 100.000	3,60 %	15.08.2022	100.655	0,00 %
HSBC USA, Inc.	\$ 100.000	2,75 %	07.08.2020	100.651	0,00 %
RWJ Barnabas Health, Inc.	\$ 100.000	3,95 %	01.07.2046	100.602	0,00 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 100.000	3,57 %	06.03.2045	100.577	0,00 %
Hershey Co.	\$ 100.000	3,20 %	21.08.2025	100.575	0,00 %
University of Notre Dame du Lac	\$ 100.000	3,39 %	15.02.2048	100.572	0,00 %
Affiliated Managers Group, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	01.08.2025	100.565	0,00 %
Phillips 66 Partners LP	\$ 100.000	3,61 %	15.02.2025	100.563	0,00 %
University of Texas System	\$ 100.000	3,35 %	15.08.2047	100.556	0,00 %
Lam Research Corp.	\$ 100.000	2,80 %	15.06.2021	100.541	0,00 %
Motorola Solutions, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	01.03.2023	100.492	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 94.120	4,50 %	01.08.2041	100.475	0,00 %
FLIR Systems, Inc.	\$ 100.000	3,13 %	15.06.2021	100.456	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 93.996	4,50 %	01.08.2041	100.448	0,00 %
MidAmerican Energy Co.	\$ 100.000	3,10 %	01.05.2027	100.446	0,00 %
Eli Lilly & Co.	\$ 100.000	2,75 %	01.06.2025	100.437	0,00 %
TC PipeLines LP	\$ 100.000	3,90 %	25.05.2027	100.432	0,00 %
Chevron Phillips Chemical Co. LLC/Chevron Phillips Chemical Co. LP	\$ 100.000	3,40 %	01.12.2026	100.423	0,00 %
Altera Corp.	\$ 100.000	2,50 %	15.11.2018	100.415	0,00 %
Cleco Corporate Holdings LLC	\$ 100.000	3,74 %	01.05.2026	100.413	0,00 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	\$ 100.000	3,00 %	15.04.2023	100.412	0,00 %
Sysco Corp.	\$ 100.000	3,30 %	15.07.2026	100.410	0,00 %
Realty Income Corp.	\$ 100.000	3,65 %	15.01.2028	100.374	0,00 %
Noble Energy, Inc.	\$ 100.000	3,85 %	15.01.2028	100.293	0,00 %
Sherwin-Williams Co.	\$ 100.000	3,13 %	01.06.2024	100.290	0,00 %
Compass Bank	\$ 100.000	2,75 %	29.09.2019	100.290	0,00 %
Coca-Cola Co.	\$ 100.000	2,90 %	25.05.2027	100.289	0,00 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 100.000	3,70 %	15.04.2046	100.289	0,00 %
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	\$ 100.000	2,75 %	15.01.2020	100.277	0,00 %
Norfolk Southern Corp.	\$ 100.000	2,90 %	15.02.2023	100.264	0,00 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 100.000	2,50 %	01.12.2019	100.253	0,00 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 100.000	3,45 %	20.05.2025	100.228	0,00 %
Packaging Corp. of America	\$ 100.000	3,40 %	15.12.2027	100.213	0,00 %
Activision Blizzard, Inc.	\$ 100.000	3,40 %	15.06.2027	100.204	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 98.796	3,00 %	15.10.2042	100.187	0,00 %
Quest Diagnostics, Inc.	\$ 100.000	3,45 %	01.06.2026	100.183	0,00 %
Scripps Networks Interactive, Inc.	\$ 100.000	2,75 %	15.11.2019	100.174	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.000	2,64 %	25.01.2023	100.161	0,00 %
Automatic Data Processing, Inc.	\$ 100.000	2,25 %	15.09.2020	100.158	0,00 %
John Deere Capital Corp.	\$ 100.000	2,45 %	11.09.2020	100.156	0,00 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 100.000	2,70 %	24.05.2019	100.144	0,00 %
Packaging Corp. of America	\$ 100.000	2,45 %	15.12.2020	100.144	0,00 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	\$ 100.000	2,15 %	15.07.2021	100.130	0,00 %
Dr Pepper Snapple Group, Inc.	\$ 100.000	3,43 %	15.06.2027	100.123	0,00 %
Manufacturers & Traders Trust Co.	\$ 100.000	2,30 %	30.01.2019	100.101	0,00 %
MetLife, Inc.	\$ 100.000	3,00 %	01.03.2025	100.097	0,00 %
Chevron Corp.	\$ 100.000	2,50 %	03.03.2022	100.090	0,00 %
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	\$ 100.000	2,40 %	15.09.2019	100.060	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 100.000	1,88 %	19.02.2019	100.046	0,00 %
ITC Holdings Corp.	\$ 100.000	3,35 %	15.11.2027	100.043	0,00 %
Clorox Co.	\$ 100.000	3,10 %	01.10.2027	100.043	0,00 %
Kaiser Foundation Hospitals	\$ 100.000	3,15 %	01.05.2027	100.042	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 100.000	2,38 %	23.07.2019	100.032	0,00 %
Massachusetts Institute of Technology	\$ 100.000	3,89 %	01.07.2116	100.031	0,00 %
Allergan Funding SCS	\$ 100.000	2,45 %	15.06.2019	100.023	0,00 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 100.000	2,15 %	01.02.2019	100.017	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 88.889	6,00 %	01.03.2033	100.014	0,00 %
General Mills, Inc.	\$ 100.000	2,20 %	21.10.2019	100.011	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 75.000	6,25 %	15.05.2029	100.005	0,00 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 100.000	3,05 %	30.11.2022	99.977	0,00 %
Northern Trust Corp.	\$ 100.000	2,38 %	02.08.2022	99.968	0,00 %
Mastercard, Inc.	\$ 100.000	2,95 %	21.11.2026	99.964	0,00 %
WEC Energy Group, Inc.	\$ 100.000	2,45 %	15.06.2020	99.955	0,00 %
DTE Energy Co.	\$ 100.000	2,40 %	01.12.2019	99.938	0,00 %
Ally Master Owner Trust	\$ 100.000	1,63 %	15.05.2020	99.937	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2015	\$ 100.000	1,60 %	15.04.2021	99.937	0,00 %
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	\$ 100.000	2,80 %	15.01.2023	99.929	0,00 %
Pricoa Global Funding I	\$ 100.000	2,20 %	16.05.2019	99.928	0,00 %
Walt Disney Co.	\$ 100.000	2,15 %	17.09.2020	99.923	0,00 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 100.000	3,50 %	01.09.2023	99.922	0,00 %
Barclays Dryrock Issuance Trust 2015	\$ 100.000	1,56 %	15.03.2021	99.921	0,00 %
Western Gas Partners LP	\$ 100.000	3,95 %	01.06.2025	99.905	0,00 %
Cleveland Electric Illuminating Co.	\$ 100.000	3,50 %	01.04.2028	99.873	0,00 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 100.000	2,60 %	30.11.2020	99.863	0,00 %
Cigna Corp.	\$ 100.000	3,88 %	15.10.2047	99.838	0,00 %
Air Lease Corp.	\$ 100.000	3,63 %	01.12.2027	99.835	0,00 %
Sales Tax Securitization Corp.	\$ 100.000	3,59 %	01.01.2043	99.833	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.000	1,75 %	30.05.2019	99.815	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.000	2,51 %	25.11.2022	99.789	0,00 %
John Deere Capital Corp.	\$ 100.000	2,20 %	13.03.2020	99.788	0,00 %
Merck & Co., Inc.	\$ 100.000	2,35 %	10.02.2022	99.786	0,00 %
Church & Dwight Co., Inc.	\$ 100.000	2,45 %	15.12.2019	99.786	0,00 %
Eversource Energy	\$ 100.000	2,75 %	15.03.2022	99.782	0,00 %
Celgene Corp.	\$ 100.000	2,25 %	15.05.2019	99.781	0,00 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	\$ 100.000	4,45 %	15.08.2045	99.779	0,00 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 100.000	1,85 %	23.11.2018	99.751	0,00 %
Corning, Inc.	\$ 100.000	2,90 %	15.05.2022	99.735	0,00 %
Public Service Electric & Gas Co.	\$ 100.000	3,00 %	15.05.2027	99.719	0,00 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 100.000	1,88 %	15.01.2019	99.717	0,00 %
Hudson Pacific Properties LP	\$ 100.000	3,95 %	01.11.2027	99.714	0,00 %
Entergy Louisiana LLC	\$ 100.000	3,12 %	01.09.2027	99.712	0,00 %
PacifiCorp	\$ 75.000	6,10 %	01.08.2036	99.706	0,00 %
Amazon.com, Inc.	\$ 100.000	2,80 %	22.08.2024	99.671	0,00 %
ITC Holdings Corp.	\$ 100.000	2,70 %	15.11.2022	99.660	0,00 %
Campbell Soup Co.	\$ 100.000	3,30 %	19.03.2025	99.650	0,00 %
Sherwin-Williams Co.	\$ 100.000	2,75 %	01.06.2022	99.650	0,00 %
Healthcare Trust of America Holdings LP	\$ 100.000	3,75 %	01.07.2027	99.582	0,00 %
Healthcare Trust of America Holdings LP	\$ 100.000	2,95 %	01.07.2022	99.572	0,00 %
Molson Coors Brewing Co.	\$ 100.000	1,90 %	15.03.2019	99.560	0,00 %
American Electric Power Co., Inc.	\$ 100.000	2,15 %	13.11.2020	99.534	0,00 %
Molson Coors Brewing Co.	\$ 100.000	2,25 %	15.03.2020	99.511	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2017	\$ 100.000	2,11 %	17.10.2022	99.493	0,00 %
Kansas City Southern	\$ 100.000	3,00 %	15.05.2023	99.484	0,00 %
Kellogg Co.	\$ 100.000	3,25 %	01.04.2026	99.464	0,00 %
Anthem, Inc.	\$ 90.000	4,65 %	15.01.2043	99.452	0,00 %
Constellation Brands, Inc.	\$ 100.000	2,70 %	09.05.2022	99.450	0,00 %
CSX Corp.	\$ 100.000	3,80 %	01.11.2046	99.419	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 100.000	1,95 %	23.07.2019	99.417	0,00 %
Costco Wholesale Corp.	\$ 100.000	2,15 %	18.05.2021	99.403	0,00 %
Chevron Corp.	\$ 100.000	1,99 %	03.03.2020	99.351	0,00 %
NiSource Finance Corp.	\$ 100.000	2,65 %	17.11.2022	99.344	0,00 %
Public Storage	\$ 100.000	3,09 %	15.09.2027	99.330	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.000	2,45 %	25.08.2023	99.327	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2017	\$ 100.000	1,67 %	15.06.2021	99.323	0,00 %
Sempra Energy	\$ 100.000	2,88 %	01.10.2022	99.297	0,00 %
Chase Issuance Trust	\$ 100.000	1,84 %	15.04.2022	99.284	0,00 %
Toyota Auto Receivables 2016	\$ 100.000	1,14 %	17.08.2020	99.284	0,00 %
Sysco Corp.	\$ 100.000	2,60 %	12.06.2022	99.274	0,00 %
Estee Lauder Cos, Inc.	\$ 100.000	1,80 %	07.02.2020	99.268	0,00 %
Martin Marietta Materials, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	15.12.2027	99.234	0,00 %
Atmos Energy Corp.	\$ 100.000	3,00 %	15.06.2027	99.230	0,00 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 100.000	3,30 %	01.12.2026	99.201	0,00 %
Southern Power Co.	\$ 100.000	1,95 %	15.12.2019	99.198	0,00 %
Analog Devices, Inc.	\$ 100.000	2,50 %	05.12.2021	99.168	0,00 %
Rockwell Automation, Inc.	\$ 100.000	2,05 %	01.03.2020	99.164	0,00 %
eBay, Inc.	\$ 100.000	2,15 %	05.06.2020	99.161	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 93.872	4,00 %	01.02.2041	99.122	0,00 %
Eversource Energy	\$ 100.000	2,90 %	01.10.2024	99.089	0,00 %
Consolidated Edison, Inc.	\$ 100.000	2,00 %	15.03.2020	99.064	0,00 %
Intercontinental Exchange, Inc.	\$ 100.000	2,35 %	15.09.2022	99.063	0,00 %
Tanger Properties LP	\$ 100.000	3,88 %	15.07.2027	99.059	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Physicians Realty LP	\$ 100.000	3,95 %	15.01.2028	99.056	0,00 %
Southern Power Co.	\$ 100.000	2,50 %	15.12.2021	99.052	0,00 %
Barclays Dryrock Issuance Trust 2016	\$ 100.000	1,52 %	16.05.2022	99.045	0,00 %
Omega Healthcare Investors, Inc.	\$ 100.000	4,75 %	15.01.2028	99.000	0,00 %
Leggett & Platt, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	15.11.2027	98.972	0,00 %
American Electric Power Co., Inc.	\$ 100.000	3,20 %	13.11.2027	98.958	0,00 %
eBay, Inc.	\$ 100.000	2,75 %	30.01.2023	98.947	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 100.000	2,40 %	03.05.2023	98.936	0,00 %
Cardinal Health, Inc.	\$ 100.000	4,37 %	15.06.2047	98.922	0,00 %
PACCAR Financial Corp.	\$ 100.000	1,30 %	10.05.2019	98.921	0,00 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2016	\$ 100.000	1,58 %	15.09.2022	98.911	0,00 %
Activision Blizzard, Inc.	\$ 100.000	2,60 %	15.06.2022	98.901	0,00 %
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	\$ 100.000	3,45 %	30.04.2025	98.885	0,00 %
Fifth Third Bank	\$ 100.000	1,63 %	27.09.2019	98.869	0,00 %
Protective Life Global Funding	\$ 100.000	1,56 %	13.09.2019	98.845	0,00 %
National Retail Properties, Inc.	\$ 100.000	3,60 %	15.12.2026	98.834	0,00 %
Union Pacific Corp.	\$ 100.000	2,75 %	01.03.2026	98.811	0,00 %
PepsiCo, Inc.	\$ 100.000	1,35 %	04.10.2019	98.761	0,00 %
NSTAR Electric Co.	\$ 100.000	2,38 %	15.10.2022	98.750	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 100.000	2,59 %	25.12.2024	98.735	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 93.286	4,50 %	15.04.2039	98.631	0,00 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 100.000	2,50 %	01.09.2023	98.568	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 94.240	4,00 %	15.04.2045	98.546	0,00 %
San Jose Redevelopment Agency Successor Agency	\$ 100.000	3,38 %	01.08.2034	98.520	0,00 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	\$ 100.000	3,25 %	15.06.2026	98.511	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 96.511	3,00 %	01.11.2027	98.491	0,00 %
Johnson & Johnson	\$ 100.000	1,65 %	01.03.2021	98.465	0,00 %
New York Life Global Funding	\$ 100.000	2,30 %	10.06.2022	98.442	0,00 %
Visa, Inc.	\$ 100.000	2,15 %	15.09.2022	98.435	0,00 %
Mastercard, Inc.	\$ 100.000	2,00 %	21.11.2021	98.434	0,00 %
Kimberly-Clark Corp.	\$ 100.000	2,40 %	01.06.2023	98.425	0,00 %
Kellogg Co.	\$ 100.000	2,65 %	01.12.2023	98.411	0,00 %
Air Lease Corp.	\$ 100.000	2,75 %	15.01.2023	98.379	0,00 %
Public Service Electric & Gas Co.	\$ 100.000	1,90 %	15.03.2021	98.362	0,00 %
CVS Health Corp.	\$ 100.000	2,75 %	01.12.2022	98.350	0,00 %
Marriott International, Inc.	\$ 100.000	3,13 %	15.06.2026	98.323	0,00 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 100.000	2,60 %	01.12.2021	98.319	0,00 %
Autodesk, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	15.06.2027	98.303	0,00 %
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 100.000	4,50 %	15.07.2044	98.276	0,00 %
Public Service Electric & Gas Co.	\$ 100.000	2,38 %	15.05.2023	98.264	0,00 %
Marriott International, Inc.	\$ 100.000	2,30 %	15.01.2022	98.238	0,00 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 100.000	1,88 %	25.02.2021	98.195	0,00 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	\$ 100.000	4,00 %	01.10.2027	98.180	0,00 %
Hyundai Capital America	\$ 100.000	1,75 %	27.09.2019	98.128	0,00 %
Tennessee Valley Authority	\$ 73.000	5,25 %	15.09.2039	98.022	0,00 %
Jackson National Life Global Funding	\$ 100.000	2,10 %	25.10.2021	98.000	0,00 %
Arrow Electronics, Inc.	\$ 100.000	3,25 %	08.09.2024	97.904	0,00 %
Brighthouse Financial Inc.	\$ 100.000	3,70 %	22.06.2027	97.882	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 94.148	3,50 %	15.07.2042	97.847	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 91.827	4,50 %	01.09.2040	97.752	0,00 %
Kohl's Corp.	\$ 100.000	5,55 %	17.07.2045	97.746	0,00 %
Buckeye Partners LP	\$ 100.000	3,95 %	01.12.2026	97.686	0,00 %
Brixmor Operating Partnership LP	\$ 100.000	3,25 %	15.09.2023	97.679	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 100.000	2,50 %	09.02.2025	97.672	0,00 %
National Oilwell Varco, Inc.	\$ 100.000	2,60 %	01.12.2022	97.671	0,00 %
Procter & Gamble Co.	\$ 100.000	1,70 %	03.11.2021	97.649	0,00 %
Smithfield Foods, Inc.	\$ 100.000	2,65 %	03.10.2021	97.603	0,00 %
Wabtec Corp.	\$ 100.000	3,45 %	15.11.2026	97.571	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 86.712	6,00 %	01.03.2033	97.541	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 100.000	1,85 %	19.08.2021	97.538	0,00 %
United Technologies Corp.	\$ 100.000	1,95 %	01.11.2021	97.521	0,00 %
Hospitality Properties Trust	\$ 100.000	3,95 %	15.01.2028	97.437	0,00 %
President & Fellows of Harvard College	\$ 100.000	3,15 %	15.07.2046	97.172	0,00 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	\$ 100.000	3,60 %	01.11.2024	97.135	0,00 %
Cigna Corp.	\$ 100.000	3,05 %	15.10.2027	97.066	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 96.208	2,50 %	01.03.2028	97.048	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeitsdatum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt-nettovermögens
Wells Fargo & Co.	CAD 125.000	2,98 %	19.05.2026	97.001	0,00 %
American Airlines 2016-1 Klasse AA Pass Through Trust	\$ 95.159	3,58 %	15.01.2028	96.987	0,00 %
Baxter International, Inc.	\$ 100.000	1,70 %	15.08.2021	96.963	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 100.000	2,25 %	19.08.2023	96.926	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 91.096	4,50 %	01.04.2031	96.913	0,00 %
Entergy Corp.	\$ 100.000	2,95 %	01.09.2026	96.906	0,00 %
Duke Energy Florida LLC	\$ 100.000	3,40 %	01.10.2046	96.891	0,00 %
Protective Life Global Funding	\$ 100.000	2,00 %	14.09.2021	96.674	0,00 %
Altria Group, Inc.	\$ 100.000	2,63 %	16.09.2026	96.663	0,00 %
Duke Energy Florida Project Finance LLC	\$ 100.000	2,54 %	01.09.2029	96.559	0,00 %
Catholic Health Initiatives	\$ 100.000	4,35 %	01.11.2042	96.487	0,00 %
Agilent Technologies, Inc.	\$ 100.000	3,05 %	22.09.2026	96.462	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 95.517	2,50 %	01.05.2028	96.351	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 88.029	5,50 %	01.02.2034	96.299	0,00 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	\$ 100.000	3,63 %	01.06.2024	96.280	0,00 %
Seagate HDD Cayman	\$ 100.000	5,75 %	01.12.2034	96.234	0,00 %
United Technologies Corp.	\$ 100.000	2,65 %	01.11.2026	96.212	0,00 %
CBS Corp.	\$ 100.000	3,38 %	15.02.2028	96.091	0,00 %
VWV Grainger, Inc.	\$ 100.000	3,75 %	15.05.2046	96.054	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	£ 50.000	7,25 %	10.04.2028	95.931	0,00 %
CSX Corp.	\$ 100.000	2,60 %	01.11.2026	95.456	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 87.997	5,00 %	15.09.2039	95.363	0,00 %
South Carolina Public Service Authority	\$ 100.000	2,39 %	01.12.2023	95.197	0,00 %
Baxter International, Inc.	\$ 100.000	2,60 %	15.08.2026	95.187	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 90.394	4,00 %	01.01.2041	95.065	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 88.398	4,50 %	01.09.2042	94.581	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 93.627	2,50 %	01.11.2027	94.446	0,00 %
Wal-Mart Stores, Inc.	£ 50.000	4,88 %	19.01.2039	94.299	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 88.308	4,50 %	01.03.2042	94.244	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 86.593	5,00 %	20.09.2040	94.242	0,00 %
AT&T, Inc.	\$ 100.000	4,30 %	15.12.2042	93.826	0,00 %
TJX Cos, Inc.	\$ 100.000	2,25 %	15.09.2026	93.819	0,00 %
Hershey Co.	\$ 100.000	2,30 %	15.08.2026	93.812	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 94.351	2,62 %	25.12.2024	93.660	0,00 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 85.000	5,00 %	15.07.2035	92.782	0,00 %
Baxter International, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	15.08.2046	92.102	0,00 %
HCP, Inc.	\$ 90.000	3,88 %	15.08.2024	92.058	0,00 %
Hyundai Capital America	\$ 100.000	2,75 %	27.09.2026	92.013	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 84.687	5,00 %	01.08.2040	91.215	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 86.910	3,50 %	01.12.2025	90.744	0,00 %
Raymond James Financial, Inc.	\$ 90.000	3,63 %	15.09.2026	90.334	0,00 %
Bed Bath & Beyond, Inc.	\$ 100.000	4,92 %	01.08.2034	90.323	0,00 %
General Motors Co.	\$ 85.000	5,00 %	01.04.2035	90.209	0,00 %
US Treasury Bond	\$ 75.000	8,13 %	15.05.2021	89.707	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 81.534	5,50 %	01.10.2033	89.489	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 82.656	5,00 %	01.08.2035	89.108	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 86.308	4,45 %	25.09.2019	89.010	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 82.432	5,00 %	01.10.2041	88.738	0,00 %
Guardian Life Global Funding	\$ 90.000	2,00 %	26.04.2021	88.478	0,00 %
Exelon Corp.	\$ 75.000	5,10 %	15.06.2045	88.477	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 80.750	5,50 %	20.06.2038	87.861	0,00 %
CRH America, Inc.	\$ 75.000	5,13 %	18.05.2045	87.530	0,00 %
Sempra Energy	\$ 85.000	3,75 %	15.11.2025	87.010	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 83.342	3,50 %	20.12.2025	86.636	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 86.469	3,00 %	01.11.2042	86.532	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 80.437	4,50 %	01.05.2040	86.060	0,00 %
Freddie Mac Gold Pool	\$ 78.573	5,50 %	01.06.2033	85.962	0,00 %
Brooklyn Union Gas Co.	\$ 75.000	4,50 %	10.03.2046	85.871	0,00 %
Guardian Life Insurance Co. of America	\$ 75.000	4,88 %	19.06.2064	85.760	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 80.109	4,50 %	01.06.2041	85.498	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 81.177	4,00 %	01.07.2044	85.214	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 80.226	4,00 %	15.10.2040	85.038	0,00 %
Pennsylvania Turnpike Commission	\$ 65.000	5,51 %	01.12.2045	85.023	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 79.577	4,50 %	01.04.2041	84.970	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 78.740	5,00 %	15.02.2039	84.940	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 79.286	5,00 %	20.05.2036	84.938	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeitsdatum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Microsoft Corp.	\$ 75.000	4,20 %	03.11.2035	84.869	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 86.161	2,00 %	01.08.2028	84.778	0,00 %
American Airlines 2014-1 Klasse A Pass Through Trust	\$ 83.070	3,70 %	01.10.2026	84.635	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 75.263	6,00 %	01.11.2038	84.534	0,00 %
Masco Corp.	\$ 76.000	5,95 %	15.03.2022	84.260	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 76.712	5,50 %	01.01.2035	84.221	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 83.707	3,00 %	01.08.2042	84.157	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 76.506	5,50 %	01.02.2035	83.996	0,00 %
Cleveland Clinic Foundation	\$ 75.000	4,86 %	01.01.2114	83.924	0,00 %
State Public School Building Authority	\$ 75.000	5,00 %	15.09.2027	83.881	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 78.041	4,50 %	15.05.2040	83.858	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 83.522	3,00 %	01.12.2045	83.713	0,00 %
Alabama Power Co.	\$ 75.000	4,30 %	02.01.2046	83.593	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 80.621	3,50 %	01.12.2040	83.509	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 81.368	3,00 %	01.12.2026	83.281	0,00 %
Black Hills Corp.	\$ 80.000	3,95 %	15.01.2026	82.589	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 75.537	5,50 %	20.07.2039	82.551	0,00 %
Concho Resources, Inc.	\$ 75.000	4,88 %	01.10.2047	81.937	0,00 %
Southern Power Co.	\$ 75.000	4,95 %	15.12.2046	81.925	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 78.158	3,50 %	15.05.2026	81.294	0,00 %
Procter & Gamble Co.	€ 50.000	4,88 %	11.05.2027	81.046	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 74.009	5,50 %	01.01.2035	80.966	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 72.282	6,00 %	01.12.2036	80.951	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 71.706	6,00 %	01.09.2037	80.686	0,00 %
Southwest Airlines Co.	\$ 80.000	2,65 %	05.11.2020	80.350	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 74.647	5,00 %	01.11.2038	80.196	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 80.000	3,20 %	02.11.2027	80.169	0,00 %
Xerox Corp.	\$ 75.000	6,75 %	15.12.2039	80.065	0,00 %
Bank of America Corp.	\$ 75.000	4,45 %	03.03.2026	80.050	0,00 %
Principal Financial Group, Inc.	\$ 75.000	4,30 %	15.11.2046	79.988	0,00 %
Avnet, Inc.	\$ 75.000	5,88 %	15.06.2020	79.801	0,00 %
Regency Centers LP	\$ 80.000	3,60 %	01.02.2027	79.726	0,00 %
Public Service Electric & Gas Co.	\$ 75.000	3,80 %	01.03.2046	79.371	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 75.443	4,00 %	15.10.2040	79.259	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 77.543	3,00 %	01.07.2029	79.230	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 75.336	4,00 %	01.11.2043	79.070	0,00 %
Bay Area Toll Authority	\$ 50.000	6,91 %	01.10.2050	78.972	0,00 %
California State University	\$ 75.000	3,90 %	01.11.2047	78.881	0,00 %
S&P Global, Inc.	\$ 75.000	4,00 %	15.06.2025	78.875	0,00 %
Crown Castle International Corp.	\$ 75.000	4,75 %	15.05.2047	78.870	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 75.000	3,84 %	15.09.2058	78.842	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 75.000	4,40 %	22.07.2020	78.789	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 74.796	4,00 %	01.01.2042	78.677	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 73.083	5,00 %	01.05.2040	78.674	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 73.325	4,50 %	01.09.2035	78.592	0,00 %
CCRE25Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 75.000	3,76 %	10.08.2048	78.559	0,00 %
Federal Home Loan Banks	\$ 75.000	4,13 %	13.03.2020	78.452	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 74.411	4,00 %	01.02.2041	78.374	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 72.443	5,00 %	01.01.2038	78.369	0,00 %
O'Reilly Automotive, Inc.	\$ 75.000	3,80 %	01.09.2022	78.338	0,00 %
Indianapolis Power & Light Co.	\$ 75.000	4,05 %	01.05.2046	78.316	0,00 %
Unum Group	\$ 75.000	4,00 %	15.03.2024	78.045	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 74.351	4,00 %	01.10.2041	78.044	0,00 %
Newell Brands Inc.	\$ 75.000	4,00 %	01.12.2024	77.963	0,00 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	\$ 75.000	3,80 %	30.09.2047	77.948	0,00 %
CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust	\$ 75.000	3,72 %	15.08.2048	77.794	0,00 %
Agilent Technologies, Inc.	\$ 75.000	3,88 %	15.07.2023	77.761	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 75.000	4,00 %	15.11.2057	77.691	0,00 %
Los Angeles County Public Works Financing Authority	\$ 50.000	7,62 %	01.08.2040	77.669	0,00 %
Citigroup, Inc.	\$ 75.000	3,75 %	16.06.2024	77.500	0,00 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates^	\$ 75.000	3,30 %	25.11.2027	77.425	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 74.910	3,50 %	01.08.2026	77.391	0,00 %
Northwestern University	\$ 75.000	3,66 %	01.12.2057	77.375	0,00 %
Regency Centers LP	\$ 75.000	4,40 %	01.02.2047	77.327	0,00 %
American Tower Corp.	\$ 75.000	4,00 %	01.06.2025	77.290	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014	\$ 75.000	3,49 %	15.01.2048	77.245	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015	\$ 75.000	3,53 %	15.10.2048	77.240	0,00 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 75.000	3,45 %	15.09.2021	77.221	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 72.060	5,00 %	20.06.2038	77.050	0,00 %
Citigroup, Inc.	\$ 75.000	3,70 %	12.01.2026	77.022	0,00 %
CBS Corp.	\$ 75.000	3,70 %	15.08.2024	76.973	0,00 %
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017	\$ 75.000	3,41 %	15.10.2050	76.891	0,00 %
Baltimore Gas & Electric Co.	\$ 75.000	3,75 %	15.08.2047	76.847	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 74.360	3,50 %	01.08.2026	76.818	0,00 %
CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust	\$ 75.000	3,51 %	15.04.2050	76.783	0,00 %
Louisville Gas & Electric Co.	\$ 75.000	3,30 %	01.10.2025	76.780	0,00 %
Public Service Electric & Gas Co.	\$ 75.000	3,60 %	01.12.2047	76.752	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 71.092	5,00 %	01.08.2040	76.564	0,00 %
Masco Corp.	\$ 75.000	4,50 %	15.05.2047	76.560	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 75.000	3,06 %	25.12.2024	76.438	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 72.948	4,00 %	01.01.2041	76.418	0,00 %
Ventas Realty LP	\$ 75.000	3,85 %	01.04.2027	76.375	0,00 %
Ares Capital Corp.	\$ 75.000	3,88 %	15.01.2020	76.167	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015	\$ 75.000	3,25 %	15.02.2048	76.157	0,00 %
Northern States Power Co.	\$ 75.000	3,60 %	15.05.2046	76.153	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017	\$ 75.000	3,28 %	15.11.2052	76.130	0,00 %
Owens Corning	\$ 58.000	7,00 %	01.12.2036	76.125	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 74.478	3,00 %	20.10.2029	76.115	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 76.011	3,00 %	01.12.2046	76.067	0,00 %
Discovery Communications LLC	\$ 75.000	3,80 %	13.03.2024	76.055	0,00 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017^	\$ 75.000	3,74 %	15.08.2050	75.922	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015	\$ 75.000	3,23 %	15.10.2048	75.913	0,00 %
Scripps Networks Interactive, Inc.	\$ 75.000	3,50 %	15.06.2022	75.911	0,00 %
Quest Diagnostics, Inc.	\$ 75.000	3,50 %	30.03.2025	75.887	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 68.496	5,50 %	15.07.2034	75.809	0,00 %
Union Pacific Corp.	\$ 75.000	3,80 %	01.10.2051	75.795	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 75.000	3,01 %	25.07.2025	75.757	0,00 %
Mount Sinai Hospitals Group, Inc.	\$ 75.000	3,98 %	01.07.2048	75.676	0,00 %
Gilead Sciences, Inc. ¹	\$ 75.000	2,55 %	01.09.2020	75.656	0,00 %
DDR Corp.	\$ 75.000	3,90 %	15.08.2024	75.588	0,00 %
AvalonBay Communities, Inc.	\$ 75.000	3,35 %	15.05.2027	75.512	0,00 %
United Airlines 2016-1 Klasse A Pass Through Trust	\$ 75.000	3,45 %	07.07.2028	75.506	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 75.000	2,57 %	25.09.2020	75.450	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 75.000	3,13 %	15.11.2027	75.446	0,00 %
Permanent University Fund-University of Texas System	\$ 75.000	3,38 %	01.07.2047	75.333	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 70.140	4,50 %	20.11.2040	75.292	0,00 %
Farmers Exchange Capital III^	\$ 70.000	5,45 %	15.10.2054	75.199	0,00 %
Seagate HDD Cayman	\$ 75.000	4,88 %	01.03.2024	75.094	0,00 %
Church & Dwight Co., Inc.	\$ 75.000	3,95 %	01.08.2047	75.079	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 74.032	4,00 %	01.10.2019	75.068	0,00 %
Moody's Corp.	\$ 75.000	2,75 %	15.12.2021	75.042	0,00 %
Royal Caribbean Cruises Ltd.	\$ 75.000	2,65 %	28.11.2020	75.000	0,00 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 75.000	1,60 %	17.05.2021	74.940	0,00 %
GM Financial Automobile Leasing Trust 2016	\$ 75.000	1,62 %	20.09.2019	74.896	0,00 %
Walt Disney Co.	\$ 75.000	2,45 %	04.03.2022	74.896	0,00 %
Duke Energy Florida LLC	\$ 75.000	2,10 %	15.12.2019	74.839	0,00 %
Stryker Corp.	\$ 75.000	2,00 %	08.03.2019	74.831	0,00 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 75.000	3,00 %	15.05.2026	74.793	0,00 %
BMW Vehicle Lease Trust 2017	\$ 75.000	2,07 %	20.10.2020	74.782	0,00 %
Wisconsin Power & Light Co.	\$ 75.000	3,05 %	15.10.2027	74.781	0,00 %
State of California	\$ 75.000	2,37 %	01.04.2022	74.763	0,00 %
Eaton Corp.	\$ 75.000	3,92 %	15.09.2047	74.754	0,00 %
Bristol-Myers Squibb Co.	\$ 75.000	1,75 %	01.03.2019	74.740	0,00 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	\$ 75.000	2,95 %	01.04.2025	74.734	0,00 %
Phillips 66 Partners LP	\$ 75.000	3,75 %	01.03.2028	74.720	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 75.000	3,08 %	25.01.2031	74.667	0,00 %
Enable Midstream Partners LP	\$ 75.000	2,40 %	15.05.2019	74.586	0,00 %
Southern Co.	\$ 75.000	1,85 %	01.07.2019	74.569	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013	\$ 70.000	4,13 %	15.11.2045	74.541	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2017	\$ 75.000	2,33 %	15.05.2023	74.484	0,00 %
Colgate-Palmolive Co.	\$ 75.000	2,30 %	03.05.2022	74.464	0,00 %
Synovus Financial Corp.	\$ 75.000	3,13 %	01.11.2022	74.442	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeitsdatum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
EQT Corp.	\$ 75.000	2,50 %	01.10.2020	74.410	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2016	\$ 75.000	1,39 %	17.05.2021	74.380	0,00 %
Comcast Corp.	\$ 72.000	3,97 %	01.11.2047	74.369	0,00 %
Federal Home Loan Banks	\$ 75.000	2,13 %	10.03.2023	74.324	0,00 %
eBay, Inc.	\$ 75.000	3,60 %	05.06.2027	74.321	0,00 %
Northern Trust Corp.^	\$ 75.000	3,38 %	08.05.2032	74.289	0,00 %
Nissan Master Owner Trust Receivables	\$ 75.000	1,54 %	15.06.2021	74.283	0,00 %
Colgate-Palmolive Co.	\$ 75.000	2,25 %	15.11.2022	74.264	0,00 %
NetApp, Inc.	\$ 75.000	3,30 %	29.09.2024	74.262	0,00 %
PACCAR Financial Corp.	\$ 75.000	2,05 %	13.11.2020	74.239	0,00 %
Nissan Auto Receivables 2016-C Owner Trust	\$ 75.000	1,18 %	15.01.2021	74.220	0,00 %
PepsiCo, Inc.	\$ 75.000	2,25 %	02.05.2022	74.189	0,00 %
Hyundai Auto Receivables Trust 2016	\$ 75.000	1,29 %	15.04.2021	74.161	0,00 %
Commonwealth Edison Co.	\$ 75.000	2,95 %	15.08.2027	74.103	0,00 %
Church & Dwight Co., Inc.	\$ 75.000	2,45 %	01.08.2022	74.086	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 72.409	3,00 %	01.01.2026	74.077	0,00 %
Molson Coors Brewing Co.	\$ 75.000	1,45 %	15.07.2019	73.897	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 75.000	2,70 %	25.02.2026	73.812	0,00 %
Church & Dwight Co., Inc.	\$ 75.000	3,15 %	01.08.2027	73.812	0,00 %
MetLife, Inc.	\$ 50.000	9,25 %	08.04.2038	73.750	0,00 %
US Treasury Note	\$ 75.000	1,13 %	31.03.2020	73.711	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 73.162	2,32 %	25.10.2018	73.292	0,00 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 75.000	1,95 %	01.03.2022	73.249	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 75.000	2,58 %	25.03.2026	73.224	0,00 %
Northwell Healthcare, Inc.	\$ 75.000	3,98 %	01.11.2046	73.176	0,00 %
LifeStorage LP	\$ 75.000	3,50 %	01.07.2026	73.090	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 75.000	2,50 %	25.09.2026	73.057	0,00 %
American Tower Corp.	\$ 75.000	2,25 %	15.01.2022	73.004	0,00 %
AvalonBay Communities, Inc.	\$ 75.000	2,90 %	15.10.2026	72.981	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 70.712	3,50 %	01.10.2042	72.889	0,00 %
Edison International	\$ 75.000	2,40 %	15.09.2022	72.799	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 67.380	5,00 %	01.08.2033	72.672	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 72.380	2,41 %	25.08.2018	72.503	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 69.319	4,00 %	15.07.2045	72.477	0,00 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 75.000	2,13 %	10.05.2023	72.373	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 69.949	4,00 %	01.11.2024	72.306	0,00 %
UDR, Inc.	\$ 75.000	2,95 %	01.09.2026	71.752	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 70.332	4,50 %	01.04.2023	71.578	0,00 %
Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 70.000	3,75 %	15.02.2050	71.471	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 68.152	4,00 %	15.02.2042	71.456	0,00 %
Consumers Energy Co.	\$ 75.000	3,25 %	15.08.2046	71.446	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 66.368	4,50 %	01.09.2034	71.153	0,00 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 60.000	5,63 %	15.03.2042	70.742	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 63.054	6,00 %	01.01.2037	70.740	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 64.250	5,50 %	01.03.2038	70.616	0,00 %
New York State Electric & Gas Corp.	\$ 70.000	3,25 %	01.12.2026	70.461	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 65.682	5,00 %	20.09.2033	70.177	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 69.419	2,50 %	01.09.2028	70.079	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 66.765	4,00 %	15.10.2041	70.036	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 62.288	6,00 %	01.06.2040	70.007	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 63.100	5,50 %	15.01.2034	69.801	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 65.395	4,50 %	01.07.2029	69.801	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 64.466	5,50 %	20.04.2036	69.764	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 62.176	6,00 %	01.08.2038	69.668	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 63.487	5,50 %	01.05.2040	69.602	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 67.567	3,50 %	01.07.2042	69.442	0,00 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017^	\$ 68.000	3,84 %	15.10.2050	69.293	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 64.257	4,50 %	01.10.2033	68.843	0,00 %
Delta Air Lines 2007-1 Klasse A Pass Through Trust	\$ 60.535	6,82 %	10.08.2022	68.523	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 64.972	4,50 %	15.04.2040	68.396	0,00 %
Tennessee Valley Authority	\$ 50.000	5,50 %	15.06.2038	68.318	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 61.735	5,50 %	15.02.2033	68.205	0,00 %
International Lease Finance Corp.	\$ 65.000	4,63 %	15.04.2021	67.925	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 60.365	6,00 %	01.04.2033	67.893	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 65.269	4,00 %	15.01.2025	67.791	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 66.764	2,50 %	01.11.2027	67.398	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Government National Mortgage Association	\$ 61.948	5,00 %	15.09.2035	67.216	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 62.059	5,00 %	15.05.2040	67.199	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 67.253	2,50 %	01.10.2027	67.177	0,00 %
East Bay Municipal Utility District Water System Revenue	\$ 50.000	5,87 %	01.06.2040	66.977	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 61.136	5,50 %	01.02.2034	66.899	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 64.655	3,50 %	01.09.2043	66.839	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 62.442	5,00 %	20.04.2042	66.659	0,00 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	€ 50.000	2,63 %	15.03.2023	66.512	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 61.276	5,50 %	20.01.2039	66.505	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 59.777	5,50 %	15.01.2035	66.106	0,00 %
Morgan Stanley Capital I Trust 2016	\$ 65.000	3,28 %	15.11.2049	65.896	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 63.788	3,50 %	01.11.2041	65.832	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 61.533	4,50 %	20.03.2041	65.803	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 63.456	3,50 %	01.07.2039	65.742	0,00 %
PSEG Power LLC	\$ 50.000	8,63 %	15.04.2031	65.735	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 61.319	4,50 %	01.05.2040	65.486	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 60.594	5,00 %	01.09.2041	65.265	0,00 %
Mondelez International, Inc.	\$ 50.000	6,50 %	09.02.2040	64.962	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 60.066	4,50 %	01.06.2030	64.088	0,00 %
AEP Transmission Co. LLC	\$ 60.000	4,00 %	01.12.2046	64.022	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 56.850	6,50 %	01.03.2032	63.977	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 50.000	2,63 %	19.08.2020	63.951	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 61.818	3,50 %	01.05.2026	63.897	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 60.162	5,00 %	20.07.2044	63.881	0,00 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	€ 50.000	6,00 %	15.01.2019	63.866	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 58.135	5,50 %	01.11.2036	63.828	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 60.115	4,50 %	20.06.2039	63.632	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 57.954	5,50 %	01.01.2028	63.334	0,00 %
Tennessee Valley Authority	\$ 50.000	4,63 %	15.09.2060	62.893	0,00 %
Xerox Corp.	\$ 62.000	4,07 %	17.03.2022	62.631	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 58.192	5,00 %	01.09.2035	62.570	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 55.538	6,00 %	01.10.2033	62.551	0,00 %
Dallas County Hospital District	\$ 50.000	5,62 %	15.08.2044	62.425	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 57.917	4,50 %	15.07.2039	62.232	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 58.943	4,00 %	01.09.2040	62.073	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 59.638	3,50 %	15.02.2026	62.029	0,00 %
Columbia Pipeline Group, Inc.	\$ 50.000	5,80 %	01.06.2045	61.970	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 60.507	3,00 %	01.07.2027	61.935	0,00 %
US Treasury Note	\$ 62.000	2,38 %	15.05.2027	61.816	0,00 %
District of Columbia	\$ 50.000	5,59 %	01.12.2034	61.794	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 57.250	4,50 %	01.02.2039	61.294	0,00 %
Boston Properties LP	\$ 60.000	3,65 %	01.02.2026	60.862	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 56.393	5,00 %	01.04.2041	60.718	0,00 %
Kansas City Power & Light Co.	\$ 60.000	3,15 %	15.03.2023	60.423	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 55.661	4,50 %	01.10.2044	60.079	0,00 %
Simon Property Group LP	\$ 60.000	3,30 %	15.01.2026	60.023	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 55.614	5,00 %	01.10.2041	59.828	0,00 %
United Technologies Corp.	\$ 50.000	5,40 %	01.05.2035	59.634	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 55.460	4,50 %	01.06.2038	59.464	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 56.837	4,00 %	01.03.2047	59.448	0,00 %
Toyota Auto Receivables 2015-B Owner Trust	\$ 59.551	1,27 %	15.05.2019	59.418	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 54.060	5,50 %	01.05.2033	59.143	0,00 %
Public Storage	\$ 60.000	2,37 %	15.09.2022	59.040	0,00 %
Discovery Communications LLC	\$ 50.000	6,35 %	01.06.2040	58.710	0,00 %
Harris Corp.	\$ 50.000	5,05 %	27.04.2045	58.677	0,00 %
Caterpillar, Inc.	\$ 50.000	4,75 %	15.05.2064	58.675	0,00 %
Ally Auto Receivables Trust 2015	\$ 58.476	1,49 %	15.11.2019	58.431	0,00 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	\$ 50.000	5,75 %	30.11.2039	58.311	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 55.149	4,00 %	01.03.2041	58.095	0,00 %
GM Financial Automobile Leasing Trust 2015	\$ 58.100	1,68 %	20.12.2018	58.089	0,00 %
BNSF Funding Trust I [^]	\$ 50.000	6,61 %	15.12.2055	57.952	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 56.086	3,00 %	15.02.2026	57.805	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 50.000	4,50 %	01.12.2045	57.459	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 52.130	5,50 %	15.11.2038	57.403	0,00 %
California Institute of Technology	\$ 50.000	4,32 %	01.08.2045	57.283	0,00 %
SC Johnson & Son, Inc.	\$ 50.000	4,80 %	01.09.2040	57.270	0,00 %
Fidelity National Information Services, Inc.	\$ 55.000	3,88 %	05.06.2024	56.963	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Government National Mortgage Association	\$ 52.464	5,00 %	15.03.2036	56.922	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 52.660	4,50 %	01.09.2040	56.841	0,00 %
International Paper Co.	\$ 50.000	5,00 %	15.09.2035	56.547	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 54.644	4,00 %	01.12.2026	56.493	0,00 %
NiSource Finance Corp.	\$ 54.000	6,80 %	15.01.2019	56.414	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 51.732	5,50 %	20.09.2041	56.308	0,00 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 50.000	4,38 %	01.09.2042	55.918	0,00 %
Hackensack Meridian Health, Inc.	\$ 50.000	4,50 %	01.07.2057	55.843	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 51.629	5,00 %	15.09.2040	55.697	0,00 %
Cleco Corporate Holdings LLC	\$ 50.000	4,97 %	01.05.2046	55.096	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 48.040	6,50 %	01.12.2032	55.032	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 50.000	4,30 %	01.12.2056	54.908	0,00 %
Duke Energy Progress LLC	\$ 50.000	4,20 %	15.08.2045	54.908	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 53.111	3,00 %	15.01.2026	54.731	0,00 %
Union Pacific Corp.	\$ 50.000	4,00 %	15.04.2047	54.621	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 52.141	4,00 %	15.08.2044	54.561	0,00 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 50.000	6,20 %	15.10.2035	54.209	0,00 %
Northern States Power Co.	\$ 50.000	4,00 %	15.08.2045	54.088	0,00 %
Memorial Sloan-Kettering Cancer Center	\$ 50.000	4,20 %	01.07.2055	53.940	0,00 %
Consumers Energy Co.	\$ 50.000	3,95 %	15.07.2047	53.892	0,00 %
Oklahoma Gas & Electric Co.	\$ 50.000	4,15 %	01.04.2047	53.869	0,00 %
El Paso Electric Co.	\$ 50.000	5,00 %	01.12.2044	53.845	0,00 %
Aetna, Inc.	\$ 50.000	4,50 %	15.05.2042	53.597	0,00 %
Janus Capital Group, Inc.	\$ 50.000	4,88 %	01.08.2025	53.594	0,00 %
Citigroup, Inc.	\$ 50.000	5,38 %	09.08.2020	53.545	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 48.832	5,50 %	01.01.2038	53.460	0,00 %
AXIS Specialty Finance LLC	\$ 50.000	5,88 %	01.06.2020	53.452	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 50.747	4,00 %	01.08.2040	53.439	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 49.529	5,00 %	01.12.2033	53.402	0,00 %
Fortive Corp.	\$ 50.000	4,30 %	15.06.2046	53.300	0,00 %
AvalonBay Communities, Inc.	\$ 50.000	4,20 %	15.12.2023	53.233	0,00 %
Ventas Realty LP/Ventas Capital Corp.	\$ 50.000	4,75 %	01.06.2021	53.075	0,00 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.^	\$ 50.000	5,25 %	20.04.2046	53.051	0,00 %
JobsOhio Beverage System	\$ 50.000	3,99 %	01.01.2029	53.005	0,00 %
Albemarle Corp.	\$ 50.000	4,15 %	01.12.2024	52.973	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 49.662	4,50 %	01.08.2046	52.909	0,00 %
Cadence Design Systems, Inc.	\$ 50.000	4,38 %	15.10.2024	52.636	0,00 %
Tennessee Valley Authority	\$ 50.000	3,88 %	15.02.2021	52.621	0,00 %
Nuveen Finance LLC	\$ 50.000	4,13 %	01.11.2024	52.613	0,00 %
Autodesk, Inc.	\$ 50.000	4,38 %	15.06.2025	52.597	0,00 %
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	\$ 50.000	4,30 %	15.01.2026	52.335	0,00 %
CSAIL 2015-C4 Commercial Mortgage Trust	\$ 50.000	3,81 %	15.11.2048	52.298	0,00 %
Hospitality Properties Trust	\$ 50.000	4,50 %	15.06.2023	52.272	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014	\$ 50.000	3,75 %	15.09.2057	52.238	0,00 %
University of Virginia	\$ 50.000	4,18 %	01.09.2117	52.141	0,00 %
Aflac, Inc.	\$ 50.000	4,00 %	15.10.2046	52.137	0,00 %
Citigroup, Inc.	\$ 50.000	4,30 %	20.11.2026	52.119	0,00 %
Valero Energy Partners LP	\$ 50.000	4,38 %	15.12.2026	52.107	0,00 %
Private Export Funding Corp.	\$ 50.000	3,25 %	15.06.2025	52.084	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014	\$ 50.000	3,67 %	15.11.2047	52.059	0,00 %
Pioneer Natural Resources Co.	\$ 50.000	3,95 %	15.07.2022	52.053	0,00 %
Harman International Industries, Inc.	\$ 50.000	4,15 %	15.05.2025	52.012	0,00 %
Andeavor Logistics LP/Tesoro Logistics Finance Corp.	\$ 50.000	5,20 %	01.12.2047	52.000	0,00 %
New York & Presbyterian Hospital	\$ 50.000	4,06 %	01.08.2056	51.988	0,00 %
Mastercard, Inc.	\$ 50.000	3,38 %	01.04.2024	51.884	0,00 %
UBS6Commercial Mortgage Trust 2014	\$ 50.000	3,64 %	10.12.2047	51.850	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 46.743	5,50 %	15.06.2034	51.765	0,00 %
GS Mortgage Securities Trust 2014	\$ 50.000	3,63 %	10.11.2047	51.739	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017^	\$ 50.000	3,85 %	15.10.2050	51.682	0,00 %
Rockwell Collins, Inc.	\$ 50.000	3,70 %	15.12.2023	51.633	0,00 %
Athene Global Funding	\$ 50.000	4,00 %	25.01.2022	51.598	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 47.987	5,00 %	01.01.2041	51.592	0,00 %
AEP Texas, Inc.	\$ 50.000	3,80 %	01.10.2047	51.501	0,00 %
Black Hills Corp.	\$ 50.000	4,20 %	15.09.2046	51.489	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 51.036	4,00 %	01.03.2019	51.488	0,00 %
Entergy Arkansas, Inc.	\$ 50.000	3,50 %	01.04.2026	51.464	0,00 %
GS Mortgage Securities Trust 2017^	\$ 50.000	3,83 %	10.03.2050	51.458	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
FS Investment Corp.	\$ 50.000	4,75 %	15.05.2022	51.381	0,00 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017^	\$ 50.000	3,74 %	15.08.2050	51.378	0,00 %
Whirlpool Corp.	\$ 50.000	3,70 %	01.05.2025	51.276	0,00 %
United Airlines 2015-1 Klasse A Pass Through Trust	\$ 50.000	3,70 %	01.12.2022	51.185	0,00 %
Csail 2015-C2 Commercial Mortgage Trust	\$ 50.000	3,50 %	15.06.2057	51.174	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 50.000	3,75 %	27.03.2019	51.153	0,00 %
Brixmor Operating Partnership LP	\$ 50.000	3,88 %	15.08.2022	51.146	0,00 %
CGMS Commercial Mortgage Trust 2017^	\$ 50.000	3,71 %	15.08.2050	51.137	0,00 %
Zoetis, Inc.	\$ 50.000	3,45 %	13.11.2020	51.137	0,00 %
CCRE23Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 50.000	3,50 %	10.05.2048	51.112	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 48.434	4,00 %	01.07.2040	51.074	0,00 %
Host Hotels & Resorts LP	\$ 50.000	4,00 %	15.06.2025	51.019	0,00 %
Discover Financial Services	\$ 50.000	3,95 %	06.11.2024	51.006	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2015	\$ 51.092	1,63 %	15.05.2020	51.001	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 50.000	2,99 %	25.09.2021	50.994	0,00 %
American Campus Communities Operating Partnership LP	\$ 50.000	3,35 %	01.10.2020	50.961	0,00 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	\$ 50.000	3,30 %	15.02.2022	50.956	0,00 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 50.000	3,10 %	25.07.2024	50.941	0,00 %
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017^	\$ 50.000	3,71 %	15.10.2050	50.939	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 49.563	3,50 %	01.01.2046	50.929	0,00 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 50.000	3,76 %	12.10.2050	50.918	0,00 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 50.000	3,25 %	10.11.2024	50.847	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015	\$ 50.000	3,31 %	15.04.2048	50.828	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 50.000	2,87 %	25.12.2021	50.800	0,00 %
Indiana Michigan Power Co.	\$ 50.000	3,75 %	01.07.2047	50.774	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 50.000	3,00 %	25.12.2025	50.755	0,00 %
CME Group, Inc.	\$ 50.000	3,00 %	15.03.2025	50.740	0,00 %
Boardwalk Pipelines LP	\$ 50.000	4,45 %	15.07.2027	50.720	0,00 %
Boston Scientific Corp.	\$ 50.000	3,38 %	15.05.2022	50.710	0,00 %
Coca-Cola Bottling Co. Consolidated	\$ 50.000	3,80 %	25.11.2025	50.700	0,00 %
Texas Instruments, Inc.	\$ 50.000	2,75 %	12.03.2021	50.650	0,00 %
Host Hotels & Resorts LP	\$ 50.000	3,88 %	01.04.2024	50.638	0,00 %
Select Income	\$ 50.000	4,15 %	01.02.2022	50.589	0,00 %
LC19 Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 50.000	3,18 %	10.02.2048	50.587	0,00 %
Connecticut Light & Power Co.	\$ 50.000	3,20 %	15.03.2027	50.578	0,00 %
Hubbell, Inc.	\$ 50.000	3,35 %	01.03.2026	50.518	0,00 %
Concho Resources, Inc.	\$ 50.000	3,75 %	01.10.2027	50.500	0,00 %
CMS Energy Corp.	\$ 50.000	3,45 %	15.08.2027	50.430	0,00 %
Exelon Corp.	\$ 50.000	2,85 %	15.06.2020	50.414	0,00 %
Southwest Airlines Co.	\$ 50.000	2,75 %	06.11.2019	50.400	0,00 %
Essex Portfolio LP	\$ 50.000	3,63 %	01.05.2027	50.395	0,00 %
Washington Prime Group LP	\$ 50.000	3,85 %	01.04.2020	50.384	0,00 %
Select Income	\$ 50.000	4,50 %	01.02.2025	50.368	0,00 %
Hashemite Kingdom of Jordan Government AID Bond	\$ 50.000	2,50 %	30.10.2020	50.331	0,00 %
Gulf Power Co.	\$ 50.000	3,30 %	30.05.2027	50.303	0,00 %
Discover Financial Services	\$ 50.000	3,75 %	04.03.2025	50.297	0,00 %
John Deere Capital Corp.	\$ 50.000	2,65 %	06.01.2022	50.275	0,00 %
Carlisle Cos, Inc.	\$ 50.000	3,50 %	01.12.2024	50.273	0,00 %
Appalachian Power Co.	\$ 50.000	3,30 %	01.06.2027	50.263	0,00 %
Boeing Co.	\$ 50.000	3,65 %	01.03.2047	50.233	0,00 %
Amphenol Corp.	\$ 50.000	3,20 %	01.04.2024	50.211	0,00 %
Private Export Funding Corp.	\$ 50.000	2,25 %	15.03.2020	50.193	0,00 %
Private Export Funding Corp.	\$ 50.000	2,30 %	15.09.2020	50.183	0,00 %
SVB Financial Group	\$ 50.000	3,50 %	29.01.2025	50.172	0,00 %
MassMutual Global Funding II	\$ 50.000	2,45 %	23.11.2020	50.084	0,00 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 50.000	2,90 %	25.01.2025	50.075	0,00 %
Lam Research Corp.	\$ 50.000	2,75 %	15.03.2020	50.074	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 50.000	2,60 %	23.04.2020	50.054	0,00 %
Georgia Power Co.	\$ 50.000	3,25 %	01.04.2026	50.054	0,00 %
Westar Energy, Inc.	\$ 50.000	3,10 %	01.04.2027	50.021	0,00 %
McDonald's Corp.	\$ 50.000	2,63 %	15.01.2022	50.019	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 50.000	2,72 %	25.10.2024	49.975	0,00 %
Simon Property Group LP	\$ 50.000	2,50 %	15.07.2021	49.958	0,00 %
Public Service Electric & Gas Co.	\$ 50.000	3,00 %	15.05.2025	49.952	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 50.000	2,70 %	01.05.2022	49.949	0,00 %
Northern States Power Co.	\$ 50.000	2,20 %	15.08.2020	49.912	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Toyota Auto Receivables 2015-C Owner Trust	\$ 50.000	1,69 %	15.12.2020	49.899	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 50.000	2,40 %	25.06.2022	49.881	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 50.000	2,26 %	28.03.2019	49.865	0,00 %
Chevron Corp.	\$ 50.000	2,41 %	03.03.2022	49.854	0,00 %
Nissan Auto Lease Trust 2017	\$ 50.000	2,17 %	15.12.2021	49.789	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 50.000	2,36 %	25.07.2022	49.785	0,00 %
AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2016	\$ 50.000	1,46 %	10.05.2021	49.762	0,00 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 50.000	2,90 %	01.03.2025	49.760	0,00 %
Southern Co.	\$ 50.000	2,35 %	01.07.2021	49.759	0,00 %
Textron, Inc.	\$ 50.000	3,38 %	01.03.2028	49.669	0,00 %
National Fuel Gas Co.	\$ 50.000	3,95 %	15.09.2027	49.662	0,00 %
Edison International	\$ 50.000	2,95 %	15.03.2023	49.654	0,00 %
Texas Instruments, Inc.	\$ 50.000	2,63 %	15.05.2024	49.652	0,00 %
Hubbell, Inc.	\$ 50.000	3,15 %	15.08.2027	49.611	0,00 %
Boeing Co.	\$ 50.000	2,13 %	01.03.2022	49.586	0,00 %
AutoZone, Inc.	\$ 50.000	1,63 %	21.04.2019	49.580	0,00 %
Coca-Cola Co. ¹	\$ 50.000	1,38 %	30.05.2019	49.580	0,00 %
Tapestry Inc.	\$ 50.000	3,00 %	15.07.2022	49.529	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 50.000	2,38 %	15.10.2022	49.517	0,00 %
Nordstrom, Inc.	\$ 50.000	4,00 %	15.03.2027	49.487	0,00 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 50.000	2,95 %	15.11.2026	49.481	0,00 %
Buckeye Partners LP	\$ 50.000	4,13 %	01.12.2027	49.413	0,00 %
Principal Life Global Funding II	\$ 50.000	3,00 %	18.04.2026	49.403	0,00 %
US Treasury Note	\$ 50.000	1,88 %	30.04.2022	49.398	0,00 %
EQT Corp.	\$ 50.000	3,00 %	01.10.2022	49.335	0,00 %
Procter & Gamble Co.	\$ 50.000	1,85 %	02.02.2021	49.327	0,00 %
Procter & Gamble Co.	\$ 50.000	2,70 %	02.02.2026	49.268	0,00 %
Consolidated Edison, Inc.	\$ 50.000	2,00 %	15.05.2021	49.205	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 44.923	5,00 %	15.09.2039	49.178	0,00 %
AvalonBay Communities, Inc.	\$ 50.000	2,95 %	11.05.2026	49.037	0,00 %
Baltimore Gas & Electric Co.	\$ 50.000	3,50 %	15.08.2046	48.989	0,00 %
State of California Department of Water Resources Power Supply Revenue	\$ 50.000	2,00 %	01.05.2022	48.869	0,00 %
Arizona Public Service Co.	\$ 50.000	2,95 %	15.09.2027	48.863	0,00 %
Black Hills Corp.	\$ 50.000	3,15 %	15.01.2027	48.789	0,00 %
Coca-Cola Co.	\$ 50.000	2,55 %	01.06.2026	48.722	0,00 %
Guardian Life Global Funding	\$ 50.000	1,95 %	27.10.2021	48.721	0,00 %
AutoZone, Inc.	\$ 50.000	3,13 %	21.04.2026	48.642	0,00 %
Toyota Auto Receivables 2016-B Owner Trust	\$ 48.742	1,30 %	15.04.2020	48.561	0,00 %
Boeing Co.	\$ 50.000	3,38 %	15.06.2046	48.495	0,00 %
Union Pacific Corp.	\$ 50.000	3,35 %	15.08.2046	48.445	0,00 %
Providence St Joseph Health Obligated Group	\$ 50.000	2,75 %	01.10.2026	48.337	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 42.337	6,00 %	20.03.2033	48.182	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 44.782	5,00 %	01.09.2038	48.116	0,00 %
Bemis Co., Inc.	\$ 50.000	3,10 %	15.09.2026	48.093	0,00 %
Boeing Co.	\$ 50.000	1,88 %	15.06.2023	48.083	0,00 %
NIKE, Inc.	\$ 50.000	3,38 %	01.11.2046	48.050	0,00 %
Southwestern Electric Power Co.	\$ 50.000	2,75 %	01.10.2026	48.019	0,00 %
Teachers Insurance & Annuity Association of America	\$ 34.000	6,85 %	16.12.2039	47.987	0,00 %
Nordstrom, Inc.	\$ 50.000	5,00 %	15.01.2044	47.872	0,00 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 50.000	2,40 %	09.08.2026	47.871	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 44.406	5,00 %	01.09.2025	47.837	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 47.351	3,00 %	01.10.2045	47.459	0,00 %
Boeing Co.	\$ 50.000	2,25 %	15.06.2026	47.419	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 43.734	5,00 %	01.05.2036	47.183	0,00 %
Baltimore Gas & Electric Co.	\$ 50.000	2,40 %	15.08.2026	47.136	0,00 %
Delta Air Lines 2015-1 Klasse AA Pass Through Trust	\$ 45.722	3,63 %	30.07.2027	47.117	0,00 %
Hershey Co.	\$ 50.000	3,38 %	15.08.2046	47.113	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2017	\$ 47.000	1,87 %	15.09.2022	46.546	0,00 %
Spirit Airlines Pass Through Trust 2015-1A	\$ 44.842	4,10 %	01.04.2028	46.544	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 41.380	6,00 %	01.01.2038	46.430	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 43.518	4,50 %	01.03.2045	46.418	0,00 %
Fidelity National Information Services, Inc.	\$ 42.000	5,00 %	15.10.2025	46.365	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 42.038	5,50 %	01.02.2035	46.242	0,00 %
Wyndham Worldwide Corp.	\$ 45.000	4,25 %	01.03.2022	45.780	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 40.581	6,00 %	15.02.2038	45.643	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 42.705	4,50 %	01.04.2046	45.611	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Government National Mortgage Association	\$ 43.362	4,00 %	15.11.2039	45.585	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 42.100	5,00 %	01.06.2034	45.523	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 42.842	4,50 %	15.01.2040	45.370	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 40.742	6,50 %	01.09.2036	45.318	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 40.265	6,00 %	01.12.2036	45.302	0,00 %
US Treasury Note	\$ 45.000	1,75 %	30.09.2019	44.902	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 41.336	5,00 %	15.09.2033	44.809	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 32.000	6,75 %	15.09.2029	44.481	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 41.103	5,00 %	01.07.2033	44.311	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 40.750	5,00 %	01.10.2033	43.941	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 40.157	5,50 %	01.10.2035	43.931	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 39.095	5,00 %	15.03.2034	42.378	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 38.297	5,50 %	15.10.2032	42.304	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 41.201	3,00 %	01.11.2026	42.174	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 39.311	4,50 %	01.10.2046	41.981	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 38.085	5,50 %	01.04.2038	41.693	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 40.000	3,85 %	15.06.2046	41.598	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 38.334	4,50 %	01.04.2039	41.470	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 39.272	4,00 %	01.04.2047	41.085	0,00 %
DDR Corp.	\$ 40.000	4,25 %	01.02.2026	40.699	0,00 %
Continental Airlines 2012-1 Klasse A Pass Through Trust	\$ 38.926	4,15 %	11.04.2024	40.624	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 38.214	4,50 %	15.10.2039	40.481	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 40.089	3,00 %	01.01.2043	40.267	0,00 %
Aon plc	\$ 40.000	2,80 %	15.03.2021	40.113	0,00 %
New York Life Global Funding	\$ 40.000	2,15 %	18.06.2019	40.067	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 37.375	4,50 %	01.09.2033	40.039	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 37.073	5,00 %	01.09.2038	39.833	0,00 %
AEP Transmission Co. LLC	\$ 40.000	3,10 %	01.12.2026	39.831	0,00 %
Toyota Auto Receivables 2015-C Owner Trust	\$ 39.235	1,34 %	17.06.2019	39.189	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 34.814	6,00 %	01.03.2037	39.024	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 37.351	4,00 %	01.05.2025	38.626	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 37.302	3,50 %	01.03.2024	38.612	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 35.350	5,50 %	20.03.2035	38.608	0,00 %
Procter & Gamble Co.	\$ 29.000	5,55 %	05.03.2037	38.491	0,00 %
Newell Brands Inc.	\$ 38.000	2,60 %	29.03.2019	38.058	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 35.063	5,00 %	01.08.2040	37.775	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 36.750	4,50 %	01.07.2025	37.594	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 35.358	4,00 %	01.03.2042	37.197	0,00 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 37.000	1,82 %	15.03.2019	36.897	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 32.514	6,00 %	20.07.2039	36.583	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 32.917	6,00 %	20.08.2037	36.496	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 33.739	5,00 %	01.03.2038	36.406	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 31.546	7,00 %	01.04.2037	36.238	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 34.553	4,00 %	20.06.2042	36.211	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 34.038	4,50 %	15.08.2033	36.165	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 32.102	6,00 %	01.02.2033	36.161	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 31.607	6,50 %	01.08.2032	35.098	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 32.919	4,50 %	15.06.2040	34.865	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 31.728	5,50 %	01.12.2032	34.716	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 31.592	5,50 %	01.03.2036	34.686	0,00 %
Owens Corning	\$ 35.000	4,30 %	15.07.2047	34.406	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 31.859	4,00 %	01.09.2041	33.505	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015	\$ 32.000	3,80 %	15.08.2048	33.487	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 29.808	6,50 %	20.11.2038	33.373	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 29.391	6,50 %	20.12.2037	32.911	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 31.244	4,00 %	01.08.2040	32.898	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 32.223	3,00 %	01.06.2031	32.837	0,00 %
Tennessee Valley Authority	\$ 32.000	2,88 %	15.09.2024	32.715	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 29.359	6,00 %	20.06.2038	32.544	0,00 %
New York Life Insurance Co.	\$ 25.000	5,88 %	15.05.2033	32.172	0,00 %
Nissan Auto Receivables 2015-B Owner Trust	\$ 32.099	1,34 %	16.03.2020	32.025	0,00 %
CD Mortgage Trust 2017	\$ 31.000	3,83 %	10.02.2050	31.823	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 27.974	6,00 %	01.04.2035	31.468	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 28.205	6,50 %	01.12.2032	31.382	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 29.893	4,00 %	20.09.2025	31.054	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 27.863	6,50 %	01.10.2036	30.905	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 27874	5,50 %	01.08.2037	30.828	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 29.658	4,00 %	15.09.2025	30.811	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 29.213	4,00 %	01.10.2041	30.734	0,00 %
Quest Diagnostics, Inc.	\$ 26.000	5,75 %	30.01.2040	29.944	0,00 %
Trinity Industries, Inc.	\$ 30.000	4,55 %	01.10.2024	29.887	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 26.791	5,50 %	15.07.2035	29.409	0,00 %
US Treasury Note	\$ 30.000	1,38 %	31.05.2021	29.320	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 27218	4,50 %	01.10.2033	29.154	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 26.862	5,00 %	01.07.2036	28.994	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 27.791	3,50 %	01.10.2025	28.906	0,00 %
GM Financial Automobile Leasing Trust 2015	\$ 28.830	1,69 %	20.03.2019	28.819	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 26.029	5,50 %	01.05.2038	28.552	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 25.795	6,50 %	01.10.2039	28.529	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 25.000	4,63 %	15.11.2041	28.458	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 27.635	3,50 %	01.12.2045	28.409	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 26.949	4,00 %	01.05.2025	27.861	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2015	\$ 27.663	1,41 %	15.02.2020	27.611	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 26.569	4,00 %	01.08.2025	27.469	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 24.469	6,00 %	01.03.2036	27.416	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 26.026	4,00 %	15.04.2039	27.334	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 24.281	6,00 %	01.09.2036	27.326	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 25.161	5,00 %	15.05.2033	27.254	0,00 %
Children's Hospital Medical Center	\$ 25.000	4,27 %	15.05.2044	27.227	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 24.866	5,50 %	01.06.2028	27.209	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 25.547	4,00 %	01.07.2039	26.941	0,00 %
Trimble, Inc.	\$ 25.000	4,75 %	01.12.2024	26.817	0,00 %
Texas Health Resources	\$ 25.000	4,33 %	15.11.2055	26.664	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 25.362	4,00 %	01.08.2026	26.569	0,00 %
Federal Farm Credit Banks	\$ 25.000	3,50 %	20.12.2023	26.549	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 26.286	4,00 %	01.05.2020	26.476	0,00 %
GS Mortgage Securities Trust 2015	\$ 25.000	3,76 %	10.07.2048	26.190	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 25.000	3,49 %	25.01.2024	26.174	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 24.172	5,00 %	15.03.2040	26.164	0,00 %
Bank of America Corp. ¹	\$ 26.000	2,60 %	15.01.2019	26.102	0,00 %
BGC Partners, Inc.	\$ 25.000	5,38 %	09.12.2019	26.081	0,00 %
Partners Healthcare System, Inc.	\$ 25.000	4,12 %	01.07.2055	26.045	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014	\$ 25.000	4,07 %	15.11.2047	26.040	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 23.709	5,50 %	01.06.2038	26.004	0,00 %
Microsoft Corp.	\$ 25.000	3,50 %	12.02.2035	25.936	0,00 %
Harris Corp.	\$ 25.000	3,83 %	27.04.2025	25.850	0,00 %
Federal Home Loan Banks	\$ 25.000	3,38 %	12.06.2020	25.817	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 23.934	5,00 %	01.01.2034	25.811	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 24.030	5,00 %	01.05.2024	25.809	0,00 %
First American Financial Corp.	\$ 25.000	4,60 %	15.11.2024	25.764	0,00 %
CD Mortgage Trust 2017	\$ 25.000	3,45 %	10.02.2050	25.714	0,00 %
Private Export Funding Corp.	\$ 25.000	4,38 %	15.03.2019	25.708	0,00 %
Walgreen Co.	\$ 25.000	5,25 %	15.01.2019	25.691	0,00 %
EOG Resources, Inc.	\$ 25.000	3,90 %	01.04.2035	25.654	0,00 %
Phillips 66 Partners LP	\$ 25.000	4,68 %	15.02.2045	25.647	0,00 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 25.000	3,13 %	15.01.2021	25.642	0,00 %
Tyco Electronics Group SA	\$ 25.000	3,45 %	01.08.2024	25.630	0,00 %
Bank 2018-BNK ⁸	\$ 25.000	3,73 %	15.11.2050	25.629	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 23.808	4,50 %	01.04.2035	25.530	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 22.206	6,50 %	15.09.2032	25.514	0,00 %
Private Export Funding Corp.	\$ 25.000	2,80 %	15.05.2022	25.459	0,00 %
Union Electric Co.	\$ 25.000	3,65 %	15.04.2045	25.373	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 23.651	4,50 %	01.09.2039	25.312	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 22.400	6,00 %	01.02.2037	25.206	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 23.062	5,50 %	20.06.2034	25.188	0,00 %
Harris Corp.	\$ 25.000	2,70 %	27.04.2020	25.073	0,00 %
Ryder System, Inc.	\$ 25.000	2,55 %	01.06.2019	25.068	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 22.277	6,00 %	15.12.2038	25.045	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 22.871	5,50 %	01.11.2037	25.039	0,00 %
Mercedes-Benz Auto Receivables Trust 2015	\$ 25.091	1,34 %	16.12.2019	25.038	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 23.891	4,00 %	01.09.2044	25.017	0,00 %
Dr Pepper Snapple Group, Inc.	\$ 25.000	3,43 %	15.06.2027	25.011	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Ventas Realty LP	\$ 25.000	3,13 %	15.06.2023	25.000	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2014	\$ 25.000	1,73 %	18.02.2020	24.982	0,00 %
Mastercard, Inc.	\$ 25.000	2,00 %	01.04.2019	24.974	0,00 %
Federal Home Loan Banks	\$ 25.000	1,88 %	13.03.2020	24.947	0,00 %
Private Export Funding Corp.	\$ 25.000	2,45 %	15.07.2024	24.880	0,00 %
Andeavor Logistics LP/Tesoro Logistics Finance Corp.	\$ 25.000	3,50 %	01.12.2022	24.875	0,00 %
Private Export Funding Corp.	\$ 25.000	1,45 %	15.08.2019	24.769	0,00 %
US Treasury Note	\$ 25.000	1,00 %	30.11.2019	24.590	0,00 %
Tennessee Valley Authority	\$ 25.000	1,88 %	15.08.2022	24.575	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 22.737	5,00 %	01.10.2035	24.499	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 23.900	4,50 %	01.03.2023	24.340	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 23.403	4,50 %	15.10.2024	24.254	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 22.528	4,50 %	01.04.2040	24.045	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 22.365	5,00 %	01.04.2041	23.976	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 21.549	6,50 %	01.07.2036	23.900	0,00 %
Seagate HDD Cayman	\$ 25.000	4,88 %	01.06.2027	23.875	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 21.245	6,00 %	01.01.2038	23.836	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 21.623	6,00 %	20.06.2036	23.771	0,00 %
Cox Communications, Inc.	\$ 25.000	4,50 %	30.06.2043	23.751	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 20.765	6,00 %	15.02.2033	23.377	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 22.634	4,00 %	01.06.2024	23.325	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 20.720	6,50 %	01.08.2037	23.118	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 20.224	7,00 %	01.07.2032	23.109	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 22.433	4,00 %	01.05.2021	22.977	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 21.109	5,00 %	15.08.2033	22.886	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 21.325	4,50 %	01.09.2033	22.845	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2015	\$ 22.665	1,37 %	16.03.2020	22.614	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 20.658	5,50 %	01.02.2036	22.613	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 19.702	7,00 %	01.08.2037	22.321	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 19.728	6,00 %	01.12.2037	22.136	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 19.585	6,00 %	01.05.2038	22.010	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 19.927	5,00 %	15.05.2040	21.571	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 20.127	4,50 %	01.10.2033	21.559	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 19.042	6,00 %	01.07.2029	21.335	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 19.477	5,50 %	01.01.2039	21.228	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 19.702	4,50 %	15.04.2039	20.834	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 19.625	6,50 %	01.12.2031	20.756	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 18.633	6,50 %	01.06.2034	20.688	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 18.247	6,00 %	01.01.2032	20.484	0,00 %
Bunge Ltd. Finance Corp.	\$ 20.000	3,50 %	24.11.2020	20.381	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 18.080	6,50 %	01.02.2032	20.173	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 18.367	5,50 %	01.06.2036	20.166	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 17.887	6,00 %	01.10.2035	20.039	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 18.692	4,50 %	01.08.2039	19.986	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 17.664	6,00 %	01.09.2037	19.792	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 17.557	5,50 %	01.01.2033	19.258	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 17.403	5,00 %	15.06.2039	18.839	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 17.478	5,00 %	20.04.2036	18.720	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 16.576	6,00 %	01.09.2036	18.653	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 16.814	6,00 %	20.08.2036	18.641	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 16.648	6,50 %	01.03.2035	18.521	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 16.262	6,50 %	01.07.2035	18.095	0,00 %
Tennessee Valley Authority	\$ 14.000	6,75 %	01.11.2025	18.041	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 16.001	6,00 %	01.12.2036	17.972	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 16.635	4,50 %	01.07.2040	17.939	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 16.280	5,50 %	01.02.2039	17.844	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 16.209	5,50 %	01.07.2038	17.773	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 16.351	5,00 %	15.02.2039	17.687	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 16.380	5,00 %	01.03.2034	17.644	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 16.937	3,50 %	15.12.2042	17.609	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 16.869	3,50 %	01.01.2041	17.468	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 15.366	6,00 %	01.02.2036	17.195	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 15.848	7,00 %	01.01.2032	16.676	0,00 %
Capital Auto Receivables Asset Trust 2015	\$ 16.671	1,61 %	20.06.2019	16.668	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 14.122	7,00 %	01.01.2034	16.317	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2015	\$ 16.027	1,16 %	15.11.2019	15.993	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 14.508	5,50 %	01.05.2040	15.906	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 14.881	4,50 %	01.11.2040	15.892	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 14.184	6,00 %	01.06.2037	15.849	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 14.083	6,00 %	15.08.2032	15.840	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 14.261	5,50 %	20.11.2034	15.799	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 14.776	4,50 %	01.05.2028	15.782	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 13.950	6,00 %	01.01.2036	15.722	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 14.766	4,50 %	15.08.2033	15.694	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 13.959	6,50 %	20.09.2036	15.639	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 14.160	5,50 %	01.05.2038	15.571	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 13.939	6,50 %	01.07.2032	15.508	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 13.733	6,00 %	01.04.2039	15.349	0,00 %
Honda Auto Receivables 2015-3 Owner Trust	\$ 15.191	1,27 %	18.04.2019	15.179	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 13.775	4,50 %	01.02.2041	14.718	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 13.188	5,50 %	20.08.2040	14.714	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 13.228	6,00 %	20.12.2036	14.666	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 12.914	6,00 %	01.01.2033	14.532	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 12.893	6,00 %	01.01.2038	14.504	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 12.792	6,00 %	01.03.2029	14.319	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 12.906	6,00 %	20.07.2036	14.310	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 12.725	6,00 %	01.08.2037	14.261	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 12.330	7,00 %	01.09.2031	14.084	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 13.677	5,00 %	01.11.2023	14.056	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 13.022	5,00 %	01.02.2037	13.993	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 12.604	6,50 %	01.09.2038	13.992	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 13.453	4,00 %	20.02.2026	13.956	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 12.225	6,00 %	01.12.2032	13.699	0,00 %
Nissan Auto Receivables 2015-B Owner Trust	\$ 13.547	1,05 %	15.10.2019	13.518	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 12.291	5,50 %	01.07.2035	13.495	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 11.994	6,00 %	01.07.2040	13.473	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 13.151	4,50 %	01.05.2023	13.392	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 12.153	5,50 %	01.05.2038	13.332	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 13.295	4,50 %	01.06.2018	13.324	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 12.968	4,50 %	01.01.2025	13.267	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 12.896	5,50 %	15.12.2040	13.257	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 11.667	6,50 %	15.02.2032	13.134	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 12.053	5,50 %	01.09.2038	13.025	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 12.121	6,50 %	15.07.2035	12.979	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 12.439	3,50 %	01.08.2042	12.858	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 11.216	6,50 %	01.01.2039	12.475	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 11.344	5,50 %	01.06.2033	12.411	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 11.291	5,50 %	01.01.2035	12.394	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 10.796	7,00 %	01.04.2032	12.355	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 11.476	4,50 %	01.01.2039	12.276	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 11.524	4,50 %	15.09.2045	12.161	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 10.666	6,00 %	01.05.2033	11.947	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 10.619	6,00 %	15.12.2038	11.913	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 9.994	7,00 %	20.11.2038	11.908	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 10.581	6,50 %	20.01.2036	11.880	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 11.076	5,00 %	01.09.2035	11.873	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 10.776	5,50 %	15.10.2038	11.864	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 10.749	5,50 %	15.09.2038	11.859	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 10.338	7,00 %	01.09.2035	11.820	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 11.181	5,50 %	01.10.2025	11.714	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 10.418	6,00 %	01.01.2032	11.699	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 11.060	4,00 %	01.09.2033	11.673	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 11.254	4,00 %	01.01.2025	11.655	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2015	\$ 11.563	1,28 %	15.09.2019	11.551	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 10.347	6,50 %	01.09.2037	11.497	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 10.267	6,00 %	20.01.2032	11.322	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 10.283	5,00 %	15.08.2033	11.147	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 10.090	6,00 %	20.07.2034	11.132	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 11.012	6,00 %	01.05.2021	11.071	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 9.790	6,50 %	01.01.2029	10.852	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 10.133	4,50 %	01.10.2023	10.802	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 9.365	6,00 %	15.06.2033	10.469	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 9.549	5,50 %	01.02.2024	10.420	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Government National Mortgage Association	\$ 9.371	5,50 %	20.05.2037	10.196	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 9.155	5,50 %	01.02.2035	10.051	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 8.928	6,00 %	15.02.2038	10.036	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 8.819	6,00 %	01.01.2036	9.921	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 9.119	5,00 %	15.09.2035	9.887	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 9.839	3,00 %	01.04.2047	9.846	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 8.693	6,00 %	01.01.2036	9.783	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2014	\$ 9.620	1,25 %	15.11.2019	9.609	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 8.580	6,50 %	20.10.2038	9.607	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 8.643	5,00 %	01.02.2038	9.290	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 9.276	6,00 %	01.01.2024	9.287	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 8.138	6,00 %	01.10.2036	9.142	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 7.989	6,50 %	20.12.2035	8.970	0,00 %
US Treasury Note	\$ 9.000	1,38 %	15.09.2020	8.872	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 8.730	4,50 %	01.11.2022	8.871	0,00 %
Honda Auto Receivables 2015-2 Owner Trust	\$ 8.714	1,04 %	21.02.2019	8.696	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 7.962	5,00 %	15.03.2035	8.636	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 7.813	5,50 %	01.08.2035	8.534	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 7.861	5,00 %	01.03.2035	8.476	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 7.489	7,00 %	01.06.2032	8.411	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 8.080	5,00 %	01.04.2024	8.303	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 7.667	5,00 %	15.02.2039	8.274	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 7.143	7,00 %	01.04.2032	8.245	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 7.229	6,00 %	01.03.2037	8.129	0,00 %
Ally Auto Receivables Trust 2015	\$ 8.106	1,39 %	16.09.2019	8.099	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 7.416	5,00 %	01.06.2030	7.990	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 7.057	6,00 %	01.07.2038	7.928	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 7.277	5,00 %	15.06.2033	7.890	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 7.840	4,50 %	01.11.2018	7.871	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 7.274	5,00 %	01.08.2034	7.864	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 6.954	6,50 %	15.02.2032	7.763	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 6.376	7,00 %	20.08.2038	7.598	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 6.788	6,50 %	15.05.2034	7.581	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 7.503	4,50 %	01.01.2020	7.577	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 7.418	5,50 %	01.07.2024	7.551	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 6.861	5,50 %	01.05.2040	7.522	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 7.339	5,50 %	01.08.2020	7.426	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 6.757	5,50 %	01.11.2038	7.409	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 6.594	6,00 %	01.10.2037	7.408	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 6.701	5,50 %	15.12.2032	7.400	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 7.025	4,00 %	01.06.2026	7.360	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 6.478	6,00 %	01.05.2040	7.271	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 6.655	5,00 %	01.11.2039	7.164	0,00 %
0,00 % Federal National Mortgage Association	\$ 6.384	6,00 %	01.10.2037	7.147	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 6.653	4,50 %	01.08.2035	7.132	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 6.486	4,50 %	01.03.2029	6.921	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 6.622	3,50 %	01.06.2026	6.845	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 6.357	7,00 %	01.12.2034	6.783	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 6.406	4,50 %	15.02.2039	6.777	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 6.127	5,50 %	01.11.2024	6.706	0,00 %
BMW Vehicle Lease Trust 2015	\$ 6.521	1,40 %	20.09.2018	6.520	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 5.876	5,50 %	01.05.2025	6.432	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 5.952	5,00 %	01.12.2032	6.411	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 6.317	6,00 %	01.08.2022	6.341	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 5.912	5,00 %	20.11.2033	6.330	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 6.018	5,50 %	01.05.2021	6.235	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 6.151	4,50 %	01.09.2020	6.231	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 6.078	5,00 %	01.09.2018	6.105	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 5.666	4,50 %	01.04.2035	6.078	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 5.532	5,50 %	01.01.2039	6.024	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 5.618	4,50 %	15.11.2040	6.019	0,00 %
Volkswagen Auto Loan Enhanced Trust 2014	\$ 6.000	1,39 %	20.05.2021	5.991	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 5.904	5,00 %	01.06.2019	5.961	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 5.162	7,00 %	01.02.2037	5.956	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 5.310	6,00 %	15.12.2035	5.937	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 5.600	7,00 %	01.09.2031	5.816	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 5.013	7,00 %	01.01.2028	5.784	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Government National Mortgage Association	\$ 5.105	6,50 %	20.08.2037	5.765	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 5.580	4,50 %	01.05.2021	5.614	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 4.966	6,50 %	15.01.2033	5.603	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 4.882	6,00 %	15.09.2039	5.515	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 5.427	4,00 %	01.09.2018	5.462	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 5.145	6,50 %	01.05.2038	5.443	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 4.834	6,00 %	01.11.2037	5.418	0,00 %
World Omni Auto Receivables Trust 2014	\$ 5.405	1,14 %	15.01.2020	5.398	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 4.842	6,50 %	01.10.2037	5.382	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 4.873	5,50 %	15.08.2038	5.370	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 5.205	4,50 %	01.12.2024	5.324	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 5.077	4,50 %	01.07.2018	5.144	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 4.539	6,00 %	01.12.2032	5.107	0,00 %
Ally Auto Receivables Trust 2014	\$ 5.053	1,28 %	17.06.2019	5.051	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 4.476	5,50 %	20.01.2037	4.871	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 4.580	5,00 %	01.08.2022	4.623	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 3.969	6,00 %	01.11.2037	4.450	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 4.171	3,50 %	01.10.2026	4.309	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 4.265	4,50 %	01.01.2020	4.309	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 4.162	4,50 %	15.03.2020	4.303	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 3.818	6,00 %	01.09.2035	4.285	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 4.173	4,50 %	01.09.2024	4.268	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 4.185	6,00 %	01.03.2021	4.205	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 3.767	6,50 %	01.11.2036	4.190	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 3.698	6,50 %	01.09.2037	4.112	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 3.617	6,50 %	15.10.2038	4.027	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 3.553	6,00 %	01.10.2038	3.967	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 3.527	6,50 %	01.10.2039	3.923	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 3.389	6,50 %	01.11.2038	3.768	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 3.365	6,50 %	01.08.2029	3.743	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 3.595	5,50 %	01.06.2020	3.670	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 3.188	7,00 %	01.04.2036	3.646	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 3.555	5,00 %	01.07.2025	3.642	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 3.574	4,00 %	01.06.2019	3.621	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 3.542	4,50 %	01.04.2018	3.545	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 3.480	4,50 %	01.11.2020	3.527	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 3.454	4,00 %	01.07.2018	3.471	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 3.235	4,50 %	01.10.2020	3.277	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 3.189	5,50 %	01.12.2019	3.208	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 3.125	4,50 %	01.11.2024	3.197	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 3.037	1,63 %	25.02.2018	3.033	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 2.874	6,00 %	15.02.2037	3.001	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 2.787	4,50 %	01.07.2024	2.843	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 2.778	5,00 %	01.11.2019	2.800	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 2.509	5,50 %	01.02.2038	2.753	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 2.691	5,00 %	01.08.2019	2.719	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 2.600	5,50 %	01.07.2021	2.641	0,00 %
Honda Auto Receivables 2015-1 Owner Trust	\$ 2.601	1,05 %	15.10.2018	2.600	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 2.576	4,00 %	01.08.2018	2.590	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 2.529	4,50 %	01.09.2020	2.535	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 2.336	5,00 %	01.11.2023	2.512	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 2.169	5,50 %	01.06.2038	2.378	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 2.344	4,50 %	01.12.2018	2.351	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 2.328	5,00 %	01.10.2018	2.340	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 2.007	6,50 %	15.12.2038	2.227	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 2.027	5,00 %	01.03.2038	2.179	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 2.099	5,50 %	15.12.2036	2.168	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.900	5,50 %	01.10.2039	2.090	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 2.036	4,50 %	01.04.2018	2.040	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 2.018	5,00 %	01.06.2018	2.022	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.967	4,50 %	01.06.2024	2.007	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.911	4,50 %	01.06.2018	1.916	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.673	6,50 %	15.11.2032	1.899	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 1.640	6,00 %	15.11.2031	1.840	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2014	\$ 1.630	1,16 %	17.06.2019	1.630	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.558	4,50 %	01.09.2018	1.578	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeitsdatum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal National Mortgage Association	\$ 1.490	5,50 %	01.11.2021	1.531	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.296	6,00 %	01.11.2037	1.458	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.246	4,50 %	01.02.2024	1.271	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.226	4,00 %	01.04.2024	1.264	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.220	5,50 %	01.03.2020	1.229	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.209	4,00 %	01.09.2019	1.224	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.126	7,00 %	01.04.2035	1.193	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.184	5,00 %	01.06.2018	1.187	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 909	6,50 %	15.01.2032	984	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 879	5,00 %	01.04.2019	882	0,00 %
Volkswagen Auto Loan Enhanced Trust 2014	\$ 880	0,95 %	22.04.2019	879	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 821	5,00 %	01.05.2018	823	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 772	5,00 %	01.07.2018	773	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 747	4,00 %	01.08.2018	751	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 734	4,50 %	01.03.2018	735	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 726	4,50 %	15.09.2018	730	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 613	6,50 %	01.07.2034	686	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 670	5,50 %	01.09.2019	675	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 644	4,00 %	01.12.2018	648	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 636	5,00 %	01.08.2018	638	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 616	4,50 %	01.05.2018	617	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 571	4,50 %	15.02.2039	604	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 594	4,00 %	01.08.2018	598	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 564	5,00 %	01.05.2018	565	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 515	6,00 %	15.10.2038	559	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 515	6,00 %	15.02.2029	552	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 351	5,00 %	01.11.2019	354	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 321	5,00 %	01.06.2018	322	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 295	5,50 %	01.04.2018	296	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 276	5,50 %	01.04.2018	277	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 243	5,00 %	01.11.2035	263	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 207	5,00 %	01.03.2018	207	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 151	5,50 %	15.06.2019	153	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 150	5,00 %	01.02.2018	150	0,00 %
Government National Mortgage Association	\$ 112	5,00 %	20.03.2018	112	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 34	6,50 %	01.02.2019	34	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 12	5,50 %	01.02.2018	12	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 5	5,00 %	01.01.2018	5	0,00 %
Federal National Mortgage Corp.	(\$ 49.943)	3,00 %	01.05.2047	(49.964)	(0,00 %)
Federal Home Loan Mortgage Corp.	(\$ 168.242)	4,50 %	01.09.2046	(179.106)	(0,00 %)
Freddie Mac Gold Pool	(\$ 675.000)	3,00 %	01.01.2048	(674.894)	(0,01 %)
Federal National Mortgage Association	(\$ 2.400.000)	3,00 %	01.01.2048	(2.400.480)	(0,02 %)
				3.781.389.496	39,74 %

Uruguay 0,03 % (2016: 0,02 %)

Uruguay Government International Bond	\$ 1.175.000	4,38 %	27.10.2027	1.264.594	0,01 %
Uruguay Government International Bond	\$ 575.000	5,10 %	18.06.2050	638.969	0,01 %
Uruguay Government International Bond	\$ 350.000	4,50 %	14.08.2024	379.435	0,01 %
Uruguay Government International Bond	\$ 250.000	8,00 %	18.11.2022	301.875	0,00 %
Uruguay Government International Bond	\$ 100.000	4,13 %	20.11.2045	100.375	0,00 %

2.685.248 0,03 %**Summe Anleihen****9.361.656.874 98,39 %****Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte****9.361.656.874 98,39 %**

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures (0,00 %) (2016: 0,00 %)				
US Ultra Bond März 2018	25	4.153.495	37.911	0,00 %
Euro-Bund Futures März 2018	(15)	(2.934.875)	22.695	0,00 %
Long Gilt Future März 2018	15	2.517.941	21.712	0,00 %
US 10-Year Ultra Futures März 2018	(26)	(3.485.535)	12.910	0,00 %
US 10-Year Note März 2018	(6)	(749.251)	4.970	0,00 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominal-betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt-nettovermögens
US 2-Year Note März 2018	(7)	(1.501.830)	3.064	0,00 %
US Lond Bond März 2018	(10)	(1.531.250)	1.250	0,00 %
AUS 10-Year Bond Futures März 2018	30	3.045.676	(15.050)	(0,00 %)
Can 10-Year Bond Futures März 2018	25	2.728.760	(39.507)	(0,00 %)
AUS 3-Year Bond Futures März 2018	146	12.741.238	(54.663)	(0,00 %)
US 5-Year Note März 2018	186	21.701.469	(94.953)	(0,00 %)
			(99.661)	(0,00 %)

Währung	Kauf-betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs-datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt-nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte (0,21 %) (2016: 0,62 %)							
USD	1.039.281.545	JPY	(116.070.590.000)	UBS	05.01.2018	8.809.367	0,09 %
USD	34.439.024	MXN	(644.195.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	1.513.978	0,02 %
KRW	141.539.120.000	USD	(131.176.200)	BNP Paribas	02.01.2018	1.035.392	0,01 %
USD	419.455.511	GBP	(309.490.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	792.975	0,01 %
EUR	10.000.000	USD	(11.832.795)	BNP Paribas	03.01.2018	175.207	0,00 %
THB	899.053.570	USD	(27.460.402)	BNP Paribas	04.01.2018	127.297	0,00 %
JPY	119.170.590.000	USD	(1.057.883.622)	UBS	05.01.2018	110.289	0,00 %
GBP	6.000.000	USD	(8.023.934)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	92.564	0,00 %
EUR	4.000.000	USD	(4.728.120)	JP Morgan Chase	03.01.2018	75.081	0,00 %
GBP	7.000.000	USD	(9.405.270)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	63.979	0,00 %
USD	26.340.773	THB	(856.338.517)	BNP Paribas	04.01.2018	63.796	0,00 %
GBP	4.000.000	USD	(5.349.068)	BNP Paribas	03.01.2018	61.931	0,00 %
USD	17.621.357	GBP	(13.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	35.610	0,00 %
MYR	20.500.000	USD	(5.031.292)	JP Morgan Chase	03.01.2018	34.188	0,00 %
MYR	20.500.000	USD	(5.031.292)	JP Morgan Chase	03.01.2018	34.188	0,00 %
MYR	20.500.000	USD	(5.031.292)	JP Morgan Chase	03.01.2018	34.188	0,00 %
MYR	20.500.000	USD	(5.034.381)	JP Morgan Chase	03.01.2018	31.099	0,00 %
MYR	20.000.000	USD	(4.911.591)	JP Morgan Chase	03.01.2018	30.341	0,00 %
USD	3.581.431	JPY	(400.000.000)	BNP Paribas	05.01.2018	30.240	0,00 %
USD	21.498.484	RUB	(1.241.000.000)	JP Morgan Chase	01.02.2018	29.046	0,00 %
USD	21.565.394	RUB	(1.241.000.000)	JP Morgan Chase	09.01.2018	26.315	0,00 %
USD	32.742.239	MXN	(644.195.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	21.223	0,00 %
USD	4.458.764	JPY	(500.000.000)	BNP Paribas	05.01.2018	19.775	0,00 %
EUR	2.000.000	USD	(2.382.660)	JP Morgan Chase	03.01.2018	18.940	0,00 %
MYR	10.508.843	USD	(2.580.757)	JP Morgan Chase	03.01.2018	15.942	0,00 %
USD	6.226.761	JPY	(700.000.000)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	12.176	0,00 %
USD	4.444.290	JPY	(500.000.000)	BNP Paribas	05.01.2018	5.300	0,00 %
GBP	5.000.000	USD	(6.769.800)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	1.121	0,00 %
JPY	500.000.000	USD	(4.444.405)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	830	0,00 %
USD	409	JPY	(46.069)	Brown Brothers Harriman & Co.	05.01.2018	—	0,00 %
USD	12.949.135	NZD	(18.215.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(89)	(0,00 %)
USD	4.438.526	JPY	(500.000.000)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	(463)	(0,00 %)
USD	12.615.354	ILS	(43.745.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(637)	(0,00 %)
USD	16.779.830	SGD	(22.415.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(817)	(0,00 %)
USD	23.410.746	PLN	(81.350.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(1.347)	(0,00 %)
USD	12.139.071	CZK	(257.670.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(1.367)	(0,00 %)
EUR	5.000.000	USD	(6.017.423)	BNP Paribas	02.02.2018	(1.995)	(0,00 %)
USD	12.569.359	NOK	(102.730.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(2.115)	(0,00 %)
RUB	100.000.000	USD	(1.737.743)	JP Morgan Chase	09.01.2018	(2.120)	(0,00 %)
RUB	120.000.000	USD	(2.085.292)	JP Morgan Chase	09.01.2018	(2.545)	(0,00 %)
USD	146.969.708	AUD	(187.905.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(2.963)	(0,00 %)
USD	10.000.893	HUF	(2.580.000.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(3.095)	(0,00 %)
USD	2.699.128	GBP	(2.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(6.372)	(0,00 %)
USD	1.303.819	THB	(42.715.053)	BNP Paribas	04.01.2018	(6.904)	(0,00 %)
USD	1.018.945	CHF	(1.000.000)	JP Morgan Chase	04.01.2018	(7.294)	(0,00 %)
USD	283.722.119	CAD	(355.335.000)	UBS	02.02.2018	(10.195)	(0,00 %)
USD	43.403.844	SEK	(354.770.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(11.526)	(0,00 %)
USD	37.284.932	DKK	(230.790.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(11.629)	(0,00 %)
USD	8.863.936	JPY	(1.000.000.000)	JP Morgan Chase	05.01.2018	(14.042)	(0,00 %)
USD	2.686.402	GBP	(2.000.000)	UBS	03.01.2018	(19.098)	(0,00 %)
USD	438.045.249	GBP	(323.490.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(19.784)	(0,00 %)
USD	1.419.373	ILS	(5.000.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(20.865)	(0,00 %)
RUB	1.021.000.000	USD	(17.742.359)	JP Morgan Chase	09.01.2018	(21.650)	(0,00 %)

Wahrung	Kauf- betrag	Wahrung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermogens
USD	65.648.248	CHF	(63.855.000)	BNP Paribas	02.02.2018	(25.589)	(0,00 %)
USD	2.371.553	EUR	(2.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(30.047)	(0,00 %)
USD	2.563.132	MYR	(10.508.843)	BNP Paribas	05.02.2018	(30.107)	(0,00 %)
RUB	1.241.000.000	USD	(21.571.354)	JP Morgan Chase	09.01.2018	(32.276)	(0,00 %)
USD	12.084.985	CZK	(257.670.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(34.959)	(0,00 %)
USD	2.363.400	EUR	(2.000.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(38.200)	(0,00 %)
USD	1.509.105	HUF	(400.000.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(39.290)	(0,00 %)
USD	2.040.816	RUB	(120.000.000)	JP Morgan Chase	09.01.2018	(41.931)	(0,00 %)
USD	2.846.387	KRW	(3.100.000.000)	BNP Paribas	02.01.2018	(49.321)	(0,00 %)
USD	1.683.013	RUB	(100.000.000)	JP Morgan Chase	09.01.2018	(52.610)	(0,00 %)
USD	5.003.661	MYR	(20.500.000)	BNP Paribas	05.02.2018	(55.069)	(0,00 %)
USD	5.001.830	MYR	(20.500.000)	BNP Paribas	05.02.2018	(56.901)	(0,00 %)
USD	4.878.049	MYR	(20.000.000)	BNP Paribas	05.02.2018	(57.298)	(0,00 %)
USD	5.001.220	MYR	(20.500.000)	BNP Paribas	05.02.2018	(57.511)	(0,00 %)
USD	5.001.220	MYR	(20.500.000)	BNP Paribas	05.02.2018	(57.511)	(0,00 %)
USD	11.100.447	ILS	(38.745.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(59.952)	(0,00 %)
USD	5.067.718	CHF	(5.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(63.118)	(0,00 %)
USD	5.339.388	GBP	(4.000.000)	UBS	03.01.2018	(71.611)	(0,00 %)
USD	13.423.300	GBP	(10.000.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(104.198)	(0,00 %)
USD	5.899.100	EUR	(5.000.000)	UBS	03.01.2018	(104.901)	(0,00 %)
USD	8.325.569	HUF	(2.180.000.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(113.185)	(0,00 %)
USD	27.492.311	THB	(899.053.570)	BNP Paribas	02.02.2018	(118.839)	(0,00 %)
USD	16.641.610	SGD	(22.415.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(131.063)	(0,00 %)
USD	11.875.774	EUR	(10.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(132.228)	(0,00 %)
USD	29.873.930	EUR	(25.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(146.075)	(0,00 %)
USD	1.059.331.798	JPY	(119.170.590.000)	UBS	02.02.2018	(150.687)	(0,00 %)
USD	12.406.371	NOK	(102.730.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(153.307)	(0,00 %)
USD	5.316.192	AUD	(7.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(158.859)	(0,00 %)
USD	37.058.328	DKK	(230.790.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(163.464)	(0,00 %)
USD	15.742.738	CAD	(20.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(219.590)	(0,00 %)
USD	17.431.388	RUB	(1.021.000.000)	JP Morgan Chase	09.01.2018	(289.320)	(0,00 %)
USD	64.194.744	CHF	(62.855.000)	BNP Paribas	04.01.2018	(309.500)	(0,00 %)
USD	23.099.639	PLN	(81.350.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(311.780)	(0,00 %)
USD	27.390.409	MYR	(112.508.843)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(410.145)	(0,01 %)
USD	12.494.270	NZD	(18.215.000)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	(460.084)	(0,01 %)
USD	29.463.750	EUR	(25.000.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(556.255)	(0,01 %)
USD	42.682.692	SEK	(354.770.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(647.995)	(0,01 %)
USD	2.736.781.556	EUR	(2.275.380.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(695.525)	(0,01 %)
USD	131.244.316	KRW	(141.539.120.000)	BNP Paribas	02.02.2018	(1.035.236)	(0,01 %)
USD	127.865.890	KRW	(138.439.120.000)	BNP Paribas	02.01.2018	(1.449.995)	(0,02 %)
USD	137.314.493	AUD	(180.905.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(4.180.368)	(0,04 %)
USD	260.435.152	CAD	(335.335.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(7.201.226)	(0,08 %)
USD	2.655.344.072	EUR	(2.222.380.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(13.290.306)	(0,14 %)
						(20.253.966)	(0,21 %)

Offene Devisenterminkontrakte zu Absicherungszwecken auf Ebene der Anteilsklasse 0,11 % (2016: (0,67 %))

EUR	1.885.177.537	USD	(2.252.447.824)	JP Morgan Chase	03.01.2018	11.273.765	0,12 %
CHF	1.130.427.175	USD	(1.154.522.050)	BNP Paribas	04.01.2018	5.566.263	0,06 %
EUR	1.929.153.980	USD	(2.320.347.824)	JP Morgan Chase	02.02.2018	589.692	0,01 %
CHF	1.058.184.917	USD	(1.087.902.050)	BNP Paribas	02.02.2018	424.059	0,01 %
EUR	38.495.103	USD	(46.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	224.927	0,00 %
GBP	3.190.371.885	USD	(4.320.155.948)	JP Morgan Chase	02.02.2018	195.117	0,00 %
CHF	13.205.558	USD	(13.360.000)	UBS	04.01.2018	192.057	0,00 %
GBP	9.234.697	USD	(12.320.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	172.234	0,00 %
GBP	12.992.334	USD	(17.440.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	135.378	0,00 %
EUR	5.697.900	USD	(6.710.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	132.039	0,00 %
GBP	12.065.774	USD	(16.190.000)	BNP Paribas	03.01.2018	131.973	0,00 %
EUR	11.291.473	USD	(13.460.000)	BNP Paribas	03.01.2018	98.803	0,00 %
GBP	9.240.300	USD	(12.410.000)	BNP Paribas	03.01.2018	89.814	0,00 %
GBP	4.772.082	USD	(6.370.000)	UBS	03.01.2018	85.434	0,00 %
GBP	5.098.871	USD	(6.820.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	77.497	0,00 %
CHF	15.243.038	USD	(15.570.000)	BNP Paribas	04.01.2018	72.998	0,00 %
GBP	4.673.711	USD	(6.250.000)	BNP Paribas	03.01.2018	72.362	0,00 %
CHF	5.530.070	USD	(5.610.000)	BNP Paribas	04.01.2018	65.173	0,00 %
GBP	3.581.784	USD	(4.790.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	55.258	0,00 %
GBP	28.667.017	USD	(38.730.000)	BNP Paribas	03.01.2018	49.302	0,00 %

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
EUR	4.398.850	USD	(5.240.000)	BNP Paribas	03.01.2018	42.141	0,00 %
EUR	3.990.423	USD	(4.750.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	41.701	0,00 %
EUR	1.937.886	USD	(2.290.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	37.014	0,00 %
EUR	1.675.084	USD	(1.980.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	31.442	0,00 %
EUR	2.066.156	USD	(2.450.000)	BNP Paribas	03.01.2018	31.041	0,00 %
GBP	1.941.039	USD	(2.600.000)	BNP Paribas	03.01.2018	25.740	0,00 %
EUR	1.851.467	USD	(2.200.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	23.242	0,00 %
CHF	2.097.281	USD	(2.130.000)	JP Morgan Chase	04.01.2018	22.311	0,00 %
GBP	3.754.985	USD	(5.060.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	19.555	0,00 %
CHF	2.375.109	USD	(2.420.000)	BNP Paribas	04.01.2018	17.429	0,00 %
GBP	1.897.573	USD	(2.550.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	16.941	0,00 %
CHF	575.184	USD	(580.000)	BNP Paribas	04.01.2018	10.276	0,00 %
GBP	20.902.809	USD	(28.300.000)	BNP Paribas	02.02.2018	6.253	0,00 %
USD	4.320.155.948	GBP	(3.193.610.015)	JP Morgan Chase	03.01.2018	632	0,00 %
EUR	2.510.599	USD	(3.020.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	466	0,00 %
CHF	1.507.112	USD	(1.550.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	40	0,00 %
JPY	5.388.793	USD	(47.900)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	9	0,00 %
USD	434	JPY	(48.827)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	—	0,00 %
JPY	11.243	USD	(100)	BNP Paribas	02.02.2018	—	0,00 %
USD	57	JPY	(6.449)	BNP Paribas	05.01.2018	—	0,00 %
JPY	46.069	USD	(409)	Brown Brothers Harriman & Co.	05.01.2018	—	0,00 %
GBP	5.257.096	USD	(7.111.536)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	(1)	(0,00 %)
USD	11.693.824	EUR	(9.738.361)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	(2)	(0,00 %)
USD	47.900	JPY	(5.395.930)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	(5)	(0,00 %)
JPY	85.664	USD	(767)	BNP Paribas	05.01.2018	(7)	(0,00 %)
USD	4.802.060	CHF	(4.679.607)	Brown Brothers Harriman & Co.	04.01.2018	(335)	(0,00 %)
JPY	5.270.646	USD	(47.190)	BNP Paribas	05.01.2018	(397)	(0,00 %)
USD	2.320.347.824	EUR	(1.932.334.964)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(412)	(0,00 %)
CHF	4.789.791	USD	(4.930.000)	BNP Paribas	02.02.2018	(3.778)	(0,00 %)
USD	31.350.000	GBP	(23.154.303)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(5.190)	(0,00 %)
EUR	11.135.746	USD	(13.410.000)	BNP Paribas	02.02.2018	(12.743)	(0,00 %)
USD	1.760.000	EUR	(1.480.008)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(17.194)	(0,00 %)
USD	1.190.000	EUR	(1.005.660)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(17.597)	(0,00 %)
USD	2.290.000	CHF	(2.258.938)	BNP Paribas	04.01.2018	(28.210)	(0,00 %)
USD	4.760.000	EUR	(4.008.160)	BNP Paribas	03.01.2018	(52.999)	(0,00 %)
USD	1.087.902.050	CHF	(1.060.160.548)	BNP Paribas	04.01.2018	(75.918)	(0,00 %)
GBP	31.656.472	USD	(42.910.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(86.713)	(0,00 %)
USD	10.670.000	GBP	(7.961.082)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(99.353)	(0,00 %)
USD	9.470.000	EUR	(8.014.726)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(154.085)	(0,00 %)
USD	42.240.000	CHF	(41.503.757)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	(352.769)	(0,00 %)
USD	61.760.000	CHF	(60.850.565)	BNP Paribas	04.01.2018	(687.216)	(0,01 %)
GBP	3.066.737.363	USD	(4.156.385.948)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(7.857.588)	(0,08 %)
						10.577.866	0,11 %
Summe Derivative Finanzinstrumente						(9.775.761)	(0,10 %)
						162.525.276	1,71 %
Sonstige Aktiva und Passiva						162.525.276	1,71 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)						9.514.406.389	100,00 %
Analyse des Gesamtvermögens						US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind						6.728.117.914	70,71 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						2.073.591.177	21,79 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						559.947.783	5,89 %
(d) Derivative Finanzinstrumente						(9.775.761)	(0,10 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva						162.525.276	1,71 %
Gesamtnettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)						9.514.406.389	100,00 %

[^] Zinsvariable Anleihe (FRN). Der Effektivzins zum 31. Dezember 2017.

1 Bezeichnet Wertpapiere, die vollständig oder teilweise als Sicherheiten für offene Derivate verpfändet wurden.

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Kapital	Kosten US-Dollar (\$)		Kapital	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
US Treasury Note 1,50 % 15.8.2020	\$ 114.610.000	114.294.725	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,25 % 15.2.2027	€ 67.759.000	77.022.108
US Treasury Note 1,75 % 15.11.2020	\$ 80.445.000	80.185.323	US Treasury Note 2,38 % 15.5.2027	\$ 66.444.000	67.149.393
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,25 % 15.2.2027	€ 71.300.000	78.985.976	US Treasury Note 1,50 % 15.8.2020	\$ 56.248.000	56.020.719
US Treasury Note 2,13 % 30.9.2024	\$ 77.471.000	77.177.089	US Treasury Note 2,25 % 15.8.2027	\$ 54.958.500	54.625.079
US Treasury Note 2,38 % 15.5.2027	\$ 66.506.000	67.074.607	US Treasury Note 2,25 % 15.2.2027	\$ 54.074.000	53.430.028
US Treasury Note 1,63 % 15.3.2020	\$ 64.246.000	64.451.686	Bundesobligation 0,00 % 8.4.2022	€ 40.000.000	48.048.345
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,50 % 15.8.2027	€ 49.400.000	58.840.908	US Treasury Note 2,13 % 30.9.2024	\$ 39.815.000	39.499.972
US Treasury Note 2,25 % 15.8.2027	\$ 55.608.500	55.202.402	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,50 % 15.8.2027	€ 32.474.902	38.814.101
US Treasury Note 2,25 % 15.2.2027	\$ 54.074.000	53.563.593	US Treasury Note 1,88 % 28.2.2022	\$ 36.595.000	36.557.940
Bundesobligation 0,00 % 8.4.2022	€ 47.000.000	53.465.013	US Treasury Bond 3,00 % 15.2.2047	\$ 34.160.000	34.888.701
US Treasury Note 1,38 % 30.9.2019	\$ 49.645.000	49.447.193	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3,25 % 4.7.2021	€ 26.400.000	32.683.516
US Treasury Note 1,63 % 15.10.2020	\$ 46.864.100	46.738.594	US Treasury Note 1,00 % 15.3.2019	\$ 28.830.000	28.657.696
US Treasury Note 1,00 % 15.11.2019	\$ 44.000.000	43.520.469	US Treasury Note 1,25 % 31.12.2018	\$ 28.000.000	27.913.236
French Republic Government Bond OAT 1,00 % 25.5.2027	€ 36.000.000	42.916.288	US Treasury Bond 2,88 % 15.11.2046	\$ 28.535.000	27.667.793
US Treasury Note 1,75 % 30.6.2022	\$ 41.505.000	41.243.649	US Treasury Note 1,38 % 30.9.2019	\$ 26.997.000	26.820.036
US Treasury Note 1,88 % 28.2.2022	\$ 39.000.000	38.861.328	US Treasury Bond 3,00 % 15.5.2047	\$ 25.508.000	26.400.297
US Treasury Note 2,00 % 30.4.2024	\$ 38.400.000	38.144.508	US Treasury Note 1,50 % 15.5.2020	\$ 26.003.000	26.024.647
Bundesobligation 0,00 % 7.10.2022	€ 31.191.434	37.369.596	US Treasury Note 1,88 % 31.1.2022	\$ 25.380.000	25.357.031
US Treasury Note 1,50 % 15.7.2020	\$ 37.100.000	36.985.958	US Treasury Note 2,00 % 31.12.2021	\$ 24.525.000	24.648.194
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,25 % 4.9.2020	€ 28.000.000	35.571.953	Bundesobligation 0,00 % 17.4.2020	€ 21.000.000	24.617.417

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	9.361.656.874	6.239.827.886
Derivative Finanzinstrumente	33.437.268	44.457.824
Barmittel und liquide Vermögenswerte	264.173.150	234.082.713
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	61.526.137	43.323.049
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	46.206.665	26.272.182
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	48.523.047	12.094.022
Bareinschüsse für Futures	158.122	20.372
Sonstige Forderungen	76.249	9.551
Summe Umlaufvermögen	9.815.757.512	6.600.087.599
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	43.213.029	47.260.919
Überziehungskredit	—	21.960
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	260.299	177.498
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	237.211.806	194.708.564
Zahlbare Dividenden	4.636.651	3.066.705
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	14.974.564	3.718.066
Zahlbare Verwaltungsgebühren	1.054.774	715.233
Summe kurzfristige Passiva	301.351.123	249.668.945
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	9.514.406.389	6.350.418.654

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Anteile, abgesichert in CHF (CHF)			
Gegenwert in US (\$)	1.084.224.505	1.083.625.071	862.224.438
Nettovermögen	1.056.576.780	1.101.342.341	863.086.662
Anzahl der umlaufenden Anteile	8.125.828	8.521.899	6.787.320
Nettoinventarwert je Anteil	130,03	129,24	127,16
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR (€)			
Gegenwert in US (\$)	443.352.530	295.675.822	202.443.364
Nettovermögen	369.214.301	280.327.877	186.360.457
Anzahl der umlaufenden Anteile	3.600.155	2.765.481	1.882.102
Nettoinventarwert je Anteil	102,56	101,37	99,02
Institutionelle Anteile, abgesichert in USD (\$)			
Nettovermögen	906.920.260	606.694.419	571.151.427
Anzahl der umlaufenden Anteile	6.241.087	4.301.449	4.204.233
Nettoinventarwert je Anteil	145,31	141,04	135,85
Anlegeranteile, abgesichert in CHF (CHF)			
Gegenwert in US (\$)	8.417.090	4.904.266	2.518.054
Nettovermögen	8.202.454	4.984.451	2.520.572
Anzahl der umlaufenden Anteile	81.368	49.723	25.556
Nettoinventarwert je Anteil	100,81	100,24	98,63
Anlegeranteile, abgesichert in EUR (€)			
Gegenwert in US (\$)	13.819.791	7.901.974	1.607.345
Nettovermögen	11.508.820	7.491.798	1.479.651
Anzahl der umlaufenden Anteile	111.937	73.684	14.885
Nettoinventarwert je Anteil	102,82	101,67	99,40

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Nettoinventarwert je Anteil (Fortsetzung)

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Anlegeranteile, abgesichert in USD (\$)			
Nettovermögen	21.881.552	13.821.650	4.081.018
Anzahl der umlaufenden Anteile	205.203	133.476	40.898
Nettoinventarwert je Anteil	106,63	103,55	99,79
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in US (\$)	2.989.723.302	1.971.115.483	1.481.795.224
Nettovermögen	2.210.107.857	1.595.205.409	1.005.356.702
Anzahl der umlaufenden Anteile	14.924.994	10.987.662	7.168.732
Nettoinventarwert je Anteil	148,08	145,18	140,24
Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in US (\$)	607.941.277	450.488.177	540.075.976
Nettovermögen	449.411.420	364.575.888	366.426.476
Anzahl der umlaufenden Anteile	3.362.353	2.737.736	2.801.567
Nettoinventarwert je Anteil	133,66	133,17	130,79
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in CHF (CHF)			
Gegenwert in US (\$)	1.360.667	3.986.058	23.720.173
Nettovermögen	1.325.970	4.051.230	23.743.894
Anzahl der umlaufenden Anteile	12.787	39.336	234.224
Nettoinventarwert je Anteil	103,70	102,99	101,37
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in EUR (€)			
Gegenwert in US (\$)	1.878.039.551	969.428.632	512.439.666
Nettovermögen	1.563.990.310	919.107.515	471.729.420
Anzahl der umlaufenden Anteile	14.215.763	8.456.260	4.444.691
Nettoinventarwert je Anteil	110,02	108,69	106,13
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in JPY (¥)			
Gegenwert in US (\$)	47543	45.261	—
Nettovermögen	5.355.719	5.279.017	—
Anzahl der umlaufenden Anteile	545	545	—
Nettoinventarwert je Anteil	9.827,01	9.686,27	—
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in USD (\$)			
Nettovermögen	843.607.734	632.068.161	75.746
Anzahl der umlaufenden Anteile	7.889.164	6.092.916	759
Nettoinventarwert je Anteil	106,93	103,74	99,87
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in US (\$)	204.902.617	7.531.967	1.192.540
Nettovermögen	151.471.169	6.095.551	809.105
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.383.207	56.803	7.809
Nettoinventarwert je Anteil	109,51	107,31	103,61
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in US (\$)	510.167.970	303.131.713	178.214.887
Nettovermögen	377.133.977	245.321.673	120.913.827
Anzahl der umlaufenden Anteile	3.646.348	2.380.756	1.194.964
Nettoinventarwert je Anteil	103,43	103,04	101,19

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	143.463.322	95.777.884
Verschiedene Erträge	405.150	129.350
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	603.268.780	(554.079.983)
Summe Anlageerträge/(-verluste)	747.137.252	(458.172.749)
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	10.685.937	7.448.773
Transaktionsgebühren und Provisionen	10.420	5.488
Sonstige Aufwendungen	15.207	(13.132)
Summe Aufwendungen	10.711.564	7.441.129
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	369.150	152.076
Ausgezahlte Ausschüttungen	16.005.505	12.358.967
Ertragsausgleich	(605.910)	(223.496)
Summe Finanzierungskosten	15.768.745	12.287.547
Nettoanlageerträge/(-verluste)	720.656.943	(477.901.425)
Ausländische Quellensteuer	(561.833)	(434.455)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	720.095.110	(478.335.880)

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	720.095.110	(478.335.880)
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	4.319.781.381	9.607.786.599
Rücknahmen	(1.875.913.574)	(7.160.589.024)
Reinvestitionen	24.818	17.101
Summe Kapitalgeschäfte ¹	2.443.892.625	2.447.214.676
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	3.163.987.735	1.968.878.796
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	6.350.418.654	4.381.539.858
Zum Jahresende	9.514.406.389	6.350.418.654

¹ Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Global Corporate Bond Index Fund

Verwaltet durch The Vanguard Group, Inc.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds hat sich zum Ziel gesetzt, Renditen zu liefern, die der Performance des Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Corporate Index Hedged, einem marktgewichteten Index aus globalen festverzinslichen Unternehmensanlagen mit Laufzeiten von mehr als einem Jahr.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	2.658	10.939
Rendite auf Endfälligkeit	2,5 % ³	2,5 %
Durchschnittlicher Kupon	3,4 %	3,5 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	9,1 Jahre	9,1 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	A3	A3
Durchschnittliche Duration	6,6 Jahre	6,6 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Anlegeranteile	0,25 %	
Thesaurierungsanteile	0,20 %	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,12 %	
Kurzfristige Reserven	2,3 %	—

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds
Industriegüter	54,3 %
Finanzinstitute	36,2
Versorger	7,6
Barmittel	1,0
Treasury/Federal	0,8
Provincials/Municipals	0,1

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	1,7 %
Aa	9,1
A	40,7
Baa	47,0
nicht eingestuft	1,5

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	41,5 %
5-10 Jahre	32,5
Mehr als 5 Jahre	26,0

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit

Durchschnittliche Fälligkeit	Kurz	Mittel	Lang
Kreditqualität Staats-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Corporate Index Hedged.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

Global Corporate Bond Index Fund

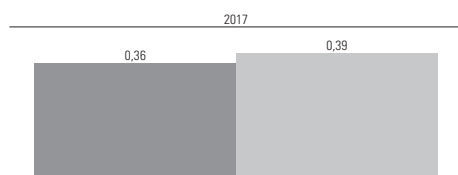
Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Corporate Index USD-Hedged

Abgesichert in US-Dollar

	Gesamtrenditen		Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in USD	0,36 %		\$ 5.018.089
Benchmark	0,39		5.019.743

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,03 Prozentpunkte für in USD abgesicherte institutionelle Thesaurierungsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 2. November 2017–31. Dezember 2017



 Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in USD
 Benchmark

¹ 2. November 2017.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Global Corporate Bond Index Fund
Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Corporate Index GBP-Hedged

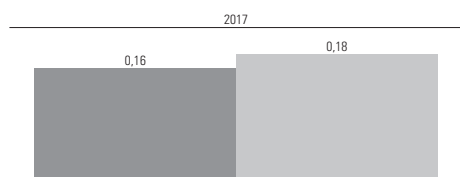
Abgesichert in GBP

	Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017 Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von a £ 100.000
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in GBP	0,16 %	£ 100.156
Benchmark	0,18	100.184

	Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017 Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	0,19 %	£ 200.377.813
Benchmark	0,18	200.368.721

Der Tracking-Unterschied für den Zeitraum betrug 0,02 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte thesaurierende Anlegeranteile und 0,01 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 2. November 2017–31. Dezember 2017



	Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in GBP
	Benchmark

¹ 2. November 2017.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 98,05 %					
Australien 2,40 %					
Westpac Banking Corp.	\$ 300.000	2,15 %	06.03.2020	298.548	0,09 %
Telstra Corp., Ltd.	AUD 350.000	2,90 %	19.04.2021	273.666	0,08 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 250.000	2,70 %	16.11.2020	251.310	0,07 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 250.000	2,25 %	10.03.2020	249.419	0,07 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 250.000	2,25 %	10.01.2020	249.417	0,07 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd	\$ 250.000	2,63 %	19.05.2022	249.076	0,07 %
Westpac Banking Corp.	\$ 250.000	1,65 %	13.05.2019	248.154	0,07 %
Commonwealth Bank of Australia	AUD 300.000	3,75 %	18.10.2019	240.071	0,07 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 250.000	2,50 %	12.07.2026	237.132	0,07 %
Macquarie Bank Ltd.	\$ 200.000	4,88 %	10.06.2025	211.097	0,06 %
WEA Finance LLC/Westfield UK & Europe Finance plc	\$ 200.000	3,75 %	17.09.2024	205.192	0,06 %
Suncorp-Metway Ltd.	\$ 200.000	2,38 %	09.11.2020	198.750	0,06 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 200.000	2,50 %	18.09.2022	197.848	0,06 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.	\$ 175.000	2,88 %	24.02.2022	176.774	0,05 %
Rio Tinto Finance USA plc	\$ 175.000	2,88 %	21.08.2022	175.983	0,05 %
National Australia Bank Ltd.	AUD 200.000	3,00 %	10.02.2023	155.302	0,05 %
National Australia Bank Ltd.	£ 100.000	5,13 %	09.12.2021	154.904	0,04 %
Westpac Banking Corp.^	\$ 150.000	4,32 %	23.11.2031	154.058	0,04 %
Woodside Finance Ltd.	\$ 150.000	3,65 %	05.03.2025	150.990	0,04 %
BHP Billiton Finance Ltd.	£ 100.000	3,25 %	25.09.2024	148.722	0,04 %
Scentre Group Trust 1/Scentre Group Trust 2	£ 100.000	2,38 %	08.04.2022	139.962	0,04 %
Westpac Banking Corp.	£ 100.000	2,13 %	02.05.2025	137.197	0,04 %
AusNet Services Holdings Pty Ltd.	€ 100.000	3,00 %	13.02.2024	136.088	0,04 %
BHP Billiton Finance Ltd.^	€ 100.000	4,75 %	22.04.2076	134.277	0,04 %
National Australia Bank Ltd.	€ 100.000	4,00 %	13.07.2020	132.098	0,04 %
Commonwealth Bank of Australia	€ 100.000	4,38 %	25.02.2020	131.386	0,04 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	€ 100.000	5,13 %	10.09.2019	130.306	0,04 %
Scentre Group Trust 1	€ 100.000	2,25 %	16.07.2024	129.920	0,04 %
BHP Billiton Finance Ltd.	€ 100.000	2,25 %	25.09.2020	127.366	0,04 %
Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd.	€ 100.000	1,75 %	15.10.2024	126.492	0,04 %
Rio Tinto Finance plc	€ 100.000	2,00 %	11.05.2020	125.476	0,04 %
APT Pipelines Ltd.	€ 100.000	2,00 %	22.03.2027	124.043	0,04 %
Commonwealth Bank of Australia^	€ 100.000	2,00 %	22.04.2027	124.039	0,04 %
Westpac Banking Corp.	€ 100.000	0,88 %	16.02.2021	122.943	0,04 %
Transurban Finance Co. Pty Ltd.	€ 100.000	1,75 %	29.03.2028	122.381	0,04 %
BHP Billiton Finance Ltd.	€ 100.000	1,50 %	29.04.2030	121.932	0,04 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.	\$ 100.000	5,00 %	30.09.2043	121.763	0,04 %
Telstra Corp., Ltd.	€ 100.000	1,13 %	14.04.2026	120.985	0,04 %
Westpac Banking Corp.	€ 100.000	1,13 %	05.09.2027	120.869	0,03 %
Commonwealth Bank of Australia	€ 100.000	0,50 %	11.07.2022	120.712	0,03 %
National Australia Bank Ltd.	€ 100.000	0,35 %	07.09.2022	119.677	0,03 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.^	\$ 100.000	6,75 %	19.10.2075	116.750	0,03 %
Rio Tinto Finance USA Ltd.	\$ 100.000	3,75 %	15.06.2025	104.738	0,03 %
Macquarie Bank Ltd.	\$ 100.000	3,90 %	15.01.2026	103.599	0,03 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 100.000	3,90 %	12.07.2047	101.698	0,03 %
Westpac Banking Corp.	\$ 100.000	2,75 %	11.01.2023	99.650	0,03 %
Macquarie Group Ltd.^	\$ 100.000	3,76 %	28.11.2028	99.614	0,03 %
Macquarie Group Ltd.^	\$ 100.000	3,19 %	28.11.2023	99.299	0,03 %
Westpac Banking Corp.	\$ 100.000	2,50 %	28.06.2022	99.266	0,03 %
National Australia Bank Ltd.	€ 50.000	4,63 %	10.02.2020	65.602	0,02 %
Barrick PD Australia Finance Pty Ltd.	\$ 50.000	5,95 %	15.10.2039	62.062	0,02 %
National Australia Bank Ltd.	€ 50.000	1,25 %	18.05.2026	61.698	0,02 %
Rio Tinto Finance USA plc	\$ 50.000	4,13 %	21.08.2042	53.756	0,02 %
Macquarie Group Ltd.	\$ 50.000	6,00 %	14.01.2020	53.193	0,02 %
APT Pipelines Ltd.	\$ 50.000	4,25 %	15.07.2027	51.730	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 40.000	1,75 %	07.11.2019	39.610	0,01 %
Rio Tinto Finance USA Ltd.	\$ 25.000	5,20 %	02.11.2040	30.380	0,01 %
Newcrest Finance Pty Ltd.	\$ 25.000	5,75 %	15.11.2041	28.453	0,01 %
				8.167.423	2,40 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Österreich 0,19 %					
OMV AG^	€ 100.000	5,25 %	09.12.2166	136.591	0,04 %
Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe^	€ 100.000	3,75 %	02.03.2046	134.007	0,04 %
OMV AG	€ 100.000	4,38 %	10.02.2020	131.144	0,04 %
JAB Holdings BV	€ 100.000	1,25 %	22.05.2024	122.048	0,04 %
OMV AG	€ 100.000	1,00 %	14.12.2026	118.436	0,03 %
				642.226	0,19 %
Belgien 0,59 %					
Anheuser-Busch InBev SA	€ 200.000	2,75 %	17.03.2036	263.563	0,08 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 200.000	1,50 %	17.03.2025	251.974	0,07 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 200.000	0,88 %	17.03.2022	245.966	0,07 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 200.000	0,63 %	17.03.2020	243.432	0,07 %
Anheuser-Busch InBev SA	£ 100.000	2,85 %	25.05.2037	135.234	0,04 %
Anheuser-Busch InBev SA	£ 100.000	1,75 %	07.03.2025	133.821	0,04 %
Belfius Bank SA	€ 100.000	3,13 %	11.05.2026	131.493	0,04 %
Elia System Operator SA	€ 100.000	1,38 %	27.05.2024	124.197	0,04 %
KBC Group NV	€ 100.000	1,00 %	26.04.2021	122.973	0,04 %
Euroclear Investments SA	€ 100.000	1,13 %	07.12.2026	121.266	0,04 %
Brussels Airport Co. NV	€ 100.000	1,00 %	03.05.2024	120.745	0,03 %
Belfius Bank SA	€ 100.000	0,75 %	12.09.2022	120.369	0,03 %
				2.015.033	0,59 %
Bermuda 0,05 %					
XLIT Ltd.^	€ 100.000	3,25 %	29.06.2047	121.122	0,04 %
Allied World Assurance Co. Holdings Ltd.	\$ 40.000	4,35 %	29.10.2025	40.116	0,01 %
				161.238	0,05 %
Brasilien 0,32 %					
Vale Overseas Ltd.	\$ 150.000	6,88 %	21.11.2036	183.937	0,05 %
Vale Overseas Ltd.	\$ 125.000	6,88 %	10.11.2039	152.812	0,04 %
Braskem Finance Ltd.	\$ 100.000	6,45 %	03.02.2024	111.875	0,03 %
Vale Overseas Ltd.	\$ 100.000	5,88 %	10.06.2021	109.125	0,03 %
Embraer SA	\$ 100.000	5,15 %	15.06.2022	106.553	0,03 %
Vale Overseas Ltd.	\$ 100.000	4,38 %	11.01.2022	103.500	0,03 %
Gerdau Trade, Inc.	\$ 100.000	4,75 %	15.04.2023	102.000	0,03 %
Braskem America Finance Co.	\$ 50.000	7,13 %	22.07.2041	59.625	0,02 %
Vale Canada Ltd.	\$ 50.000	7,20 %	15.09.2032	57.553	0,02 %
Embraer Netherlands Finance BV	\$ 50.000	5,40 %	01.02.2027	53.923	0,02 %
Fibria Overseas Finance Ltd.	\$ 50.000	5,50 %	17.01.2027	53.625	0,02 %
				1.094.528	0,32 %
Kanada 3,76 %					
Toronto-Dominion Bank	\$ 300.000	1,85 %	11.09.2020	295.964	0,09 %
Royal Bank of Canada	\$ 250.000	2,75 %	01.02.2022	252.360	0,07 %
Royal Bank of Canada	\$ 250.000	2,13 %	02.03.2020	248.979	0,07 %
National Bank of Canada	\$ 250.000	2,15 %	12.06.2020	248.825	0,07 %
Bank of Montreal	\$ 250.000	1,75 %	11.09.2019	247.888	0,07 %
Royal Bank of Canada	CAD 300.000	1,92 %	17.07.2020	237.371	0,07 %
Toronto-Dominion Bank	CAD 300.000	1,69 %	02.04.2020	236.693	0,07 %
407 International, Inc.	CAD 300.000	2,43 %	04.05.2027	232.111	0,07 %
Alimentation Couche-Tard, Inc.	\$ 225.000	3,55 %	26.07.2027	224.734	0,07 %
Bank of Nova Scotia	\$ 200.000	2,05 %	05.06.2019	199.322	0,06 %
Bank of Montreal	CAD 250.000	2,10 %	06.10.2020	198.350	0,06 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	\$ 200.000	2,10 %	05.10.2020	198.304	0,06 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	CAD 250.000	1,66 %	20.01.2020	197.392	0,06 %
Rogers Communications, Inc.	CAD 200.000	4,00 %	13.03.2024	168.980	0,05 %
Royal Bank of Canada^	CAD 200.000	2,99 %	06.12.2024	161.741	0,05 %
Bank of Nova Scotia	CAD 200.000	2,13 %	15.06.2020	159.108	0,05 %
TELUS Corp.	CAD 200.000	4,40 %	01.04.2043	158.972	0,05 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	CAD 200.000	2,30 %	11.07.2022	158.037	0,05 %
Caisse Centrale Desjardins	CAD 200.000	1,75 %	02.03.2020	157.990	0,05 %
National Bank of Canada	CAD 200.000	1,74 %	03.03.2020	157.968	0,05 %
Bank of Montreal	CAD 200.000	2,27 %	11.07.2022	157.834	0,05 %
HSBC Bank Canada	CAD 200.000	2,17 %	29.06.2022	156.574	0,05 %
Bank of Nova Scotia	CAD 200.000	1,83 %	27.04.2022	155.184	0,05 %
Brookfield Finance, Inc.	\$ 150.000	4,25 %	02.06.2026	154.660	0,05 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 125.000	5,60 %	31.03.2034	152.507	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Toronto-Dominion Bank^	\$ 150.000	3,63 %	15.09.2031	149.772	0,04 %
Bank of Nova Scotia	\$ 150.000	2,15 %	14.07.2020	149.344	0,04 %
Royal Bank of Canada	CAD 150.000	4,93 %	16.07.2025	136.622	0,04 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 125.000	7,13 %	15.01.2019	131.263	0,04 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 125.000	5,40 %	15.06.2047	130.625	0,04 %
CU, Inc.	CAD 150.000	3,76 %	19.11.2046	125.646	0,04 %
Canadian Natural Resources Ltd.	\$ 100.000	6,50 %	15.02.2037	124.514	0,04 %
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co., Ltd.	CAD 150.000	4,05 %	22.07.2044	124.505	0,04 %
TransCanada PipeLines Ltd.	CAD 150.000	3,39 %	15.03.2028	122.519	0,04 %
Bell Canada, Inc.	CAD 150.000	3,35 %	18.06.2019	121.756	0,04 %
Alimentation Couche-Tard, Inc.	CAD 150.000	3,06 %	26.07.2024	118.811	0,03 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 100.000	5,00 %	16.10.2043	118.258	0,03 %
HSBC Bank Canada	CAD 150.000	1,82 %	07.07.2020	118.179	0,03 %
Petro-Canada	\$ 100.000	5,35 %	15.07.2033	117.622	0,03 %
Royal Bank of Canada	CAD 150.000	2,00 %	21.03.2022	117.365	0,03 %
North West Redwater Partnership/NWR Financing Co Ltd.	CAD 150.000	2,80 %	01.06.2027	115.809	0,03 %
Enbridge, Inc.	CAD 150.000	4,24 %	27.08.2042	114.819	0,03 %
Manulife Financial Corp.	\$ 100.000	4,15 %	04.03.2026	105.567	0,03 %
Agrium, Inc.	\$ 100.000	6,75 %	15.01.2019	104.388	0,03 %
Enbridge, Inc.	\$ 100.000	4,25 %	01.12.2026	104.337	0,03 %
Encana Corp.	\$ 100.000	3,90 %	15.11.2021	102.800	0,03 %
Suncor Energy, Inc.	\$ 100.000	4,00 %	15.11.2047	102.376	0,03 %
Agrium, Inc.	\$ 100.000	3,15 %	01.10.2022	101.077	0,03 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 100.000	4,25 %	15.04.2027	99.250	0,03 %
Bank of Nova Scotia	\$ 100.000	1,65 %	14.06.2019	99.244	0,03 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 100.000	2,50 %	01.08.2022	99.166	0,03 %
Bank of Nova Scotia	\$ 100.000	2,45 %	19.09.2022	98.835	0,03 %
Bank of Montreal	\$ 100.000	2,35 %	11.09.2022	98.316	0,03 %
Rogers Communications, Inc.	\$ 100.000	2,90 %	15.11.2026	96.686	0,03 %
Barrick North America Finance LLC	\$ 75.000	5,70 %	30.05.2041	91.738	0,03 %
Toronto-Dominion Bank^	CAD 100.000	4,86 %	04.03.2031	87.957	0,03 %
Barrick Gold Corp.	\$ 75.000	5,25 %	01.04.2042	87.610	0,03 %
Rogers Communications, Inc.	\$ 75.000	5,00 %	15.03.2044	86.120	0,02 %
CU, Inc.	CAD 100.000	6,80 %	13.08.2019	85.755	0,02 %
Bruce Power LP	CAD 100.000	4,01 %	21.06.2029	83.218	0,02 %
Enbridge Pipelines, Inc.	CAD 100.000	4,49 %	12.11.2019	83.176	0,02 %
Bell Canada, Inc.	CAD 100.000	3,35 %	22.03.2023	81.651	0,02 %
Suncor Energy, Inc.	CAD 100.000	3,10 %	26.11.2021	81.437	0,02 %
Canadian Natural Resources Ltd.	CAD 100.000	3,55 %	03.06.2024	81.373	0,02 %
407 International, Inc.	CAD 100.000	3,60 %	21.05.2047	81.303	0,02 %
Canadian Imperial Bank of Commerce^	CAD 100.000	3,42 %	26.01.2026	81.258	0,02 %
Bank of Nova Scotia^	CAD 100.000	3,37 %	08.12.2025	81.205	0,02 %
Husky Energy, Inc.	CAD 100.000	3,55 %	12.03.2025	80.765	0,02 %
Bank of Montreal	CAD 100.000	2,70 %	11.09.2024	79.670	0,02 %
Inter Pipeline Ltd.	CAD 100.000	3,48 %	16.12.2026	79.555	0,02 %
Federation des Caisses Desjardins du Quebec	CAD 100.000	2,39 %	25.08.2022	79.137	0,02 %
Canadian Natural Resources Ltd.	CAD 100.000	2,05 %	01.06.2020	78.983	0,02 %
Bank of Montreal	CAD 100.000	2,70 %	09.12.2026	78.757	0,02 %
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	\$ 75.000	4,88 %	30.03.2020	78.398	0,02 %
Toronto-Dominion Bank	CAD 100.000	1,99 %	23.03.2022	78.379	0,02 %
Enbridge Gas Distribution, Inc.	CAD 100.000	2,50 %	05.08.2026	77.824	0,02 %
Bank of Nova Scotia	CAD 100.000	2,29 %	28.06.2024	77.747	0,02 %
Air Canada 2017-1 Klasse AA Pass Through Trust ¹	\$ 75.000	3,30 %	15.01.2030	75.784	0,02 %
Canadian National Railway Co.	\$ 50.000	6,20 %	01.06.2036	67.438	0,02 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 50.000	6,20 %	15.10.2037	65.884	0,02 %
TransCanada PipeLines Ltd.	CAD 75.000	4,33 %	16.09.2047	64.138	0,02 %
Canadian Natural Resources Ltd.	\$ 50.000	6,75 %	01.02.2039	64.058	0,02 %
Shaw Communications, Inc.	CAD 75.000	4,35 %	31.01.2024	63.988	0,02 %
Encana Corp.	\$ 50.000	6,63 %	15.08.2037	63.416	0,02 %
Bell Canada, Inc.	CAD 75.000	4,45 %	27.02.2047	61.863	0,02 %
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	\$ 50.000	5,88 %	01.12.2036	61.047	0,02 %
Enbridge, Inc.	CAD 75.000	3,16 %	11.03.2021	60.605	0,02 %
Manulife Financial Corp.^	\$ 60.000	4,06 %	24.02.2032	60.421	0,02 %
Bell Canada, Inc.	CAD 75.000	3,60 %	29.09.2027	60.364	0,02 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 50.000	6,75 %	15.11.2039	59.687	0,02 %
Manufacturers Life Insurance Co.^	CAD 75.000	2,10 %	01.06.2025	59.418	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Agrium, Inc.	\$ 50.000	5,25 %	15.01.2045	58.223	0,02 %
Emera US Finance LP	\$ 50.000	4,75 %	15.06.2046	54.859	0,02 %
Great-West Lifeco Finance Delaware LP	\$ 50.000	4,15 %	03.06.2047	52.231	0,02 %
Enbridge, Inc.	\$ 50.000	4,00 %	01.10.2023	52.093	0,02 %
Enbridge, Inc.	\$ 50.000	4,50 %	10.06.2044	51.539	0,01 %
Goldcorp, Inc.	\$ 50.000	3,70 %	15.03.2023	51.283	0,01 %
Canadian Natural Resources Ltd.	\$ 50.000	3,85 %	01.06.2027	51.051	0,01 %
Emera US Finance LP	\$ 50.000	3,55 %	15.06.2026	50.056	0,01 %
Emera US Finance LP	\$ 50.000	2,15 %	15.06.2019	49.729	0,01 %
Emera US Finance LP	\$ 50.000	2,70 %	15.06.2021	49.715	0,01 %
Canadian Natural Resources Ltd.	\$ 50.000	2,95 %	15.01.2023	49.711	0,01 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 50.000	3,00 %	15.08.2022	49.562	0,01 %
Fortis, Inc.	\$ 50.000	2,10 %	04.10.2021	48.770	0,01 %
Fairfax Financial Holdings Ltd.	CAD 50.000	5,84 %	14.10.2022	44.064	0,01 %
AltaLink LP	CAD 50.000	3,99 %	30.06.2042	43.196	0,01 %
AltaLink LP	CAD 50.000	3,40 %	06.06.2024	41.670	0,01 %
Methanex Corp.	\$ 40.000	5,65 %	01.12.2044	41.329	0,01 %
Pembina Pipeline Corp.	CAD 50.000	3,77 %	24.10.2022	41.245	0,01 %
Manufacturers Life Insurance Co.^	CAD 50.000	3,18 %	22.11.2027	40.752	0,01 %
Pembina Pipeline Corp.	CAD 50.000	4,81 %	25.03.2044	40.635	0,01 %
Shaw Communications, Inc.	CAD 50.000	3,80 %	01.03.2027	40.514	0,01 %
Sun Life Financial, Inc.^	CAD 50.000	3,05 %	19.09.2028	39.990	0,01 %
Toronto-Dominion Bank^	CAD 50.000	2,69 %	24.06.2025	39.978	0,01 %
National Bank of Canada	CAD 50.000	1,96 %	30.06.2022	38.918	0,01 %
Goldcorp, Inc.	\$ 35.000	3,63 %	09.06.2021	35.714	0,01 %
Rio Tinto Alcan, Inc.	\$ 25.000	7,25 %	15.03.2031	33.041	0,01 %
Canadian Pacific Railway Co.	\$ 25.000	6,13 %	15.09.2115	32.952	0,01 %
Husky Energy, Inc.	\$ 25.000	6,80 %	15.09.2037	32.443	0,01 %
Thomson Reuters Corp.	\$ 25.000	5,85 %	15.04.2040	30.299	0,01 %
Thomson Reuters Corp.	\$ 25.000	5,65 %	23.11.2043	30.089	0,01 %
Agrium, Inc.	\$ 25.000	4,90 %	01.06.2043	27.868	0,01 %
Rogers Communications, Inc.	CAD 25.000	6,68 %	04.11.2039	26.728	0,01 %
Great-West Lifeco, Inc.	CAD 25.000	6,00 %	16.11.2039	26.438	0,01 %
Thomson Reuters Corp.	\$ 25.000	4,30 %	23.11.2023	26.417	0,01 %
Encana Corp.	\$ 25.000	6,50 %	15.05.2019	26.254	0,01 %
Thomson Reuters Corp.	\$ 25.000	3,85 %	29.09.2024	25.756	0,01 %
Shaw Communications, Inc.	CAD 25.000	6,75 %	09.11.2039	25.608	0,01 %
Rogers Communications, Inc.	\$ 25.000	3,00 %	15.03.2023	25.018	0,01 %
Yamana Gold, Inc.	\$ 25.000	4,63 %	15.12.2027	24.938	0,01 %
TransAlta Corp.	\$ 25.000	6,50 %	15.03.2040	24.899	0,01 %
Thomson Reuters Corp.	\$ 25.000	3,35 %	15.05.2026	24.793	0,01 %
Union Gas Ltd.	CAD 25.000	4,88 %	21.06.2041	24.250	0,01 %
Fortis Inc	\$ 25.000	3,06 %	04.10.2026	24.125	0,01 %
Brookfield Renewable Partners ULC	CAD 25.000	5,14 %	13.10.2020	21.349	0,01 %
SNC-Lavalin Group Inc.	CAD 25.000	6,19 %	03.07.2019	21.038	0,01 %
TransAlta Corp.	CAD 25.000	5,00 %	25.11.2020	20.785	0,01 %
Canadian National Railway Co.	CAD 25.000	3,60 %	01.08.2047	20.291	0,01 %
Fortis Inc	CAD 25.000	2,85 %	12.12.2023	19.943	0,01 %
Emera, Inc.	CAD 25.000	2,90 %	16.06.2023	19.904	0,01 %
Brookfield Renewable Partners ULC	CAD 25.000	3,63 %	15.01.2027	19.822	0,01 %
				12.830.321	3,76 %
Chile 0,15 %					
Cencosud SA	\$ 200.000	4,88 %	20.01.2023	209.370	0,06 %
Celulosa Arauco y Constitucion SA	\$ 100.000	4,50 %	01.08.2024	105.440	0,03 %
Celulosa Arauco y Constitucion SA	\$ 100.000	5,50 %	02.11.2047	103.990	0,03 %
AES Gener SA	\$ 25.000	5,25 %	15.08.2021	26.219	0,01 %
Engie Energia Chile SA	\$ 25.000	4,50 %	29.01.2025	26.148	0,01 %
Enel Americas SA	\$ 25.000	4,00 %	25.10.2026	25.399	0,01 %
Transelect SA	\$ 25.000	3,88 %	12.01.2029	24.802	0,00 %
				521.368	0,15 %
China 0,37 %					
Alibaba Group Holding Ltd.	\$ 200.000	4,20 %	06.12.2047	208.232	0,06 %
Alibaba Group Holding Ltd.	\$ 200.000	3,60 %	28.11.2024	207.498	0,06 %
Baidu, Inc.	\$ 200.000	2,75 %	09.06.2019	200.297	0,06 %
CSCEC Finance Cayman II Ltd.	\$ 200.000	2,70 %	14.06.2021	198.040	0,06 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Azure Orbit III International Finance Ltd.	\$ 200.000	2,63 %	21.03.2021	196.740	0,06 %
Tencent Holdings Ltd.	\$ 100.000	3,38 %	02.05.2019	101.145	0,03 %
Baidu, Inc.	\$ 100.000	3,63 %	06.07.2027	98.736	0,03 %
Alibaba Group Holding Ltd.	\$ 50.000	3,13 %	28.11.2021	50.773	0,01 %
				1.261.461	0,37 %
Dänemark 0,42 %					
Nykredit Realkredit A/S	€ 200.000	0,88 %	13.06.2019	243.119	0,07 %
Danske Bank A/S	\$ 200.000	2,20 %	02.03.2020	199.037	0,06 %
Nykredit Realkredit A/S^	€ 100.000	2,75 %	17.11.2027	128.654	0,04 %
AP Moller – Maersk A/S	€ 100.000	3,38 %	28.08.2019	126.802	0,04 %
Carlsberg Breweries A/S	€ 100.000	2,63 %	03.07.2019	124.913	0,04 %
AP Moller – Maersk A/S	€ 100.000	1,50 %	24.11.2022	124.726	0,04 %
Jyske Bank A/S^	€ 100.000	2,25 %	05.04.2029	123.131	0,04 %
ISS Global A/S	€ 100.000	1,13 %	09.01.2020	122.191	0,03 %
Jyske Bank A/S	€ 100.000	0,63 %	14.04.2021	121.547	0,03 %
Carlsberg Breweries A/S	€ 100.000	0,50 %	06.09.2023	118.515	0,03 %
				1.432.635	0,42 %
Finnland 0,11 %					
OP Corporate Bank plc	£ 100.000	2,50 %	20.05.2022	142.149	0,04 %
Sampo OYJ	€ 100.000	1,00 %	18.09.2023	122.129	0,04 %
OP Corporate Bank plc	€ 100.000	0,38 %	11.10.2022	120.122	0,03 %
				384.400	0,11 %
Frankreich 5,99 %					
Engie SA	€ 350.000	6,88 %	24.01.2019	451.637	0,13 %
Orange SA	£ 200.000	7,25 %	10.11.2020	316.476	0,09 %
BNP Paribas SA	€ 250.000	0,75 %	11.11.2022	305.337	0,09 %
BPCE SA	\$ 300.000	3,00 %	22.05.2022	299.692	0,09 %
BPCE SA	\$ 250.000	5,70 %	22.10.2023	276.917	0,08 %
BPCE SA	€ 200.000	3,00 %	19.07.2024	276.767	0,08 %
Autoroutes du Sud de la France SA	€ 200.000	2,88 %	18.01.2023	269.389	0,08 %
TOTAL SA^	€ 200.000	3,88 %	18.05.2166	268.979	0,08 %
Orange SA	€ 200.000	1,88 %	02.10.2019	248.482	0,07 %
Credit Agricole SA	\$ 250.000	2,38 %	01.07.2021	248.176	0,07 %
Credit Agricole SA	\$ 250.000	3,25 %	04.10.2024	247.977	0,07 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	\$ 250.000	2,20 %	20.07.2020	247.860	0,07 %
BNP Paribas SA	€ 200.000	1,13 %	10.10.2023	245.837	0,07 %
Societe Generale SA	€ 200.000	1,00 %	01.04.2022	245.196	0,07 %
Societe Generale SA	€ 200.000	0,75 %	19.02.2021	244.849	0,07 %
RCI Banque SA	€ 200.000	0,63 %	04.03.2020	242.689	0,07 %
RCI Banque SA	€ 200.000	0,75 %	26.09.2022	241.711	0,07 %
Total Capital International SA	€ 200.000	0,63 %	04.10.2024	239.914	0,07 %
Sanofi	€ 200.000	0,00 %	13.09.2022	236.992	0,07 %
Veolia Environnement SA	€ 200.000	0,31 %	04.10.2023	235.669	0,07 %
AXA SA^	\$ 200.000	5,13 %	17.01.2047	216.260	0,06 %
AXA SA	\$ 150.000	8,60 %	15.12.2030	215.885	0,06 %
BNP Paribas SA	\$ 200.000	4,63 %	13.03.2027	213.743	0,06 %
BNP Paribas SA	\$ 200.000	3,80 %	10.01.2024	206.583	0,06 %
AXA SA^	€ 150.000	3,94 %	07.11.2166	203.950	0,06 %
Societe Generale SA	\$ 200.000	4,00 %	12.01.2027	203.115	0,06 %
BNP Paribas SA	\$ 200.000	2,38 %	21.05.2020	200.025	0,06 %
Credit Agricole SA	€ 150.000	2,63 %	17.03.2027	194.625	0,06 %
AXA SA	€ 150.000	1,13 %	15.05.2028	186.532	0,05 %
Pernod Ricard SA	\$ 150.000	5,50 %	15.01.2042	180.771	0,05 %
BPCE SA	£ 100.000	5,25 %	16.04.2029	164.593	0,05 %
AXA SA^	£ 100.000	5,63 %	16.01.2054	164.529	0,05 %
Pernod Ricard SA	\$ 150.000	4,45 %	15.01.2022	159.231	0,05 %
AXA SA^	£ 100.000	5,45 %	04.03.2166	154.430	0,04 %
Total Capital International SA	\$ 150.000	2,88 %	17.02.2022	151.776	0,04 %
Orange SA^	£ 100.000	5,88 %	07.02.2166	150.898	0,04 %
Orange SA	\$ 100.000	9,00 %	01.03.2031	150.312	0,04 %
BPCE SA	€ 100.000	4,63 %	18.07.2023	143.181	0,04 %
Orange SA^	€ 100.000	5,25 %	07.02.2166	142.557	0,04 %
CNP Assurances^	€ 100.000	4,50 %	10.06.2047	142.019	0,04 %
Bouygues SA	€ 100.000	4,50 %	09.02.2022	140.756	0,04 %
RCI Banque SA	£ 100.000	3,00 %	09.05.2019	138.861	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Valeo SA	€ 100.000	3,25 %	22.01.2024	138.838	0,04 %
Credit Agricole SA	€ 100.000	3,13 %	17.07.2023	137.056	0,04 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 100.000	3,00 %	28.11.2023	136.937	0,04 %
Groupama SA^	€ 100.000	7,88 %	27.10.2039	136.291	0,04 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	€ 100.000	1,00 %	14.06.2022	134.638	0,04 %
Credit Agricole SA	€ 100.000	3,90 %	19.04.2021	134.238	0,04 %
Credit Agricole Assurances SA^	€ 100.000	4,25 %	13.01.2166	134.138	0,04 %
Orange SA	€ 100.000	3,00 %	15.06.2022	134.060	0,04 %
Unibail-Rodamco SE	€ 100.000	2,50 %	04.06.2026	133.995	0,04 %
Unibail-Rodamco SE	€ 100.000	2,50 %	12.06.2023	133.312	0,04 %
Unibail-Rodamco SE	€ 100.000	3,88 %	05.11.2020	133.200	0,04 %
Lafarge SA	€ 100.000	5,50 %	16.12.2019	132.588	0,04 %
TOTAL SA^	€ 100.000	3,37 %	06.10.2166	131.638	0,04 %
Carrefour SA	€ 100.000	4,00 %	09.04.2020	130.722	0,04 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 100.000	2,63 %	31.03.2027	129.784	0,04 %
Suez	€ 100.000	6,25 %	08.04.2019	129.655	0,04 %
BNP Paribas SA^	€ 100.000	2,63 %	14.10.2027	129.243	0,04 %
Sanofi	€ 100.000	1,75 %	10.09.2026	129.241	0,04 %
Orange SA^	€ 100.000	4,25 %	07.02.2166	128.981	0,04 %
Gecina SA	€ 100.000	2,00 %	17.06.2024	128.726	0,04 %
Holding d'Infrastructures de Transport SAS	€ 100.000	2,25 %	24.03.2025	128.585	0,04 %
Societe Fonciere Lyonnaise SA	€ 100.000	2,25 %	16.11.2022	128.409	0,04 %
Credit Agricole SA	€ 100.000	2,38 %	27.11.2020	128.242	0,04 %
Klepierre SA	€ 100.000	1,88 %	19.02.2026	128.233	0,04 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 100.000	2,38 %	24.03.2026	128.053	0,04 %
Suez	€ 100.000	1,75 %	10.09.2025	127.973	0,04 %
BNP Paribas SA	€ 100.000	2,25 %	13.01.2021	127.802	0,04 %
BPCE SA	€ 100.000	2,13 %	17.03.2021	127.780	0,04 %
ICADE	€ 100.000	2,25 %	16.04.2021	127.272	0,04 %
Suez^	€ 100.000	2,88 %	19.04.2166	126.985	0,04 %
Carrefour SA	€ 100.000	1,75 %	15.07.2022	126.867	0,04 %
CNP Assurances	€ 100.000	1,88 %	20.10.2022	126.614	0,04 %
BNP Paribas SA	€ 100.000	2,25 %	11.01.2027	126.340	0,04 %
Auchan Holding SA	€ 100.000	1,75 %	23.04.2021	126.277	0,04 %
Eutelsat SA	€ 100.000	5,00 %	14.01.2019	126.200	0,04 %
Schneider Electric SE	€ 100.000	1,50 %	08.09.2023	126.183	0,04 %
Total Capital Canada Ltd.	€ 100.000	1,88 %	09.07.2020	125.786	0,04 %
TDF Infrastructure SAS	€ 100.000	2,50 %	07.04.2026	125.625	0,04 %
BNP Paribas SA	€ 100.000	2,50 %	23.08.2019	125.255	0,04 %
Kering	€ 100.000	3,13 %	23.04.2019	125.051	0,04 %
Orange SA	€ 100.000	1,50 %	09.09.2027	124.782	0,04 %
Pernod Ricard SA	€ 100.000	1,50 %	18.05.2026	124.615	0,04 %
Total Capital Canada Ltd.	€ 100.000	1,13 %	18.03.2022	124.523	0,04 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 100.000	2,00 %	19.09.2019	124.419	0,04 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 100.000	1,25 %	14.01.2025	124.126	0,04 %
Kering	€ 100.000	1,50 %	05.04.2027	123.986	0,04 %
BNP Paribas SA	€ 100.000	1,50 %	17.11.2025	123.972	0,04 %
Engie SA	€ 100.000	1,50 %	27.03.2028	123.482	0,04 %
APRR SA	€ 100.000	1,13 %	15.01.2021	123.339	0,04 %
Bouygues SA	€ 100.000	1,38 %	07.06.2027	122.945	0,04 %
Arkema SA	€ 100.000	1,50 %	20.04.2027	122.689	0,04 %
Danone SA	€ 100.000	1,38 %	10.06.2019	122.676	0,04 %
Credit Agricole SA	€ 100.000	1,00 %	16.09.2024	122.402	0,04 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 100.000	1,25 %	26.05.2027	122.256	0,04 %
Total Capital International SA	€ 100.000	1,38 %	04.10.2029	122.210	0,04 %
Imerys SA	€ 100.000	0,88 %	31.03.2022	122.062	0,04 %
Credit Mutuel Arkea SA	€ 100.000	1,25 %	31.05.2024	121.929	0,04 %
Unibail-Rodamco SE	€ 100.000	1,50 %	29.05.2029	121.890	0,04 %
BPCE SA	€ 100.000	0,63 %	20.04.2020	121.742	0,04 %
Air Liquide Finance SA	\$ 125.000	2,25 %	27.09.2023	121.638	0,04 %
Orange SA	€ 100.000	0,75 %	11.09.2023	121.418	0,04 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	€ 100.000	0,75 %	26.05.2024	121.389	0,04 %
Accor SA	€ 100.000	1,25 %	25.01.2024	121.103	0,03 %
BNP Paribas SA	€ 100.000	0,50 %	01.06.2022	121.091	0,03 %
Air Liquide Finance SA	€ 100.000	1,00 %	08.03.2027	121.077	0,03 %
Capgemini SE	€ 100.000	0,50 %	09.11.2021	120.999	0,03 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 100.000	0,25 %	14.06.2019	120.699	0,03 %
Cie de Saint-Gobain	€ 100.000	1,00 %	17.03.2025	120.579	0,03 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	€ 100.000	0,38 %	26.05.2022	120.522	0,03 %
BNP Paribas SA	€ 100.000	1,50 %	23.05.2028	120.487	0,03 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 100.000	0,38 %	13.01.2022	120.448	0,03 %
Sanofi	€ 100.000	0,00 %	05.04.2019	120.371	0,03 %
Danone SA	€ 100.000	0,42 %	03.11.2022	120.306	0,03 %
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA	€ 100.000	1,13 %	13.10.2027	120.293	0,03 %
Danone SA	€ 100.000	1,21 %	03.11.2028	120.113	0,03 %
Danone SA	€ 100.000	0,71 %	03.11.2024	120.078	0,03 %
Legrand SA	€ 100.000	0,50 %	09.10.2023	119.613	0,03 %
Airbus Finance BV	€ 100.000	0,88 %	13.05.2026	119.480	0,03 %
Vivendi SA	€ 100.000	0,88 %	18.09.2024	119.404	0,03 %
Renault SA	€ 100.000	1,00 %	28.11.2025	118.457	0,03 %
Publicis Groupe SA	€ 100.000	0,50 %	03.11.2023	118.315	0,03 %
APRR SA	€ 100.000	1,50 %	17.01.2033	117.112	0,03 %
SANEF SA	€ 100.000	0,95 %	19.10.2028	113.312	0,03 %
Engie SA	£ 50.000	5,00 %	01.10.2060	109.478	0,03 %
Engie SA	€ 50.000	5,95 %	16.03.2111	104.380	0,03 %
Veolia Environnement SA	£ 50.000	6,13 %	29.10.2037	100.163	0,03 %
Total Capital International SA	\$ 100.000	2,13 %	10.01.2019	100.052	0,03 %
Orange SA	\$ 100.000	1,63 %	03.11.2019	98.760	0,03 %
Orange SA	\$ 75.000	4,13 %	14.09.2021	79.345	0,02 %
Veolia Environnement SA	\$ 50.000	6,75 %	01.06.2038	65.687	0,02 %
Orange SA	\$ 50.000	5,38 %	13.01.2042	59.311	0,02 %
Total Capital International SA	\$ 45.000	3,75 %	10.04.2024	47.429	0,01 %
Total Capital International SA	\$ 40.000	2,75 %	19.06.2021	40.456	0,01 %
				20.435.401	5,99 %
Deutschland 4,31 %					
Volkswagen Leasing GmbH	€ 300.000	0,25 %	05.10.2020	360.885	0,11 %
innogy Finance BV	£ 200.000	4,75 %	31.01.2034	333.345	0,10 %
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen^	£ 200.000	6,63 %	26.05.2042	324.288	0,09 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 250.000	4,20 %	16.03.2047	274.381	0,08 %
Volkswagen Financial Services NV	£ 200.000	1,75 %	17.04.2020	273.819	0,08 %
innogy Finance BV	€ 200.000	6,63 %	31.01.2019	257.653	0,08 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 250.000	3,40 %	16.03.2027	253.862	0,07 %
Volkswagen International Finance NV^	€ 200.000	3,88 %	14.06.2166	253.528	0,07 %
Daimler AG	€ 200.000	1,50 %	09.03.2026	250.539	0,07 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 250.000	2,20 %	16.03.2020	249.682	0,07 %
Volkswagen International Finance NV	€ 200.000	1,88 %	30.03.2027	247.795	0,07 %
Volkswagen International Finance NV^	€ 200.000	2,70 %	14.12.2166	247.359	0,07 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 200.000	0,88 %	30.01.2024	243.383	0,07 %
BMW Finance NV	€ 200.000	0,75 %	15.04.2024	242.614	0,07 %
Daimler AG	€ 200.000	0,50 %	09.09.2019	242.513	0,07 %
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA	€ 200.000	0,50 %	18.01.2021	242.402	0,07 %
Linde Finance BV	€ 200.000	0,25 %	18.01.2022	241.741	0,07 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 200.000	0,38 %	30.10.2021	241.453	0,07 %
BMW Finance NV	€ 200.000	0,13 %	03.07.2020	240.894	0,07 %
Daimler International Finance BV	€ 200.000	0,20 %	13.09.2021	240.083	0,07 %
Commerzbank AG	\$ 200.000	8,13 %	19.09.2023	239.534	0,07 %
TLG Immobilien AG	€ 200.000	1,38 %	27.11.2024	239.216	0,07 %
Volkswagen Bank GmbH	€ 200.000	0,75 %	15.06.2023	239.216	0,07 %
Deutsche Telekom International Finance BV	\$ 150.000	8,75 %	15.06.2030	224.180	0,07 %
E.ON International Finance BV	£ 100.000	6,75 %	27.01.2039	212.532	0,06 %
Deutsche Bank AG	\$ 200.000	4,25 %	14.10.2021	207.308	0,06 %
innogy Finance BV	€ 100.000	5,75 %	14.02.2033	181.684	0,05 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 150.000	3,50 %	03.08.2025	153.571	0,04 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 150.000	2,85 %	06.01.2022	150.723	0,04 %
Deutsche Telekom International Finance BV	\$ 150.000	2,82 %	19.01.2022	150.030	0,04 %
Deutsche Bank AG	\$ 150.000	2,70 %	13.07.2020	149.277	0,04 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 150.000	1,50 %	05.07.2019	148.248	0,04 %
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen^	€ 100.000	6,25 %	26.05.2042	148.005	0,04 %
E.ON International Finance BV	£ 100.000	6,00 %	30.10.2019	147.388	0,04 %
Allianz SE^	€ 100.000	5,63 %	17.10.2042	146.150	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Commerzbank AG	€ 100.000	7,75 %	16.03.2021	145.968	0,04 %
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen^	€ 100.000	6,00 %	26.05.2041	141.655	0,04 %
Volkswagen International Finance NV	€ 100.000	3,30 %	22.03.2033	137.796	0,04 %
Commerzbank AG	€ 100.000	4,00 %	30.03.2027	137.094	0,04 %
Aroundtown SA	£ 100.000	3,00 %	16.10.2029	135.799	0,04 %
BMW International Investment BV	£ 100.000	1,00 %	17.11.2021	134.328	0,04 %
Allianz SE^	€ 100.000	3,38 %	18.09.2166	133.169	0,04 %
Deutsche Telekom International Finance BV	£ 100.000	2,25 %	13.04.2029	133.014	0,04 %
Merck Financial Services GmbH	€ 100.000	4,50 %	24.03.2020	132.183	0,04 %
Bayer AG^	€ 100.000	3,75 %	01.07.2074	131.482	0,04 %
Allianz SE^	€ 100.000	3,10 %	06.07.2047	131.392	0,04 %
Linde Finance BV	€ 100.000	1,88 %	22.05.2024	130.848	0,04 %
Fresenius SE & Co. KGaA	€ 100.000	3,00 %	01.02.2021	129.818	0,04 %
Vonovia Finance BV	€ 100.000	2,25 %	15.12.2023	129.811	0,04 %
Deutsche Börse AG	€ 100.000	1,63 %	08.10.2025	129.776	0,04 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	€ 100.000	1,75 %	12.03.2021	126.710	0,04 %
Eurogrid GmbH	€ 100.000	1,63 %	03.11.2023	126.550	0,04 %
Bayer Capital Corp. BV	€ 100.000	1,25 %	13.11.2023	126.045	0,04 %
Linde AG	€ 100.000	1,75 %	17.09.2020	125.975	0,04 %
Vier Gas Transport GmbH	€ 100.000	2,00 %	12.06.2020	125.777	0,04 %
SAP SE	€ 100.000	1,13 %	20.02.2023	125.364	0,04 %
Allianz SE^	€ 100.000	2,24 %	07.07.2045	124.860	0,04 %
BMW Finance NV	€ 100.000	1,00 %	15.02.2022	124.019	0,04 %
Deutsche Bank AG	€ 100.000	1,50 %	20.01.2022	124.004	0,04 %
Deutsche Post AG	€ 100.000	1,25 %	01.04.2026	123.761	0,04 %
Grand City Properties SA	€ 100.000	1,50 %	17.04.2025	122.727	0,04 %
Aroundtown SA	€ 100.000	1,88 %	19.01.2026	122.613	0,04 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 100.000	1,38 %	30.01.2027	122.472	0,04 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 100.000	1,50 %	03.04.2028	122.267	0,04 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 100.000	0,88 %	29.01.2021	122.095	0,04 %
BMW Finance NV	€ 100.000	0,88 %	03.04.2025	121.589	0,04 %
Volkswagen International Finance NV	€ 100.000	0,50 %	30.03.2021	120.966	0,04 %
E.ON SE	€ 100.000	0,88 %	22.05.2024	120.930	0,04 %
DVB Bank SE	€ 100.000	1,25 %	15.09.2021	120.657	0,04 %
Bertelsmann SE & Co. KGaA	€ 100.000	0,25 %	26.05.2021	120.511	0,04 %
Allianz Finance II BV	€ 100.000	0,00 %	21.04.2020	120.440	0,04 %
DVB Bank SE	€ 100.000	0,88 %	11.11.2019	120.351	0,04 %
BASF SE	€ 100.000	1,45 %	13.12.2032	120.333	0,04 %
BASF Finance Europe NV	€ 100.000	0,00 %	10.11.2020	120.183	0,04 %
Santander Consumer Bank AG	€ 100.000	0,75 %	17.10.2022	120.156	0,03 %
LANXESS AG	€ 100.000	0,25 %	07.10.2021	120.122	0,03 %
Allianz Finance II BV	€ 100.000	1,38 %	21.04.2031	119.982	0,03 %
Henkel AG & Co. KGaA	€ 100.000	0,00 %	13.09.2021	119.850	0,03 %
Deutsche Bank AG	€ 100.000	1,13 %	17.03.2025	119.614	0,03 %
Vonovia Finance BV	€ 100.000	1,13 %	08.09.2025	119.556	0,03 %
Grand City Properties SA	€ 100.000	1,38 %	03.08.2026	119.435	0,03 %
Evonik Finance BV	€ 100.000	0,00 %	08.03.2021	119.418	0,03 %
Daimler AG	€ 100.000	1,00 %	15.11.2027	118.110	0,03 %
Deutsche Bank AG	\$ 100.000	4,10 %	13.01.2026	103.780	0,03 %
Deutsche Bank AG	\$ 100.000	3,30 %	16.11.2022	99.531	0,03 %
BMW US Capital LLC	\$ 100.000	2,00 %	11.04.2021	98.522	0,03 %
E.ON SE	€ 50.000	1,63 %	22.05.2029	61.082	0,02 %
innogy Finance BV	€ 50.000	1,00 %	13.04.2025	60.540	0,02 %
Deutsche Telekom International Finance BV	\$ 50.000	4,88 %	06.03.2042	56.454	0,02 %
BMW US Capital LLC	\$ 50.000	2,70 %	06.04.2022	50.030	0,01 %
BMW US Capital LLC	\$ 50.000	2,15 %	06.04.2020	49.814	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 25.000	8,50 %	18.01.2031	37.578	0,01 %
E.ON International Finance BV	\$ 25.000	6,65 %	30.04.2038	33.095	0,01 %
				14.691.282	4,31 %
Hongkong 0,40 %					
CK Hutchison International 17 II Ltd.	\$ 500.000	2,75 %	29.03.2023	490.049	0,14 %
CK Hutchison Finance 16 II Ltd.	€ 200.000	0,88 %	03.10.2024	237.611	0,07 %
AIA Group Ltd.	\$ 200.000	3,20 %	11.03.2025	198.920	0,06 %
Hutchison Whampoa International 09/19 Ltd.	\$ 175.000	5,75 %	11.09.2019	184.195	0,05 %
Hutchison Whampoa Europe Finance 12 Ltd.	€ 100.000	3,63 %	06.06.2022	136.111	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd.	€ 100.000	1,00 %	12.12.2024	118.730	0,04 %
				1.365.616	0,40 %
Indien 0,39 %					
ICICI Bank Ltd.	\$ 400.000	3,25 %	09.09.2022	397.048	0,12 %
Reliance Holding USA, Inc.	\$ 250.000	5,40 %	14.02.2022	271.530	0,08 %
Bharti Airtel International Netherlands BV	\$ 200.000	5,13 %	11.03.2023	211.958	0,06 %
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	\$ 200.000	3,50 %	29.07.2020	201.988	0,06 %
ICICI Bank Ltd.	\$ 200.000	3,80 %	14.12.2027	197.638	0,06 %
Adani Transmission Ltd.	\$ 50.000	4,00 %	03.08.2026	49.588	0,01 %
				1.329.750	0,39 %
Irland 0,26 %					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	\$ 150.000	4,63 %	01.07.2022	159.000	0,05 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	\$ 150.000	4,25 %	01.07.2020	155.625	0,04 %
Fresenius Finance Ireland plc	€ 100.000	3,00 %	30.01.2032	129.673	0,04 %
CRH Finland Services OYJ	€ 100.000	2,75 %	15.10.2020	127.969	0,04 %
Roadster Finance Designated Activity Co.	€ 100.000	2,38 %	08.12.2027	119.091	0,03 %
CRH Finance DAC	€ 100.000	1,38 %	18.10.2028	117.899	0,03 %
Johnson Controls International plc	\$ 35.000	5,00 %	30.03.2020	36.896	0,01 %
Johnson Controls International plc	\$ 25.000	4,95 %	02.07.2064	27.641	0,01 %
Johnson Controls International plc	\$ 25.000	3,63 %	02.07.2024	25.910	0,01 %
				899.704	0,26 %
Israel 0,19 %					
Teva Pharmaceutical Finance Co. BV	\$ 275.000	3,65 %	10.11.2021	261.616	0,08 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	\$ 125.000	2,20 %	21.07.2021	114.526	0,03 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	€ 100.000	1,88 %	31.03.2027	103.742	0,03 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	\$ 125.000	3,15 %	01.10.2026	102.791	0,03 %
Israel Chemicals Ltd.	\$ 50.000	4,50 %	02.12.2024	50.944	0,01 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	\$ 25.000	4,10 %	01.10.2046	19.220	0,01 %
				652.839	0,19 %
Italien 1,56 %					
Enel SpA	€ 200.000	5,63 %	21.06.2027	331.548	0,10 %
ENI SpA	€ 200.000	4,25 %	03.02.2020	261.218	0,08 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 200.000	4,00 %	20.05.2019	253.616	0,07 %
UniCredit SpA	€ 200.000	1,50 %	19.06.2019	245.408	0,07 %
ENI SpA	€ 200.000	0,75 %	17.05.2022	244.975	0,07 %
Intesa Sanpaolo SpA	\$ 200.000	3,13 %	14.07.2022	198.581	0,06 %
Assicurazioni Generali SpA^	€ 100.000	7,75 %	12.12.2042	154.753	0,04 %
Enel Finance International NV	\$ 125.000	6,00 %	07.10.2039	154.752	0,04 %
Enel SpA	€ 100.000	6,25 %	20.06.2019	145.306	0,04 %
Assicurazioni Generali SpA^	€ 100.000	5,00 %	08.06.2048	138.499	0,04 %
Enel Finance International NV	€ 100.000	4,88 %	11.03.2020	132.849	0,04 %
Autostrade per l'Italia SpA	€ 100.000	4,38 %	16.03.2020	131.701	0,04 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	€ 100.000	4,88 %	03.10.2019	130.456	0,04 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 100.000	4,38 %	15.10.2019	129.443	0,04 %
Enel Finance International NV	€ 100.000	1,97 %	27.01.2025	128.853	0,04 %
Assicurazioni Generali SpA	€ 100.000	2,88 %	14.01.2020	127.015	0,04 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 100.000	2,00 %	18.06.2021	126.792	0,04 %
Snam SpA	€ 100.000	5,00 %	18.01.2019	126.477	0,04 %
FCA Bank SpA	€ 100.000	2,00 %	23.10.2019	124.184	0,04 %
FCA Bank SpA	€ 100.000	1,25 %	21.01.2021	123.421	0,04 %
Atlantia SpA	€ 100.000	1,63 %	03.02.2025	122.971	0,04 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 100.000	1,38 %	18.01.2024	122.971	0,04 %
Snam SpA	€ 100.000	1,25 %	25.01.2025	122.668	0,04 %
Atlantia SpA	€ 100.000	1,88 %	13.07.2027	122.386	0,04 %
Italgas SpA	€ 100.000	1,13 %	14.03.2024	122.305	0,04 %
Mediobanca SpA	€ 100.000	0,75 %	17.02.2020	121.600	0,03 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	€ 100.000	1,38 %	26.07.2027	120.441	0,03 %
Eni SpA	€ 100.000	1,00 %	14.03.2025	120.346	0,03 %
Esselunga SpA	€ 100.000	0,88 %	25.10.2023	120.250	0,03 %
Zi Rete Gas SpA	€ 100.000	1,61 %	31.10.2027	119.923	0,03 %
Mediobanca SpA	€ 100.000	0,63 %	27.09.2022	119.001	0,03 %
ENI SpA	€ 100.000	1,13 %	19.09.2028	114.580	0,03 %
Enel Finance International NV	\$ 100.000	2,88 %	25.05.2022	99.387	0,03 %
Enel Finance International NV	\$ 100.000	3,63 %	25.05.2027	99.137	0,03 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Enel Finance International NV	£ 50.000	5,75 %	14.09.2040	94.386	0,03 %
Enel SpA	£ 50.000	5,75 %	22.06.2037	92.831	0,03 %
Enel Finance International NV	\$ 75.000	4,75 %	25.05.2047	81.340	0,02 %
				5.326.370	1,56 %
Japan 3,03 %					
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.	¥ 100.000.000	1,39 %	31.05.2022	931.845	0,27 %
Panasonic Corp.	¥ 100.000.000	0,57 %	18.03.2022	900.287	0,26 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 100.000.000	0,10 %	15.09.2019	891.345	0,26 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 65.000.000	0,10 %	20.09.2022	582.611	0,17 %
Mizuho Financial Group, Inc.	\$ 500.000	2,27 %	13.09.2021	490.033	0,14 %
Norinchukin Bank	¥ 50.000.000	0,30 %	27.02.2019	445.222	0,13 %
Shinkin Central Bank	¥ 50.000.000	0,03 %	25.06.2021	442.710	0,13 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	\$ 350.000	2,09 %	18.10.2019	348.340	0,10 %
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.	\$ 300.000	2,30 %	05.03.2020	298.930	0,09 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$ 300.000	2,67 %	25.07.2022	296.314	0,09 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	\$ 250.000	3,40 %	11.07.2024	256.115	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 25.000.000	0,10 %	20.09.2027	223.207	0,06 %
Nippon Life Insurance Co. ^	\$ 200.000	5,10 %	16.10.2044	211.250	0,06 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 200.000	4,50 %	17.06.2020	210.499	0,06 %
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.	\$ 200.000	3,25 %	08.09.2024	202.582	0,06 %
Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.	\$ 200.000	2,65 %	19.10.2020	200.269	0,06 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 200.000	1,70 %	09.01.2019	199.212	0,06 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 200.000	2,78 %	18.10.2022	198.515	0,06 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 200.000	1,40 %	20.05.2019	198.040	0,06 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$ 200.000	3,29 %	25.07.2027	197.450	0,06 %
Mizuho Financial Group, Inc.	\$ 200.000	2,60 %	11.09.2022	196.575	0,06 %
Mizuho Financial Group, Inc.	\$ 200.000	3,17 %	11.09.2027	196.151	0,06 %
American Honda Finance Corp.	\$ 200.000	1,70 %	09.09.2021	194.317	0,06 %
Dai-ichi Life Insurance Co., Ltd. ^	\$ 200.000	4,00 %	24.01.2166	194.250	0,06 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 200.000	2,63 %	14.07.2026	189.214	0,06 %
American Honda Finance Corp.	\$ 175.000	2,90 %	16.02.2024	175.249	0,05 %
Toyota Credit Canada, Inc.	CAD 200.000	2,35 %	18.07.2022	158.370	0,05 %
Toyota Credit Canada, Inc.	CAD 200.000	1,80 %	19.02.2020	158.275	0,05 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 152.000	2,60 %	28.09.2022	150.177	0,04 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 150.000	1,70 %	19.02.2019	149.460	0,04 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	€ 100.000	1,55 %	15.06.2026	123.555	0,04 %
Toyota Motor Credit Corp.	€ 100.000	0,75 %	21.07.2022	122.496	0,04 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	€ 100.000	0,61 %	18.01.2022	120.899	0,03 %
Nomura Holdings, Inc.	\$ 100.000	6,70 %	04.03.2020	108.393	0,03 %
American Honda Finance Corp.	\$ 100.000	2,45 %	24.09.2020	100.237	0,03 %
Kyushu Electric Power Co., Inc.	€ 10.000.000	1,06 %	23.02.2024	92.718	0,03 %
Kansai Electric Power Co., Inc.	€ 10.000.000	0,49 %	23.07.2027	88.892	0,03 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 50.000	3,20 %	11.01.2027	50.688	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 50.000	2,13 %	18.07.2019	50.016	0,01 %
				10.344.708	3,03 %
Kuwait 0,06 %					
NBK SPC Ltd.	\$ 200.000	2,75 %	30.05.2022	196.718	0,06 %
				196.718	0,06 %
Luxemburg 0,11 %					
SES SA	€ 100.000	4,63 %	09.03.2020	131.854	0,04 %
Nestle Finance International Ltd.	€ 100.000	0,75 %	08.11.2021	123.251	0,04 %
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA	€ 100.000	1,50 %	14.06.2027	120.216	0,03 %
				375.321	0,11 %
Mexiko 0,70 %					
Alfa SAB de CV	\$ 200.000	5,25 %	25.03.2024	211.750	0,06 %
Trust F/1401	\$ 200.000	5,25 %	30.01.2026	210.500	0,06 %
America Movil SAB de CV	\$ 200.000	3,13 %	16.07.2022	202.113	0,06 %
Infraestructura Energética Nova SAB de CV	\$ 200.000	3,75 %	14.01.2028	197.773	0,06 %
America Movil SAB de CV	\$ 150.000	6,13 %	30.03.2040	190.858	0,06 %
Coca-Cola Femsa SAB de CV	\$ 150.000	5,25 %	26.11.2043	176.992	0,05 %
America Movil SAB de CV	£ 100.000	4,95 %	22.07.2033	168.720	0,05 %
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	\$ 150.000	4,38 %	10.05.2043	157.095	0,05 %
America Movil SAB de CV	€ 100.000	3,00 %	12.07.2021	131.204	0,04 %
America Movil SAB de CV	€ 100.000	1,50 %	10.03.2024	124.122	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
America Movil SAB de CV	\$ 100.000	5,00 %	30.03.2020	105.157	0,03 %
Southern Copper Corp.	\$ 75.000	6,75 %	16.04.2040	97.528	0,03 %
Grupo Televisa SAB	\$ 75.000	6,63 %	18.03.2025	88.741	0,03 %
Mexichem SAB de CV	\$ 75.000	4,88 %	19.09.2022	79.875	0,02 %
Grupo Televisa SAB	\$ 75.000	5,00 %	13.05.2045	75.963	0,02 %
Southern Copper Corp.	\$ 50.000	3,50 %	08.11.2022	51.336	0,01 %
Mexichem SAB de CV	\$ 50.000	5,50 %	15.01.2048	48.966	0,01 %
America Movil SAB de CV	\$ 25.000	6,38 %	01.03.2035	31.694	0,01 %
Grupo Televisa SAB	\$ 25.000	6,63 %	15.01.2040	30.718	0,01 %
				2.381.105	0,70 %
Niederlande 2,63 %					
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 500.000	3,95 %	09.11.2022	520.710	0,15 %
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 250.000	5,25 %	04.08.2045	302.212	0,09 %
Shell International Finance BV	\$ 300.000	3,63 %	21.08.2042	300.051	0,09 %
Shell International Finance BV	\$ 300.000	2,25 %	06.01.2023	294.618	0,09 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 200.000	2,38 %	22.05.2023	264.961	0,08 %
Koninklijke KPN NV	€ 200.000	3,25 %	01.02.2021	262.293	0,08 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 200.000	4,13 %	14.01.2020	260.541	0,08 %
ABN AMRO Bank NV	€ 200.000	2,13 %	26.11.2020	254.377	0,07 %
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 250.000	2,25 %	14.01.2020	249.709	0,07 %
ING Groep NV	€ 200.000	0,75 %	09.03.2022	243.342	0,07 %
Shell International Finance BV	\$ 225.000	3,75 %	12.09.2046	229.628	0,07 %
ABN AMRO Bank NV^	\$ 200.000	4,40 %	27.03.2028	206.008	0,06 %
ING Groep NV	\$ 200.000	3,15 %	29.03.2022	201.779	0,06 %
ING Bank NV	\$ 200.000	2,75 %	22.03.2021	201.011	0,06 %
ABN AMRO Bank NV	\$ 200.000	2,45 %	04.06.2020	200.003	0,06 %
Shell International Finance BV	\$ 200.000	2,13 %	11.05.2020	199.569	0,06 %
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 200.000	2,25 %	02.12.2019	199.496	0,06 %
Shell International Finance BV	\$ 200.000	1,38 %	10.05.2019	198.067	0,06 %
Shell International Finance BV	\$ 200.000	2,50 %	12.09.2026	193.672	0,06 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 150.000	1,38 %	03.02.2027	186.311	0,05 %
Delta Lloyd Levensverzekering NV^	€ 100.000	9,00 %	29.08.2042	163.009	0,05 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 100.000	4,63 %	23.05.2029	159.529	0,05 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 100.000	4,13 %	14.07.2025	149.567	0,04 %
ABN AMRO Bank NV	€ 100.000	2,38 %	07.12.2021	141.373	0,04 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 100.000	3,88 %	25.07.2023	139.783	0,04 %
ABN AMRO Bank NV	€ 100.000	1,00 %	30.06.2020	135.005	0,04 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 100.000	4,13 %	12.01.2021	134.744	0,04 %
ABN AMRO Bank NV	€ 100.000	2,50 %	29.11.2023	134.032	0,04 %
Koninklijke DSM NV	€ 100.000	2,38 %	03.04.2024	132.815	0,04 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 100.000	3,75 %	09.11.2020	132.003	0,04 %
Akzo Nobel Sweden Finance AB	€ 100.000	2,63 %	27.07.2022	131.866	0,04 %
ING Groep NV^	€ 100.000	3,00 %	11.04.2028	131.393	0,04 %
ABN AMRO Bank NV^	€ 100.000	2,88 %	18.01.2028	130.665	0,04 %
Heineken NV	€ 100.000	1,50 %	07.12.2024	125.641	0,04 %
Shell International Finance BV	€ 100.000	1,25 %	15.03.2022	125.592	0,04 %
NIBC Bank NV	€ 100.000	2,25 %	24.09.2019	124.334	0,04 %
ASML Holding NV	€ 100.000	1,38 %	07.07.2026	124.141	0,04 %
LeasePlan Corp.NV	€ 100.000	2,38 %	23.04.2019	123.747	0,04 %
NIBC Bank NV	€ 100.000	1,50 %	31.01.2022	123.509	0,04 %
Shell International Finance BV	€ 100.000	1,25 %	12.05.2028	122.643	0,04 %
NN Group NV	€ 100.000	0,88 %	13.01.2023	122.097	0,04 %
ING Bank NV	€ 100.000	0,70 %	16.04.2020	122.041	0,03 %
RELX Finance BV	€ 100.000	1,00 %	22.03.2024	121.644	0,03 %
Roche Finance Europe BV	€ 100.000	0,50 %	27.02.2023	121.249	0,03 %
Unilever NV	€ 100.000	0,88 %	31.07.2025	120.838	0,03 %
ING Groep NV^	€ 100.000	1,63 %	26.09.2029	120.345	0,03 %
Heineken NV	€ 100.000	1,00 %	04.05.2026	120.268	0,03 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 100.000	0,13 %	11.10.2021	120.103	0,03 %
PostNL NV	€ 100.000	1,00 %	21.11.2024	120.033	0,03 %
Shell International Finance BV	€ 100.000	0,38 %	15.02.2025	117.941	0,03 %
Citycon Treasury BV	€ 100.000	1,25 %	08.09.2026	116.787	0,03 %
				8.977.095	2,63 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Neuseeland 0,09 %					
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	\$ 200.000	2,20 %	17.07.2020	198.537	0,06 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	€ 100.000	0,63 %	01.06.2021	121.754	0,03 %
				320.291	0,09 %
Norwegen 0,26 %					
DNB Bank A.S.A	€ 150.000	4,38 %	24.02.2021	204.279	0,06 %
DNB Bank A.S.A	\$ 200.000	2,13 %	02.10.2020	198.286	0,06 %
SpareBank 1 SR-Bank A.S.A	€ 100.000	2,13 %	03.02.2020	125.190	0,04 %
SpareBank 1 SMN	€ 100.000	1,50 %	20.05.2019	122.648	0,04 %
SpareBank 1 SMN	€ 100.000	0,50 %	09.03.2022	120.168	0,03 %
SpareBank 1 SR-Bank A.S.A	€ 100.000	0,38 %	10.02.2022	119.535	0,03 %
				890.106	0,26 %
Peru 0,12 %					
Banco de Credito del Peru	\$ 200.000	4,25 %	01.04.2023	209.258	0,06 %
Cerro del Aguila SA	\$ 200.000	4,13 %	16.08.2027	197.072	0,06 %
				406.330	0,12 %
Portugal 0,24 %					
EDP Finance BV	€ 200.000	2,00 %	22.04.2025	253.689	0,07 %
EDP Finance BV	\$ 200.000	3,63 %	15.07.2024	201.628	0,06 %
EDP Finance BV	€ 100.000	4,13 %	20.01.2021	134.432	0,04 %
EDP Finance BV	€ 100.000	2,63 %	15.04.2019	124.150	0,04 %
EDP Finance BV	£ 50.000	8,63 %	04.01.2024	91.194	0,03 %
				805.093	0,24 %
Katar 0,06 %					
CBO Finance Ltd.	\$ 200.000	3,25 %	13.06.2021	197.000	0,06 %
				197.000	0,06 %
Russische Föderation 0,07 %					
MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC	\$ 200.000	6,63 %	14.10.2022	225.250	0,07 %
				225.250	0,07 %
Singapur 0,06 %					
United Overseas Bank Ltd.^	\$ 200.000	3,50 %	16.09.2026	201.508	0,06 %
				201.508	0,06 %
Südkorea 0,26 %					
Hyundai Capital Services, Inc.	\$ 230.000	1,63 %	30.08.2019	225.051	0,07 %
Shinhan Bank Co., Ltd.	\$ 200.000	2,25 %	15.04.2020	196.757	0,06 %
KT Corp.	\$ 200.000	2,50 %	18.07.2026	186.689	0,05 %
POSCO	\$ 100.000	4,25 %	28.10.2020	103.038	0,03 %
Hyundai Capital America	\$ 100.000	3,10 %	05.04.2022	99.622	0,03 %
Hyundai Capital America	\$ 85.000	3,00 %	18.03.2021	84.760	0,02 %
				895.917	0,26 %
Spanien 1,49 %					
Gas Natural Capital Markets SA	€ 200.000	6,38 %	09.07.2019	263.563	0,08 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	€ 200.000	1,00 %	20.01.2021	245.965	0,07 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 200.000	0,32 %	17.10.2020	241.374	0,07 %
Banco Santander SA	\$ 200.000	3,80 %	23.02.2028	199.925	0,06 %
Banco Santander SA	\$ 200.000	3,13 %	23.02.2023	198.781	0,06 %
Telefonica Emisiones SAU	\$ 125.000	7,05 %	20.06.2036	167.189	0,05 %
Telefonica Emisiones SAU	\$ 125.000	5,46 %	16.02.2021	135.201	0,04 %
Iberdrola International BV	€ 100.000	3,50 %	01.02.2021	132.472	0,04 %
Santander Issuances SAU	€ 100.000	3,25 %	04.04.2026	132.021	0,04 %
Santander Issuances SAU	€ 100.000	3,13 %	19.01.2027	130.923	0,04 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 100.000	4,69 %	11.11.2019	130.640	0,04 %
Abertis Infraestructuras SA	€ 100.000	4,75 %	25.10.2019	130.432	0,04 %
Santander International Debt SA	€ 100.000	4,00 %	24.01.2020	129.905	0,04 %
Merlin Properties Socimi SA	€ 100.000	2,38 %	23.05.2022	127.455	0,04 %
Repsol International Finance BV	€ 100.000	2,13 %	16.12.2020	127.042	0,04 %
Criteria Caixa SAU	€ 100.000	1,63 %	21.04.2022	123.227	0,04 %
Santander Consumer Finance SA	€ 100.000	0,90 %	18.02.2020	122.079	0,04 %
NorteGas Energia Distribucion SAU	€ 100.000	2,07 %	28.09.2027	121.925	0,04 %
Santander Consumer Finance SA	€ 100.000	0,88 %	24.01.2022	121.726	0,04 %
Gas Natural Capital Markets SA	€ 100.000	1,13 %	11.04.2024	121.703	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Telefonica Emisiones SAU	€ 100.000	0,75 %	13.04.2022	121.662	0,04 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 100.000	1,72 %	12.01.2028	121.630	0,04 %
NorteGas Energia Distribucion SAU	€ 100.000	0,92 %	28.09.2022	120.728	0,04 %
Iberdrola Finanzas SA	€ 100.000	1,00 %	07.03.2025	120.638	0,03 %
Repsol International Finance BV	€ 100.000	0,50 %	23.05.2022	120.548	0,03 %
Iberdrola International BV^	€ 100.000	1,88 %	22.05.2166	120.307	0,03 %
Red Electrica Financiaciones SAU	€ 100.000	1,00 %	21.04.2026	120.021	0,03 %
Iberdrola Finanzas SA	€ 100.000	1,62 %	29.11.2029	119.842	0,03 %
CaixaBank SA	€ 100.000	1,13 %	12.01.2023	119.650	0,03 %
Banco de Sabadell SA	€ 100.000	0,88 %	05.03.2023	118.887	0,03 %
Inmobiliaria Colonial Socimi SA	€ 100.000	1,63 %	28.11.2025	118.841	0,03 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 100.000	1,93 %	17.10.2031	118.477	0,03 %
Telefonica Emisiones SAU	\$ 100.000	4,10 %	08.03.2027	103.074	0,03 %
Telefonica Emisiones SAU	\$ 75.000	5,21 %	08.03.2047	84.911	0,02 %
Iberdrola Finanzas SA	£ 50.000	6,00 %	01.07.2022	80.538	0,02 %
Iberdrola Finance Ireland DAC	\$ 75.000	5,00 %	11.09.2019	78.010	0,02 %
Iberdrola International BV	\$ 50.000	6,75 %	15.07.2036	65.510	0,02 %
Telefonica Emisiones SAU	\$ 50.000	4,57 %	27.04.2023	53.792	0,02 %
Telefonica Emisiones SAU	\$ 50.000	5,88 %	15.07.2019	52.556	0,02 %
				5.063.170	1,49 %
Schweden 1,04 %					
Svenska Handelsbanken AB	\$ 300.000	1,50 %	06.09.2019	296.304	0,09 %
Telia Co. AB	€ 200.000	3,88 %	01.10.2025	290.609	0,08 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	\$ 250.000	2,30 %	11.03.2020	249.419	0,07 %
Svenska Handelsbanken AB	€ 150.000	4,38 %	20.10.2021	208.862	0,06 %
Swedbank AB	\$ 200.000	2,20 %	04.03.2020	199.310	0,06 %
Nordea Bank AB	\$ 200.000	2,13 %	29.05.2020	198.771	0,06 %
Nordea Bank AB	\$ 200.000	2,25 %	27.05.2021	198.025	0,06 %
Nordea Bank AB	€ 150.000	2,00 %	17.02.2021	190.830	0,06 %
Svenska Handelsbanken AB	€ 150.000	1,13 %	14.12.2022	186.661	0,05 %
Svenska Handelsbanken AB	£ 100.000	3,00 %	20.11.2020	142.577	0,04 %
Nordea Bank AB	€ 100.000	4,50 %	26.03.2020	131.675	0,04 %
Akelius Residential Property AB	€ 100.000	3,38 %	23.09.2020	129.689	0,04 %
Volvo Treasury AB^	€ 100.000	4,20 %	10.06.2075	129.040	0,04 %
Nordea Bank AB	€ 100.000	4,00 %	11.07.2019	127.746	0,04 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	€ 100.000	1,88 %	14.11.2019	124.635	0,04 %
Fastighets AB Balder	€ 100.000	1,88 %	14.03.2025	122.201	0,04 %
Swedbank AB	€ 100.000	0,63 %	04.01.2021	122.186	0,04 %
Fastighets AB Balder	€ 100.000	1,13 %	14.03.2022	121.200	0,04 %
Essity AB	€ 100.000	0,63 %	28.03.2022	121.079	0,03 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB^	€ 100.000	1,38 %	31.10.2028	120.800	0,03 %
Swedbank AB^	€ 100.000	1,00 %	22.11.2027	119.661	0,03 %
				3.531.280	1,04 %
Schweiz 1,75 %					
UBS Group Funding Switzerland AG	\$ 500.000	3,49 %	23.05.2023	507.766	0,15 %
Novartis Capital Corp.	\$ 425.000	3,10 %	17.05.2027	431.767	0,13 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	\$ 300.000	3,13 %	10.12.2020	303.412	0,09 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	\$ 300.000	2,75 %	26.03.2020	300.775	0,09 %
Credit Suisse Group AG^	\$ 300.000	3,00 %	14.12.2023	296.355	0,09 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	\$ 250.000	4,88 %	15.05.2045	287.830	0,08 %
UBS Group Funding Switzerland AG	€ 200.000	1,50 %	30.11.2024	249.445	0,07 %
Glencore Finance Europe Ltd.	€ 200.000	1,25 %	17.03.2021	245.780	0,07 %
Credit Suisse Group AG^	€ 200.000	1,25 %	17.07.2025	242.325	0,07 %
UBS AG	\$ 200.000	2,45 %	01.12.2020	199.279	0,06 %
LafargeHolcim Finance US LLC	\$ 200.000	3,50 %	22.09.2026	197.750	0,06 %
Glencore Funding LLC	\$ 200.000	3,88 %	27.10.2027	196.631	0,06 %
Credit Suisse AG	€ 150.000	1,38 %	29.11.2019	185.110	0,05 %
Novartis Capital Corp.	\$ 150.000	4,00 %	20.11.2045	162.908	0,05 %
Demeter Investments BV for Zurich Insurance Co., Ltd.^	€ 100.000	3,50 %	01.10.2046	135.030	0,04 %
Credit Suisse Group AG^	€ 100.000	2,13 %	12.09.2025	134.258	0,04 %
Cloverie plc for Zurich Insurance Co., Ltd.	€ 100.000	1,75 %	16.09.2024	127.228	0,04 %
ELM BV for Swiss Reinsurance Co., Ltd.^	€ 100.000	2,60 %	01.09.2166	125.770	0,04 %
UBS AG	€ 100.000	1,25 %	03.09.2021	124.640	0,04 %
Holcim Finance Luxembourg SA	€ 100.000	1,38 %	26.05.2023	124.470	0,04 %
ABB Finance BV	€ 100.000	2,63 %	26.03.2019	123.992	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	€ 100.000	1,25 %	14.04.2022	123.867	0,04 %
Credit Suisse AG	€ 100.000	1,13 %	15.09.2020	123.456	0,04 %
UBS AG	€ 100.000	1,13 %	30.06.2020	123.328	0,04 %
Novartis Finance SA	€ 100.000	1,13 %	30.09.2027	122.388	0,03 %
Nestle Finance International Ltd.	€ 100.000	1,25 %	02.11.2029	121.232	0,03 %
Novartis Finance SA	€ 100.000	0,00 %	31.03.2021	119.728	0,03 %
Holcim Finance Luxembourg SA	€ 100.000	1,75 %	29.08.2029	119.124	0,03 %
Novartis Finance SA	€ 100.000	0,13 %	20.09.2023	118.214	0,03 %
Novartis Securities Investment Ltd.	\$ 100.000	5,13 %	10.02.2019	103.208	0,03 %
Glencore Funding LLC	\$ 100.000	3,13 %	29.04.2019	100.750	0,03 %
Glencore Finance Canada Ltd.	\$ 50.000	4,95 %	15.11.2021	53.250	0,01 %
Glencore Finance Canada Ltd.	\$ 25.000	5,55 %	25.10.2042	27.656	0,01 %
				5.958.722	1,75 %
Vereinigte Arabische Emirate 0,06 %					
DIB Sukuk Ltd.	\$ 200.000	3,66 %	14.02.2022	201.768	0,06 %
				201.768	0,06 %
Vereinigtes Königreich 8,02 %					
HSBC Holdings plc	\$ 300.000	6,50 %	02.05.2036	391.960	0,11 %
HSBC Bank plc	\$ 300.000	4,13 %	12.08.2020	312.392	0,09 %
HSBC Holdings plc^	\$ 300.000	4,04 %	13.03.2028	312.276	0,09 %
HSBC Holdings plc	\$ 300.000	3,60 %	25.05.2023	308.675	0,09 %
HSBC Holdings plc	\$ 300.000	2,95 %	25.05.2021	301.979	0,09 %
Santander UK Group Holdings plc	\$ 300.000	2,88 %	16.10.2020	301.161	0,09 %
Barclays plc	\$ 300.000	3,65 %	16.03.2025	299.904	0,09 %
Phoenix Group Holdings	£ 200.000	4,13 %	20.07.2022	288.410	0,08 %
BAT Capital Corp.	£ 200.000	2,13 %	15.08.2025	269.297	0,08 %
HSBC Holdings plc	€ 200.000	3,00 %	30.06.2025	266.912	0,08 %
BP Capital Markets plc	€ 200.000	1,37 %	03.03.2022	251.320	0,07 %
Lloyds Banking Group plc	\$ 250.000	3,00 %	11.01.2022	250.709	0,07 %
BP Capital Markets plc	\$ 250.000	1,68 %	03.05.2019	248.732	0,07 %
Standard Chartered plc	\$ 250.000	3,20 %	17.04.2025	244.818	0,07 %
FCE Bank plc	€ 200.000	0,87 %	13.09.2021	243.936	0,07 %
BP Capital Markets plc	€ 200.000	0,83 %	19.09.2024	241.119	0,07 %
Vodafone Group plc	€ 200.000	0,38 %	22.11.2021	240.353	0,07 %
Vodafone Group plc	€ 200.000	1,13 %	20.11.2025	238.605	0,07 %
BAT Capital Corp.	\$ 225.000	4,39 %	15.08.2037	235.688	0,07 %
Lloyds Banking Group plc	AUD 300.000	4,25 %	22.11.2027	233.193	0,07 %
Barclays plc	\$ 200.000	5,25 %	17.08.2045	232.186	0,07 %
BP Capital Markets plc	\$ 225.000	3,22 %	14.04.2024	229.671	0,07 %
Sanctuary Capital plc	£ 100.000	6,70 %	23.03.2039	217.771	0,06 %
Lloyds Bank plc	£ 100.000	6,50 %	17.09.2040	216.830	0,06 %
HSBC Holdings plc	\$ 200.000	4,88 %	14.01.2022	215.043	0,06 %
Lloyds Bank plc	\$ 200.000	5,80 %	13.01.2020	213.014	0,06 %
Santander UK Group Holdings plc	\$ 200.000	4,75 %	15.09.2025	209.650	0,06 %
BG Energy Capital plc	\$ 200.000	4,00 %	15.10.2021	209.618	0,06 %
Lloyds Banking Group plc	\$ 200.000	4,58 %	10.12.2025	208.889	0,06 %
HSBC Holdings plc	\$ 200.000	4,38 %	23.11.2026	208.684	0,06 %
BP Capital Markets plc	\$ 200.000	3,56 %	01.11.2021	207.586	0,06 %
Barclays plc	\$ 200.000	4,84 %	09.05.2028	207.439	0,06 %
Centrica plc	\$ 200.000	4,00 %	16.10.2023	205.864	0,06 %
Standard Chartered plc	\$ 200.000	4,30 %	19.02.2027	203.861	0,06 %
Royal Bank of Scotland Group plc	\$ 200.000	3,88 %	12.09.2023	203.267	0,06 %
BP Capital Markets plc	\$ 200.000	3,28 %	19.09.2027	201.896	0,06 %
BP Capital Markets plc	\$ 200.000	2,32 %	13.02.2020	200.556	0,06 %
Santander UK plc	\$ 200.000	2,50 %	14.03.2019	200.553	0,06 %
Barclays plc	\$ 200.000	2,88 %	08.06.2020	200.540	0,06 %
BP Capital Markets plc	\$ 200.000	2,75 %	10.05.2023	200.445	0,06 %
BAT Capital Corp.	\$ 200.000	2,76 %	15.08.2022	198.875	0,06 %
Nationwide Building Society	\$ 200.000	2,45 %	27.07.2021	198.277	0,06 %
Standard Chartered plc^	€ 150.000	4,00 %	21.10.2025	196.344	0,06 %
Western Power Distribution South West plc	£ 100.000	5,75 %	23.03.2040	195.884	0,06 %
London & Quadrant Housing Trust Ltd.	£ 100.000	5,50 %	27.01.2040	191.696	0,06 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	£ 100.000	5,50 %	11.02.2041	190.707	0,06 %
Peabody Capital plc	£ 100.000	5,25 %	17.03.2043	190.631	0,06 %
Thames Water Utilities Finance Ltd.	£ 100.000	6,75 %	16.11.2028	189.693	0,06 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
THFC Funding No 3 plc	£ 100.000	5,20 %	11.10.2043	186.809	0,05 %
HSBC Holdings plc	£ 100.000	6,00 %	29.03.2040	186.341	0,05 %
HSBC Holdings plc	£ 100.000	6,75 %	11.09.2028	180.993	0,05 %
Prudential plc	£ 100.000	6,13 %	19.12.2031	178.157	0,05 %
GlaxoSmithKline Capital plc	£ 100.000	4,25 %	18.12.2045	176.151	0,05 %
Heathrow Funding Ltd.	£ 100.000	4,63 %	31.10.2046	175.550	0,05 %
Imperial Brands Finance plc	£ 100.000	9,00 %	17.02.2022	174.870	0,05 %
Friends Life Holdings plc	£ 100.000	8,25 %	21.04.2022	173.140	0,05 %
HSBC Holdings plc	£ 100.000	6,50 %	20.05.2024	171.788	0,05 %
Heathrow Funding Ltd.	£ 100.000	7,13 %	14.02.2024	171.054	0,05 %
BG Energy Capital plc	£ 100.000	5,13 %	01.12.2025	167.524	0,05 %
Coventry Building Society	£ 100.000	5,88 %	28.09.2022	161.546	0,05 %
HSBC Holdings plc	CAD 200.000	3,20 %	05.12.2023	161.229	0,05 %
BAT Capital Corp.	\$ 150.000	4,54 %	15.08.2047	157.899	0,05 %
CRH Finance UK plc	£ 100.000	4,13 %	02.12.2029	155.666	0,05 %
Firstgroup plc	£ 100.000	5,25 %	29.11.2022	155.555	0,05 %
Scottish Widows Ltd.	£ 100.000	5,50 %	16.06.2023	154.606	0,05 %
Legal & General Group plc^	£ 100.000	5,38 %	27.10.2045	154.191	0,04 %
Society of Lloyd's^	£ 100.000	4,88 %	07.02.2047	152.425	0,04 %
Eastern Power Networks plc	£ 100.000	4,75 %	30.09.2021	152.069	0,04 %
Southern Water Services Finance Ltd.	£ 100.000	5,00 %	31.03.2021	151.311	0,04 %
TSB Banking Group plc^	£ 100.000	5,75 %	06.05.2026	149.712	0,04 %
Aviva plc^	€ 100.000	6,13 %	05.07.2043	149.132	0,04 %
British Telecommunications plc	\$ 100.000	9,13 %	15.12.2030	148.748	0,04 %
Rolls-Royce plc	£ 100.000	3,38 %	18.06.2026	148.613	0,04 %
Investec plc	£ 100.000	4,50 %	05.05.2022	146.285	0,04 %
Nationwide Building Society	£ 100.000	5,63 %	09.09.2019	145.804	0,04 %
Scotland Gas Networks plc	£ 100.000	3,25 %	08.03.2027	145.789	0,04 %
Hammerson plc	£ 100.000	3,50 %	27.10.2025	143.980	0,04 %
Chancellor Masters & Scholars of the University of Oxford	£ 100.000	2,54 %	08.12.2117	143.827	0,04 %
Annington Funding plc	£ 100.000	3,69 %	12.07.2034	142.134	0,04 %
Sky plc	£ 100.000	2,88 %	24.11.2020	141.642	0,04 %
Land Securities Capital Markets plc	£ 100.000	2,75 %	22.09.2057	140.626	0,04 %
Next plc	£ 100.000	3,63 %	18.05.2028	140.320	0,04 %
Marks & Spencer plc	£ 100.000	3,00 %	08.12.2023	140.113	0,04 %
Notting Hill Housing Trust	£ 100.000	3,25 %	12.10.2048	139.316	0,04 %
British Telecommunications plc	£ 100.000	3,13 %	21.11.2031	138.448	0,04 %
Gatwick Funding Ltd	£ 100.000	3,13 %	28.09.2039	137.537	0,04 %
Tritax Big Box plc	£ 100.000	3,13 %	14.12.2031	137.119	0,04 %
Lloyds Bank plc	€ 100.000	6,50 %	24.03.2020	136.843	0,04 %
Eversholt Funding plc	£ 100.000	3,53 %	07.08.2042	136.651	0,04 %
Lloyds Banking Group plc	£ 100.000	2,25 %	16.10.2024	136.604	0,04 %
Northumbrian Water Finance plc	£ 100.000	2,38 %	05.10.2027	136.329	0,04 %
HSBC Holdings plc^	£ 100.000	2,26 %	13.11.2026	135.702	0,04 %
Segro plc	£ 100.000	2,38 %	11.10.2029	135.383	0,04 %
Motability Operations Group plc	£ 100.000	2,38 %	14.03.2032	134.895	0,04 %
WPP Finance 2013	€ 100.000	3,00 %	20.11.2023	134.715	0,04 %
Bazalgette Finance plc	£ 100.000	2,38 %	29.11.2027	134.661	0,04 %
Cadent Finance plc	£ 100.000	1,13 %	22.09.2021	134.431	0,04 %
HSBC Bank plc	€ 100.000	4,00 %	15.01.2021	134.355	0,04 %
Severn Trent Utilities Finance plc	£ 100.000	1,13 %	07.09.2021	134.316	0,04 %
HSBC Holdings plc	€ 100.000	2,50 %	15.03.2027	133.820	0,04 %
Places For People Treasury plc	£ 100.000	2,88 %	17.08.2026	133.487	0,04 %
BP Capital Markets plc	£ 100.000	1,18 %	12.08.2023	132.572	0,04 %
BG Energy Capital plc	€ 100.000	2,25 %	21.11.2029	132.109	0,04 %
Royal Bank of Scotland plc	€ 100.000	5,38 %	30.09.2019	131.386	0,04 %
Sky plc	€ 100.000	2,25 %	17.11.2025	130.449	0,04 %
Barclays Bank plc	€ 100.000	4,88 %	13.08.2019	129.895	0,04 %
Anglo American Capital plc	\$ 125.000	4,13 %	15.04.2021	128.594	0,04 %
Vodafone Group plc	£ 100.000	3,38 %	08.08.2049	128.368	0,04 %
Diageo Finance plc	€ 100.000	1,75 %	23.09.2024	128.238	0,04 %
Leeds Building Society	€ 100.000	2,63 %	01.04.2021	128.226	0,04 %
Heathrow Funding Ltd.	€ 100.000	1,88 %	23.05.2022	127.696	0,04 %
DS Smith plc	€ 100.000	2,25 %	16.09.2022	127.685	0,04 %
Santander UK plc	€ 100.000	2,63 %	16.07.2020	127.674	0,04 %
SSE plc	€ 100.000	1,75 %	08.09.2023	127.489	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Royal Bank of Scotland Group plc^	€ 100.000	2,00 %	08.03.2023	126.140	0,04 %
HSBC Holdings plc	€ 100.000	1,50 %	15.03.2022	125.785	0,04 %
Barclays plc	€ 100.000	1,88 %	23.03.2021	125.729	0,04 %
Standard Chartered plc	€ 100.000	1,63 %	13.06.2021	125.304	0,04 %
Hammerson plc	€ 100.000	1,75 %	15.03.2023	125.163	0,04 %
BG Energy Capital plc	€ 100.000	1,25 %	21.11.2022	125.005	0,04 %
Lloyds Bank plc	€ 100.000	1,25 %	13.01.2025	124.141	0,04 %
BAT International Finance plc	€ 100.000	2,25 %	16.01.2030	124.107	0,04 %
BP Capital Markets plc	€ 100.000	1,64 %	26.06.2029	123.885	0,04 %
Yorkshire Building Society	€ 100.000	1,25 %	17.03.2022	123.554	0,04 %
Leeds Building Society	€ 100.000	1,38 %	05.05.2022	123.463	0,04 %
Lloyds Bank plc	€ 100.000	1,00 %	19.11.2021	123.269	0,04 %
FCE Bank plc	€ 100.000	1,13 %	10.02.2022	122.720	0,04 %
Vodafone Group plc	€ 100.000	1,00 %	11.09.2020	122.657	0,04 %
BAT International Finance plc	€ 100.000	1,00 %	23.05.2022	122.640	0,04 %
Coca-Cola European Partners plc	€ 100.000	1,13 %	26.05.2024	122.173	0,04 %
Santander UK plc	€ 100.000	0,88 %	13.01.2020	122.103	0,04 %
British Telecommunications plc	€ 100.000	1,13 %	10.06.2019	122.092	0,04 %
BAT Capital Corp.	€ 100.000	1,13 %	16.11.2023	121.894	0,04 %
Annington Funding plc	€ 100.000	1,65 %	12.07.2024	121.527	0,04 %
BP Capital Markets plc	€ 100.000	1,08 %	26.06.2025	121.505	0,04 %
easyJet plc	€ 100.000	1,13 %	18.10.2023	121.415	0,04 %
G4S International Finance plc	€ 100.000	1,50 %	02.06.2024	121.323	0,04 %
Nationwide Building Society	€ 100.000	0,50 %	29.10.2019	121.173	0,04 %
Imperial Brands Finance plc	€ 100.000	0,50 %	27.07.2021	120.712	0,04 %
Anglo American Capital plc	€ 100.000	1,63 %	18.09.2025	120.406	0,04 %
HSBC Holdings plc	€ 100.000	0,88 %	06.09.2024	120.396	0,03 %
GlaxoSmithKline Capital plc	€ 100.000	1,00 %	12.09.2026	120.331	0,03 %
British Telecommunications plc	€ 100.000	1,00 %	23.06.2024	120.043	0,03 %
Motability Operations Group plc	€ 100.000	0,88 %	14.03.2025	119.997	0,03 %
British Telecommunications plc	€ 100.000	0,50 %	23.06.2022	119.979	0,03 %
Vodafone Group plc	€ 100.000	1,50 %	24.07.2027	119.952	0,03 %
GlaxoSmithKline Capital plc	€ 100.000	0,00 %	12.09.2020	119.869	0,03 %
AstraZeneca plc	€ 100.000	0,75 %	12.05.2024	119.728	0,03 %
Barclays plc^	€ 100.000	2,00 %	07.02.2028	119.555	0,03 %
British Telecommunications plc	€ 100.000	1,00 %	21.11.2024	119.151	0,03 %
Compass Group International BV	€ 100.000	0,63 %	03.07.2024	119.071	0,03 %
Yorkshire Water Services Bradford Finance Ltd.	£ 50.000	6,38 %	19.08.2039	106.683	0,03 %
Trinity Acquisition plc	\$ 100.000	4,40 %	15.03.2026	104.372	0,03 %
Anglo American Capital plc	\$ 100.000	4,75 %	10.04.2027	104.302	0,03 %
BAE Systems Holdings, Inc.	\$ 100.000	3,80 %	07.10.2024	103.838	0,03 %
SSE plc	£ 50.000	6,25 %	27.08.2038	102.040	0,03 %
Vodafone Group plc	\$ 100.000	2,95 %	19.02.2023	100.545	0,03 %
BAT Capital Corp.	\$ 100.000	2,30 %	14.08.2020	99.416	0,03 %
Vodafone Group plc	\$ 75.000	6,25 %	30.11.2032	91.675	0,03 %
United Utilities Water Ltd.	£ 50.000	5,00 %	28.02.2035	90.914	0,03 %
London Power Networks plc	£ 50.000	6,13 %	07.06.2027	89.348	0,03 %
Anglian Water Services Financing plc	£ 50.000	5,84 %	30.07.2022	81.043	0,02 %
Wales & West Utilities Finance plc	£ 50.000	6,25 %	30.11.2021	80.315	0,02 %
WPP Finance 2010	\$ 75.000	4,75 %	21.11.2021	80.131	0,02 %
Vodafone Group plc	\$ 75.000	4,38 %	19.02.2043	76.860	0,02 %
United Utilities Water Ltd.	€ 50.000	4,25 %	24.01.2020	65.186	0,02 %
BAE Systems Holdings, Inc.	\$ 50.000	4,75 %	07.10.2044	55.476	0,02 %
Niagara Mohawk Power Corp.	\$ 50.000	4,12 %	28.11.2042	53.272	0,02 %
Vodafone Group plc	\$ 50.000	5,45 %	10.06.2019	52.195	0,01 %
CNH Industrial NV	\$ 50.000	4,50 %	15.08.2023	52.000	0,01 %
Sky plc	\$ 50.000	3,75 %	16.09.2024	51.969	0,01 %
BAT Capital Corp.	\$ 50.000	3,56 %	15.08.2027	50.050	0,01 %
Sky plc	\$ 50.000	2,63 %	16.09.2019	50.000	0,01 %
Niagara Mohawk Power Corp.	\$ 50.000	2,72 %	28.11.2022	49.582	0,01 %
Massachusetts Electric Co.	\$ 25.000	5,90 %	15.11.2039	32.424	0,01 %
Sky Group Finance plc	\$ 25.000	6,50 %	15.10.2035	31.737	0,01 %
United Utilities plc	\$ 25.000	6,88 %	15.08.2028	30.357	0,01 %
WPP Finance 2010	\$ 25.000	5,13 %	07.09.2042	26.489	0,01 %
United Utilities plc	\$ 25.000	5,38 %	01.02.2019	25.723	0,01 %
				27.333.400	8,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
USA 56,54 %					
US Treasury Note	\$ 1.150.000	1,75 %	30.11.2019	1.147.125	0,34 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 900.000	2,65 %	01.02.2021	904.373	0,27 %
Bank of America Corp.^	\$ 843.160	3,00 %	20.12.2023	843.702	0,25 %
Abbott Laboratories	\$ 800.000	2,90 %	30.11.2021	808.417	0,24 %
Bank of America Corp.^	\$ 807.000	3,42 %	20.12.2028	805.272	0,24 %
PepsiCo, Inc.	\$ 600.000	3,60 %	01.03.2024	629.595	0,18 %
Coca-Cola Co.	\$ 550.000	1,38 %	30.05.2019	545.376	0,16 %
AbbVie, Inc.	\$ 475.000	4,50 %	14.05.2035	521.821	0,15 %
Medtronic, Inc.	\$ 500.000	2,50 %	15.03.2020	502.672	0,15 %
Citigroup, Inc.	\$ 500.000	2,05 %	07.06.2019	498.504	0,15 %
GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	\$ 450.000	4,42 %	15.11.2035	486.836	0,14 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 450.000	3,65 %	01.02.2026	464.161	0,14 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 400.000	4,70 %	01.02.2036	448.782	0,13 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 450.000	1,95 %	15.10.2020	445.887	0,13 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 425.000	3,88 %	01.02.2024	444.924	0,13 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 400.000	4,00 %	01.09.2036	422.500	0,12 %
Citigroup, Inc.	\$ 400.000	4,00 %	05.08.2024	416.102	0,12 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 400.000	3,63 %	13.05.2024	414.500	0,12 %
Constellation Brands, Inc.	\$ 400.000	3,75 %	01.05.2021	413.597	0,12 %
AbbVie, Inc.	\$ 400.000	3,60 %	14.05.2025	411.088	0,12 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 400.000	3,30 %	01.02.2023	408.929	0,12 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 400.000	2,55 %	01.09.2020	403.501	0,12 %
AbbVie, Inc.	\$ 400.000	2,90 %	06.11.2022	401.166	0,12 %
Morgan Stanley	\$ 400.000	2,45 %	01.02.2019	400.786	0,12 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 400.000	2,60 %	23.04.2020	400.435	0,12 %
HSBC USA, Inc.	\$ 400.000	2,35 %	05.03.2020	399.834	0,12 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 400.000	2,25 %	23.01.2020	399.686	0,12 %
Abbott Laboratories	\$ 350.000	4,90 %	30.11.2046	399.500	0,12 %
Reynolds American, Inc.	\$ 375.000	4,45 %	12.06.2025	399.054	0,12 %
Kimberly-Clark Corp.	\$ 400.000	1,90 %	22.05.2019	398.590	0,12 %
Kimberly-Clark Corp.	\$ 400.000	2,40 %	01.03.2022	397.097	0,12 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 375.000	6,30 %	23.04.2019	394.797	0,12 %
Cardinal Health, Inc.	\$ 400.000	3,08 %	15.06.2024	393.653	0,12 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 400.000	3,75 %	15.07.2042	389.726	0,11 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 400.000	2,20 %	16.08.2023	387.348	0,11 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 350.000	5,75 %	24.01.2022	387.046	0,11 %
McCormick & Co., Inc.	\$ 375.000	3,15 %	15.08.2024	377.348	0,11 %
American Airlines 2016-2 Klasse AA Pass Through Trust	\$ 379.200	3,20 %	15.06.2028	376.512	0,11 %
Morgan Stanley ¹	\$ 375.000	2,50 %	21.04.2021	373.907	0,11 %
Procter & Gamble Co.	€ 300.000	1,13 %	02.11.2023	373.439	0,11 %
UnitedHealth Group, Inc. ¹	\$ 350.000	3,75 %	15.07.2025	368.293	0,11 %
Apple, Inc.	AUD 450.000	3,70 %	28.08.2022	364.321	0,11 %
Newell Brands Inc.	\$ 300.000	5,50 %	01.04.2046	359.427	0,11 %
AT&T, Inc.	\$ 350.000	2,85 %	14.02.2023	351.242	0,10 %
Apple, Inc.	\$ 350.000	2,85 %	11.05.2024	351.118	0,10 %
Morgan Stanley	\$ 350.000	2,38 %	23.07.2019	350.111	0,10 %
ConocoPhillips	\$ 250.000	6,50 %	01.02.2039	349.851	0,10 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 350.000	2,00 %	25.04.2019	348.541	0,10 %
Amgen, Inc.	\$ 300.000	4,66 %	15.06.2051	335.677	0,10 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 250.000	6,75 %	01.10.2037	334.744	0,10 %
Citigroup, Inc.^	\$ 325.000	3,67 %	24.07.2028	329.017	0,10 %
Wells Fargo & Co. ¹	\$ 325.000	2,13 %	22.04.2019	324.918	0,10 %
Apple, Inc.	\$ 325.000	2,25 %	23.02.2021	324.558	0,10 %
Wal-Mart Stores, Inc. 1	\$ 325.000	1,90 %	15.12.2020	322.873	0,09 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	\$ 325.000	1,90 %	23.09.2019	322.167	0,09 %
Bank of America Corp.	\$ 300.000	4,45 %	03.03.2026	320.202	0,09 %
Oracle Corp.	\$ 325.000	1,90 %	15.09.2021	319.676	0,09 %
Wells Fargo Bank NA	\$ 250.000	5,95 %	26.08.2036	319.564	0,09 %
Wells Fargo & Co.	\$ 300.000	4,60 %	01.04.2021	318.906	0,09 %
Bank of America Corp.	\$ 300.000	4,13 %	22.01.2024	318.474	0,09 %
Johnson & Johnson	\$ 300.000	3,63 %	03.03.2037	315.781	0,09 %
Apple, Inc.	€ 250.000	1,38 %	17.01.2024	315.305	0,09 %
Bank of America Corp.	\$ 300.000	4,20 %	26.08.2024	314.626	0,09 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 300.000	4,25 %	15.10.2020	314.526	0,09 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 250.000	5,40 %	06.01.2042	313.756	0,09 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Morgan Stanley	\$ 300.000	3,88 %	29.04.2024	312.992	0,09 %
Pfizer, Inc.	\$ 300.000	3,40 %	15.05.2024	311.766	0,09 %
Medtronic, Inc.	\$ 300.000	3,50 %	15.03.2025	311.722	0,09 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 300.000	3,85 %	08.07.2024	310.748	0,09 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 265.000	5,95 %	15.01.2027	308.559	0,09 %
Schlumberger Investment SA	\$ 300.000	3,30 %	14.09.2021	307.233	0,09 %
Verizon Communications, Inc.	£ 200.000	4,07 %	18.06.2024	304.578	0,09 %
Archer-Daniels-Midland Co.	\$ 300.000	3,75 %	15.09.2047	303.558	0,09 %
Apple, Inc.	\$ 300.000	3,00 %	09.02.2024	303.431	0,09 %
Bank of America Corp.	\$ 300.000	2,63 %	19.10.2020	302.303	0,09 %
Allergan Funding SCS	\$ 300.000	3,00 %	12.03.2020	302.266	0,09 %
Ryder System, Inc.	\$ 300.000	2,88 %	01.09.2020	301.956	0,09 %
Morgan Stanley	\$ 300.000	2,65 %	27.01.2020	301.206	0,09 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 300.000	2,75 %	15.09.2020	301.063	0,09 %
Chevron Corp.	\$ 300.000	2,19 %	15.11.2019	300.543	0,09 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 300.000	2,30 %	13.12.2019	299.222	0,09 %
GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	\$ 300.000	2,34 %	15.11.2020	298.783	0,09 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 300.000	2,35 %	15.12.2022	298.392	0,09 %
Amgen, Inc.	\$ 300.000	2,13 %	01.05.2020	298.348	0,09 %
Morgan Stanley	\$ 300.000	2,63 %	17.11.2021	298.275	0,09 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 300.000	2,91 %	05.06.2023	297.483	0,09 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 300.000	2,30 %	15.08.2021	297.347	0,09 %
Altria Group, Inc.	\$ 275.000	4,50 %	02.05.2043	297.043	0,09 %
PepsiCo, Inc. ¹	\$ 300.000	1,35 %	04.10.2019	296.283	0,09 %
Digital Realty Trust LP	\$ 275.000	5,25 %	15.03.2021	294.996	0,09 %
Medtronic, Inc.	\$ 250.000	4,63 %	15.03.2045	290.198	0,08 %
Wells Fargo & Co.	\$ 275.000	4,13 %	15.08.2023	288.954	0,08 %
Citigroup, Inc.	\$ 265.000	4,50 %	14.01.2022	281.929	0,08 %
Visa, Inc.	\$ 280.000	2,20 %	14.12.2020	279.848	0,08 %
BB&T Corp.	\$ 275.000	2,75 %	01.04.2022	276.807	0,08 %
CF Industries, Inc.	\$ 275.000	3,40 %	01.12.2021	276.351	0,08 %
Citibank NA	\$ 275.000	2,10 %	12.06.2020	272.544	0,08 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 275.000	1,40 %	20.09.2019	271.988	0,08 %
AT&T, Inc.	£ 200.000	3,55 %	14.09.2037	271.920	0,08 %
Synchrony Financial	\$ 265.000	3,75 %	15.08.2021	271.362	0,08 %
Intel Corp.	\$ 260.000	3,73 %	08.12.2047	270.935	0,08 %
John Deere Capital Corp.	\$ 275.000	1,25 %	09.10.2019	270.715	0,08 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 250.000	5,00 %	04.06.2042	268.253	0,08 %
AbbVie, Inc.	\$ 250.000	4,40 %	06.11.2042	267.948	0,08 %
Tyson Foods, Inc.	\$ 250.000	4,50 %	15.06.2022	266.856	0,08 %
Altria Group, Inc.	\$ 275.000	2,63 %	16.09.2026	265.823	0,08 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 250.000	4,80 %	15.07.2046	265.578	0,08 %
Union Pacific Corp.	\$ 250.000	3,75 %	15.03.2024	263.797	0,08 %
AT&T, Inc.	\$ 250.000	5,35 %	01.09.2040	263.733	0,08 %
Bank of America Corp.	\$ 200.000	5,88 %	07.02.2042	262.639	0,08 %
Apple, Inc.	\$ 225.000	4,65 %	23.02.2046	262.442	0,08 %
Norfolk Southern Corp.	\$ 250.000	5,90 %	15.06.2019	262.308	0,08 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 250.000	4,81 %	15.03.2039	261.485	0,08 %
Morgan Stanley	\$ 250.000	4,00 %	23.07.2025	260.858	0,08 %
PNC Bank NA	\$ 250.000	3,80 %	25.07.2023	260.654	0,08 %
Discover Bank	\$ 250.000	4,25 %	13.03.2026	260.450	0,08 %
Synchrony Financial	\$ 250.000	4,25 %	15.08.2024	258.678	0,08 %
Microsoft Corp. ¹	\$ 250.000	3,30 %	06.02.2027	257.645	0,08 %
Celgene Corp.	\$ 250.000	3,63 %	15.05.2024	257.022	0,08 %
Fluor Corp.	\$ 250.000	3,50 %	15.12.2024	256.609	0,08 %
JPMorgan Chase & Co.^	\$ 250.000	3,88 %	24.07.2038	255.754	0,07 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 250.000	3,75 %	15.10.2047	254.795	0,07 %
Branch Banking & Trust Co.	\$ 250.000	2,85 %	01.04.2021	253.462	0,07 %
Microsoft Corp.	\$ 250.000	2,88 %	06.02.2024	252.938	0,07 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 250.000	3,20 %	06.07.2021	252.383	0,07 %
Fifth Third Bank	\$ 250.000	2,88 %	01.10.2021	251.928	0,07 %
AT&T, Inc.	\$ 250.000	3,90 %	14.08.2027	251.699	0,07 %
Wells Fargo & Co.	€ 200.000	1,63 %	02.06.2025	251.313	0,07 %
Bank of America Corp.	€ 200.000	1,38 %	10.09.2021	250.446	0,07 %
PNC Bank NA	\$ 250.000	2,63 %	17.02.2022	250.121	0,07 %
Citizens Bank NA	\$ 250.000	2,45 %	04.12.2019	250.073	0,07 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
AT&T, Inc.	\$ 250.000	2,30 %	11.03.2019	250.046	0,07 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 250.000	2,15 %	01.02.2019	250.043	0,07 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 250.000	2,38 %	12.03.2019	250.000	0,07 %
US Bank NA	\$ 250.000	2,13 %	28.10.2019	249.870	0,07 %
AT&T, Inc.	\$ 250.000	2,45 %	30.06.2020	249.766	0,07 %
AT&T, Inc.	€ 200.000	1,45 %	01.06.2022	249.601	0,07 %
Huntington National Bank	\$ 250.000	2,40 %	01.04.2020	249.567	0,07 %
Comcast Corp.	\$ 175.000	6,95 %	15.08.2037	249.111	0,07 %
CVS Health Corp.	\$ 250.000	2,25 %	12.08.2019	248.850	0,07 %
KeyBank NA	\$ 250.000	2,50 %	22.11.2021	248.692	0,07 %
AT&T, Inc.	\$ 250.000	4,50 %	15.05.2035	248.387	0,07 %
PNC Bank NA	\$ 250.000	2,00 %	19.05.2020	247.934	0,07 %
Capital One Na	\$ 250.000	2,65 %	08.08.2022	247.407	0,07 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 200.000	5,70 %	15.02.2042	246.137	0,07 %
AT&T, Inc.	\$ 250.000	3,40 %	15.05.2025	246.075	0,07 %
Chubb INA Holdings, Inc.	\$ 175.000	6,70 %	15.05.2036	245.584	0,07 %
Wells Fargo & Co.	€ 200.000	1,50 %	24.05.2027	245.449	0,07 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	\$ 250.000	2,88 %	23.09.2023	244.891	0,07 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	€ 200.000	0,80 %	21.01.2022	244.405	0,07 %
International Business Machines Corp.	€ 200.000	0,50 %	07.09.2021	242.977	0,07 %
AT&T, Inc.	€ 200.000	1,05 %	04.09.2023	242.007	0,07 %
AT&T, Inc.	€ 200.000	2,35 %	04.09.2029	241.524	0,07 %
Morgan Stanley	\$ 225.000	4,30 %	27.01.2045	241.322	0,07 %
General Electric Co.	\$ 225.000	5,55 %	04.05.2020	240.900	0,07 %
Wells Fargo & Co.	\$ 225.000	4,30 %	22.07.2027	239.422	0,07 %
General Electric Co.	€ 200.000	0,88 %	17.05.2025	239.278	0,07 %
McDonald's Corp.	€ 200.000	0,63 %	29.01.2024	238.304	0,07 %
Coca-Cola Co.	€ 200.000	0,50 %	08.03.2024	238.287	0,07 %
Home Depot, Inc.	\$ 175.000	5,88 %	16.12.2036	237.423	0,07 %
Morgan Stanley	\$ 225.000	4,35 %	08.09.2026	235.688	0,07 %
Boeing Co.	\$ 225.000	6,00 %	15.03.2019	235.438	0,07 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 225.000	4,50 %	10.08.2033	234.926	0,07 %
Johnson & Johnson	\$ 200.000	4,50 %	05.12.2043	234.505	0,07 %
Apple, Inc.	\$ 225.000	3,85 %	04.05.2043	234.146	0,07 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 175.000	6,25 %	01.02.2041	233.796	0,07 %
Time Warner Cable LLC	\$ 200.000	6,55 %	01.05.2037	233.644	0,07 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 225.000	3,50 %	01.02.2025	231.913	0,07 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 200.000	4,80 %	01.04.2044	231.790	0,07 %
Verizon Communications, Inc.	€ 200.000	1,38 %	02.11.2028	231.718	0,07 %
Kroger Co.	\$ 225.000	3,40 %	15.04.2022	230.364	0,07 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 200.000	4,75 %	01.03.2046	229.874	0,07 %
Microsoft Corp. ¹	\$ 200.000	4,25 %	06.02.2047	228.676	0,07 %
Dr Pepper Snapple Group, Inc.	\$ 225.000	3,13 %	15.12.2023	227.381	0,07 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 225.000	2,95 %	15.03.2022	226.334	0,07 %
Oracle Corp.	\$ 225.000	2,63 %	15.02.2023	225.306	0,07 %
Medtronic, Inc.	\$ 200.000	4,38 %	15.03.2035	225.124	0,07 %
Pfizer, Inc.	£ 165.000	2,74 %	15.06.2043	224.806	0,07 %
Bank of America Corp.	\$ 150.000	7,75 %	14.05.2038	224.676	0,07 %
Sysco Corp.	\$ 225.000	3,25 %	15.07.2027	224.550	0,07 %
Merck & Co., Inc.	\$ 225.000	2,35 %	10.02.2022	224.519	0,07 %
Discovery Communications LLC	\$ 225.000	2,20 %	20.09.2019	223.972	0,07 %
Johnson & Johnson	\$ 225.000	1,88 %	05.12.2019	223.953	0,07 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	\$ 200.000	5,88 %	30.06.2026	223.000	0,07 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 175.000	6,13 %	15.02.2033	222.963	0,07 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 200.000	5,15 %	15.09.2023	222.425	0,07 %
American Express Co.	\$ 225.000	2,50 %	01.08.2022	222.284	0,07 %
Bank of America Corp.	\$ 221.000	2,60 %	15.01.2019	221.867	0,06 %
Pfizer, Inc.	\$ 200.000	4,00 %	15.12.2036	219.791	0,06 %
AT&T, Inc.	\$ 225.000	4,75 %	15.05.2046	219.045	0,06 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	5,75 %	01.02.2021	216.711	0,06 %
Valero Energy Corp.	\$ 200.000	9,38 %	15.03.2019	216.533	0,06 %
Hospitality Properties Trust	\$ 200.000	5,25 %	15.02.2026	214.671	0,06 %
Union Pacific Corp.	\$ 200.000	4,16 %	15.07.2022	214.217	0,06 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 200.000	4,13 %	15.12.2026	210.877	0,06 %
HP, Inc.	\$ 200.000	4,38 %	15.09.2021	210.598	0,06 %
Wells Fargo & Co.	\$ 200.000	4,10 %	03.06.2026	209.952	0,06 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 175.000	5,05 %	01.03.2041	209.901	0,06 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	4,39 %	08.01.2026	209.276	0,06 %
Amgen, Inc.	\$ 200.000	3,88 %	15.11.2021	208.908	0,06 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 200.000	4,13 %	16.03.2027	208.722	0,06 %
EOG Resources, Inc.	\$ 200.000	4,10 %	01.02.2021	208.666	0,06 %
Newell Brands Inc.	\$ 200.000	4,20 %	01.04.2026	208.566	0,06 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 200.000	4,86 %	21.08.2046	208.487	0,06 %
Newell Brands Inc.	\$ 200.000	4,00 %	01.12.2024	207.901	0,06 %
Cintas Corp.No 2	\$ 200.000	3,70 %	01.04.2027	207.868	0,06 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 200.000	3,90 %	15.02.2022	207.116	0,06 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	4,13 %	04.08.2025	207.104	0,06 %
McKesson Corp.	\$ 200.000	3,80 %	15.03.2024	207.053	0,06 %
Biogen, Inc.	\$ 200.000	3,63 %	15.09.2022	206.814	0,06 %
Celgene Corp.	\$ 200.000	3,88 %	15.08.2025	206.805	0,06 %
Chevron Corp.	\$ 200.000	4,95 %	03.03.2019	206.546	0,06 %
Amazon.com, Inc.	\$ 200.000	3,30 %	05.12.2021	206.358	0,06 %
State Street Corp.	\$ 200.000	3,30 %	16.12.2024	206.219	0,06 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 200.000	3,95 %	13.04.2024	205.660	0,06 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 150.000	6,40 %	15.05.2038	205.591	0,06 %
General Electric Co.	\$ 150.000	6,75 %	15.03.2032	205.388	0,06 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 200.000	3,25 %	01.09.2022	205.095	0,06 %
Apple, Inc.	\$ 200.000	3,35 %	09.02.2027	204.821	0,06 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 175.000	6,48 %	23.10.2045	204.616	0,06 %
Zoetis, Inc.	\$ 200.000	3,45 %	13.11.2020	204.549	0,06 %
Fluor Corp.	\$ 200.000	3,38 %	15.09.2021	204.330	0,06 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	3,81 %	09.01.2024	204.273	0,06 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	\$ 200.000	4,25 %	01.04.2024	204.030	0,06 %
Anthem, Inc.	\$ 175.000	5,10 %	15.01.2044	203.981	0,06 %
Laboratory Corp. of America Holdings	\$ 200.000	3,20 %	01.02.2022	203.875	0,06 %
Wells Fargo Canada Corp.	CAD 250.000	3,04 %	29.01.2021	203.452	0,06 %
Perrigo Finance Unlimited Co.	\$ 200.000	3,50 %	15.12.2021	203.437	0,06 %
GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	\$ 200.000	3,37 %	15.11.2025	203.159	0,06 %
Continental Airlines 2012-1 Klasse A Pass Through Trust	\$ 194.629	4,15 %	11.04.2024	203.120	0,06 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 200.000	3,04 %	01.03.2026	203.079	0,06 %
Marathon Oil Corp.	\$ 200.000	3,85 %	01.06.2025	203.034	0,06 %
AT&T, Inc.	\$ 200.000	4,90 %	14.08.2037	202.926	0,06 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	3,20 %	15.01.2021	202.821	0,06 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 200.000	3,13 %	15.09.2024	202.785	0,06 %
McCormick & Co., Inc.	\$ 200.000	3,40 %	15.08.2027	202.713	0,06 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 200.000	3,20 %	13.07.2020	202.236	0,06 %
Exelon Corp.	\$ 200.000	2,85 %	15.06.2020	201.657	0,06 %
Becton Dickinson and Co.	\$ 200.000	3,70 %	06.06.2027	201.511	0,06 %
Comcast Corp.	\$ 200.000	3,00 %	01.02.2024	201.500	0,06 %
Oracle Corp.	\$ 200.000	2,95 %	15.11.2024	201.428	0,06 %
Intel Corp.	\$ 200.000	2,88 %	11.05.2024	201.327	0,06 %
AT&T, Inc.	\$ 200.000	5,15 %	14.02.2050	201.125	0,06 %
Altria Group, Inc.	\$ 200.000	2,85 %	09.08.2022	201.074	0,06 %
Perrigo Finance Unlimited Co.	\$ 200.000	4,90 %	15.12.2044	201.067	0,06 %
Citigroup, Inc.	\$ 200.000	2,65 %	26.10.2020	200.975	0,06 %
Oracle Corp.	\$ 200.000	2,25 %	08.10.2019	200.815	0,06 %
PacificCorp	\$ 150.000	6,00 %	15.01.2039	200.812	0,06 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 200.000	3,30 %	01.04.2026	200.791	0,06 %
Wells Fargo & Co.	\$ 200.000	2,55 %	07.12.2020	200.735	0,06 %
New York Life Global Funding	\$ 200.000	2,90 %	17.01.2024	200.659	0,06 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 200.000	3,38 %	15.02.2025	200.500	0,06 %
Actavis, Inc.	\$ 200.000	3,25 %	01.10.2022	200.302	0,06 %
Capital One Financial Corp.	\$ 200.000	2,45 %	24.04.2019	200.279	0,06 %
US Bancorp	\$ 200.000	3,15 %	27.04.2027	200.244	0,06 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 200.000	2,65 %	15.12.2024	199.807	0,06 %
Walt Disney Co.	\$ 200.000	2,45 %	04.03.2022	199.724	0,06 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 200.000	2,25 %	15.06.2019	199.707	0,06 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	\$ 200.000	2,35 %	06.03.2020	199.580	0,06 %
PepsiCo, Inc.	\$ 200.000	2,15 %	14.10.2020	199.574	0,06 %
Chevron Corp.	\$ 200.000	2,41 %	03.03.2022	199.417	0,06 %
American Express Credit Corp.	\$ 200.000	2,20 %	03.03.2020	199.330	0,06 %
PepsiCo, Inc.	\$ 200.000	3,00 %	15.10.2027	199.246	0,06 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Exxon Mobil Corp.	\$ 200.000	1,91 %	06.03.2020	199.075	0,06 %
Pfizer, Inc.	\$ 200.000	1,70 %	15.12.2019	199.074	0,06 %
Apple, Inc.	\$ 200.000	1,90 %	07.02.2020	199.065	0,06 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 200.000	2,20 %	28.02.2021	199.063	0,06 %
Wells Fargo & Co.	\$ 200.000	2,63 %	22.07.2022	198.832	0,06 %
Estee Lauder Cos, Inc.	\$ 200.000	1,80 %	07.02.2020	198.536	0,06 %
MassMutual Global Funding II	\$ 200.000	2,75 %	22.06.2024	198.422	0,06 %
Hyundai Capital America	\$ 200.000	2,75 %	18.09.2020	198.400	0,06 %
Procter & Gamble Co.	\$ 200.000	2,85 %	11.08.2027	198.261	0,06 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	1,90 %	12.08.2019	198.097	0,06 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 200.000	2,93 %	15.01.2025	198.038	0,06 %
Apple, Inc.	\$ 200.000	1,10 %	02.08.2019	197.972	0,06 %
Microsoft Corp.	\$ 200.000	1,85 %	06.02.2020	197.933	0,06 %
Pfizer, Inc.	\$ 200.000	1,95 %	03.06.2021	197.810	0,06 %
Bunge Ltd. Finance Corp.	\$ 200.000	3,00 %	25.09.2022	197.606	0,06 %
Oracle Corp.	\$ 200.000	2,40 %	15.09.2023	197.527	0,06 %
Kroger Co.	\$ 200.000	1,50 %	30.09.2019	197.103	0,06 %
Molson Coors Brewing Co.	\$ 200.000	1,45 %	15.07.2019	197.058	0,06 %
Air Lease Corp.	\$ 200.000	2,63 %	01.07.2022	196.995	0,06 %
Brighthouse Financial Inc.	\$ 200.000	3,70 %	22.06.2027	195.763	0,06 %
Citigroup, Inc.	\$ 150.000	5,88 %	30.01.2042	195.555	0,06 %
Microsoft Corp.	\$ 175.000	4,10 %	06.02.2037	195.402	0,06 %
Berkshire Hathaway, Inc.	€ 150.000	2,15 %	15.03.2028	194.774	0,06 %
AIG Global Funding	\$ 200.000	1,90 %	06.10.2021	194.352	0,06 %
Microsoft Corp.	\$ 200.000	2,00 %	08.08.2023	194.348	0,06 %
Merck & Co., Inc.	\$ 175.000	4,15 %	18.05.2043	193.902	0,06 %
Energy Transfer LP	\$ 200.000	5,15 %	01.02.2043	193.346	0,06 %
Wal-Mart Stores, Inc.	£ 100.000	5,25 %	28.09.2035	192.383	0,06 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 175.000	4,25 %	15.04.2047	192.173	0,06 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 200.000	4,67 %	15.03.2055	191.107	0,06 %
Wells Fargo & Co.	€ 150.000	2,25 %	03.09.2020	190.520	0,06 %
Kimberly-Clark Corp.	\$ 150.000	5,30 %	01.03.2041	189.177	0,06 %
General Motors Co.	\$ 150.000	6,75 %	01.04.2046	188.527	0,06 %
AT&T, Inc.	\$ 200.000	4,50 %	09.03.2048	187.336	0,05 %
Jefferies Group LLC/Jefferies Group Capital Finance, Inc.	\$ 175.000	4,85 %	15.01.2027	185.305	0,05 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 175.000	4,91 %	23.07.2025	185.100	0,05 %
General Electric Co.	\$ 175.000	6,00 %	07.08.2019	185.011	0,05 %
Simon Property Group LP	\$ 180.000	3,38 %	15.03.2022	184.827	0,05 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 175.000	5,01 %	15.04.2049	183.481	0,05 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 175.000	4,00 %	03.03.2024	183.328	0,05 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 175.000	4,60 %	15.01.2020	183.096	0,05 %
Microsoft Corp.	\$ 175.000	3,70 %	08.08.2046	182.461	0,05 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 175.000	4,42 %	15.06.2021	182.353	0,05 %
Norfolk Southern Corp.	\$ 150.000	6,00 %	15.03.2105	182.322	0,05 %
Goldman Sachs Group, Inc.	£ 100.000	7,13 %	07.08.2025	181.455	0,05 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 175.000	3,40 %	15.05.2024	180.658	0,05 %
AT&T, Inc.	\$ 175.000	5,15 %	15.03.2042	180.550	0,05 %
Anthem, Inc.	\$ 175.000	3,70 %	15.08.2021	180.349	0,05 %
Entergy Arkansas, Inc.	\$ 175.000	3,50 %	01.04.2026	180.124	0,05 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 175.000	5,01 %	21.08.2054	179.103	0,05 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 175.000	3,50 %	06.06.2022	179.075	0,05 %
JPMorgan Chase & Co.	€ 150.000	0,63 %	25.01.2024	178.888	0,05 %
Molson Coors Brewing Co.	\$ 175.000	4,20 %	15.07.2046	178.407	0,05 %
WestRock RKT Co.	\$ 175.000	3,50 %	01.03.2020	178.141	0,05 %
Wells Fargo & Co.	\$ 175.000	3,30 %	09.09.2024	177.469	0,05 %
Microsoft Corp.	\$ 175.000	3,50 %	15.11.2042	177.217	0,05 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 175.000	3,48 %	01.06.2019	177.192	0,05 %
Morgan Stanley^	\$ 175.000	3,59 %	22.07.2028	176.218	0,05 %
Digital Realty Trust LP	\$ 175.000	3,70 %	15.08.2027	176.201	0,05 %
Dow Chemical Co.	\$ 175.000	3,00 %	15.11.2022	175.986	0,05 %
MetLife, Inc.	\$ 175.000	3,00 %	01.03.2025	175.170	0,05 %
General Electric Co.	£ 100.000	5,25 %	07.12.2028	174.190	0,05 %
Microsoft Corp.	\$ 175.000	2,00 %	03.11.2020	174.190	0,05 %
Merck & Co., Inc.	\$ 175.000	2,75 %	10.02.2025	174.164	0,05 %
Fortive Corp.	\$ 175.000	2,35 %	15.06.2021	172.967	0,05 %
Citigroup, Inc.	\$ 125.000	6,68 %	13.09.2043	172.466	0,05 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Halliburton Co.	\$ 150.000	5,00 %	15.11.2045	171.933	0,05 %
Aetna, Inc.	\$ 125.000	6,75 %	15.12.2037	170.186	0,05 %
Comcast Corp.	\$ 150.000	4,65 %	15.07.2042	169.111	0,05 %
Abbott Laboratories	\$ 150.000	4,75 %	30.11.2036	168.576	0,05 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 125.000	6,15 %	15.02.2041	167.968	0,05 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 160.000	3,63 %	15.12.2047	167.835	0,05 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	\$ 125.000	6,13 %	01.04.2036	167.669	0,05 %
Hess Corp.	\$ 150.000	5,80 %	01.04.2047	166.020	0,05 %
United Technologies Corp.	\$ 150.000	4,50 %	01.06.2042	165.747	0,05 %
Citigroup, Inc.	£ 100.000	5,15 %	21.05.2026	165.458	0,05 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 150.000	6,02 %	15.06.2026	165.393	0,05 %
AT&T, Inc.	CAD 200.000	3,83 %	25.11.2020	165.116	0,05 %
AT&T, Inc.	£ 100.000	5,20 %	18.11.2033	165.029	0,05 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 150.000	4,44 %	06.10.2048	163.728	0,05 %
Prudential Financial, Inc. ^	\$ 150.000	5,63 %	15.06.2043	163.500	0,05 %
Comcast Corp.	\$ 150.000	4,25 %	15.01.2033	163.003	0,05 %
American International Group, Inc.	\$ 150.000	4,50 %	16.07.2044	161.982	0,05 %
Apple, Inc.	£ 100.000	3,60 %	31.07.2042	161.627	0,05 %
Microsoft Corp.	\$ 150.000	4,00 %	12.02.2055	161.141	0,05 %
AT&T, Inc.	\$ 150.000	5,45 %	01.03.2047	160.201	0,05 %
Duke Energy Carolinas LLC	\$ 150.000	4,00 %	30.09.2042	159.925	0,05 %
Time Warner Cable LLC	£ 100.000	5,75 %	02.06.2031	159.568	0,05 %
Wells Fargo Bank NA	£ 100.000	5,25 %	01.08.2023	159.220	0,05 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 150.000	4,50 %	25.02.2026	159.184	0,05 %
Biogen, Inc.	\$ 150.000	4,05 %	15.09.2025	158.798	0,05 %
NBCUniversal Media LLC	\$ 150.000	4,38 %	01.04.2021	158.733	0,05 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	\$ 150.000	6,10 %	15.02.2042	158.142	0,05 %
Oracle Corp.	\$ 150.000	3,80 %	15.11.2037	157.416	0,05 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 150.000	4,03 %	15.10.2047	156.833	0,05 %
HCP, Inc.	\$ 150.000	4,00 %	01.12.2022	156.627	0,05 %
Dow Chemical Co.	\$ 150.000	4,25 %	15.11.2020	156.584	0,05 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 125.000	6,05 %	01.03.2034	156.580	0,05 %
Noble Energy, Inc.	\$ 150.000	4,15 %	15.12.2021	156.512	0,05 %
Citigroup, Inc.	\$ 150.000	4,30 %	20.11.2026	156.356	0,05 %
Boston Properties LP	\$ 150.000	3,85 %	01.02.2023	156.287	0,05 %
Prudential Financial, Inc.	\$ 150.000	3,50 %	15.05.2024	155.725	0,05 %
Agilent Technologies, Inc.	\$ 150.000	3,88 %	15.07.2023	155.523	0,05 %
CNH Industrial Capital LLC	\$ 150.000	4,38 %	05.04.2022	155.437	0,05 %
Essex Portfolio LP	\$ 150.000	3,88 %	01.05.2024	155.279	0,05 %
JPMorgan Chase & Co. ^	\$ 150.000	3,78 %	01.02.2028	155.218	0,05 %
Williams Partners LP	\$ 150.000	4,00 %	15.11.2021	155.130	0,05 %
Parker-Hannifin Corp.	\$ 150.000	3,50 %	15.09.2022	154.759	0,05 %
Humana, Inc.	\$ 150.000	3,95 %	15.03.2027	154.615	0,05 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 150.000	3,50 %	01.11.2021	154.362	0,05 %
Time Warner Cable LLC	\$ 150.000	4,00 %	01.09.2021	154.070	0,05 %
Citigroup, Inc.	\$ 150.000	3,70 %	12.01.2026	154.045	0,04 %
Medtronic Global Holdings SCA	\$ 150.000	3,35 %	01.04.2027	153.421	0,04 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 150.000	3,70 %	15.02.2026	153.331	0,04 %
American Tower Corp.	\$ 150.000	3,45 %	15.09.2021	152.951	0,04 %
Microsoft Corp.	\$ 150.000	3,13 %	03.11.2025	152.933	0,04 %
Wells Fargo & Co. ^	\$ 150.000	3,58 %	22.05.2028	152.868	0,04 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 150.000	3,12 %	15.04.2022	152.805	0,04 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	\$ 150.000	3,00 %	15.05.2022	152.741	0,04 %
American International Group, Inc.	\$ 150.000	3,30 %	01.03.2021	152.530	0,04 %
Allergan Funding SCS	\$ 150.000	3,80 %	15.03.2025	152.106	0,04 %
Visa, Inc.	\$ 150.000	2,80 %	14.12.2022	151.978	0,04 %
MetLife, Inc.	\$ 150.000	3,05 %	15.12.2022	151.820	0,04 %
Schlumberger Holdings Corp.	\$ 150.000	3,00 %	21.12.2020	151.748	0,04 %
American Tower Corp.	\$ 150.000	3,40 %	15.02.2019	151.735	0,04 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	\$ 150.000	3,05 %	09.01.2020	151.734	0,04 %
Wells Fargo & Co.	£ 100.000	3,50 %	12.09.2029	151.572	0,04 %
Intercontinental Exchange, Inc.	\$ 150.000	2,75 %	01.12.2020	151.433	0,04 %
Johnson & Johnson	\$ 150.000	2,45 %	05.12.2021	151.374	0,04 %
Berkshire Hathaway, Inc.	\$ 150.000	3,13 %	15.03.2026	151.301	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 150.000	2,63 %	21.02.2020	151.166	0,04 %
Pfizer, Inc.	\$ 150.000	3,00 %	15.12.2026	151.003	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
AT&T, Inc.	\$ 150.000	3,40 %	14.08.2024	150.841	0,04 %
AT&T, Inc.	\$ 150.000	2,80 %	17.02.2021	150.602	0,04 %
Comcast Corp.	\$ 150.000	3,15 %	15.02.2028	150.577	0,04 %
American Express Credit Corp.	\$ 150.000	2,70 %	03.03.2022	150.499	0,04 %
HCP, Inc.	\$ 150.000	2,63 %	01.02.2020	150.409	0,04 %
AT&T, Inc.	\$ 150.000	5,30 %	14.08.2058	150.396	0,04 %
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 150.000	2,30 %	10.04.2019	150.272	0,04 %
Precision Castparts Corp.	\$ 150.000	2,25 %	15.06.2020	150.252	0,04 %
Amazon.com, Inc.	\$ 150.000	3,15 %	22.08.2027	150.189	0,04 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 150.000	2,25 %	01.12.2019	150.186	0,04 %
Simon Property Group LP	\$ 150.000	2,50 %	15.07.2021	149.875	0,04 %
US Bancorp	\$ 150.000	2,35 %	29.01.2021	149.724	0,04 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 150.000	2,65 %	17.04.2020	149.637	0,04 %
Bank of America Corp.	\$ 125.000	4,88 %	01.04.2044	149.634	0,04 %
McDonald's Corp.	\$ 150.000	1,88 %	29.05.2019	149.486	0,04 %
Kellogg Co.	\$ 150.000	3,25 %	01.04.2026	149.195	0,04 %
Merck & Co., Inc.	\$ 150.000	1,85 %	10.02.2020	149.143	0,04 %
Georgia Power Co.	\$ 150.000	2,00 %	08.09.2020	149.108	0,04 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 150.000	2,00 %	21.02.2020	148.946	0,04 %
Wells Fargo & Co.	\$ 125.000	5,38 %	02.11.2043	148.780	0,04 %
Apple, Inc.	\$ 150.000	2,30 %	11.05.2022	148.738	0,04 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	\$ 150.000	3,20 %	15.08.2027	148.593	0,04 %
Simon Property Group LP	\$ 150.000	3,25 %	30.11.2026	148.571	0,04 %
Bank of America Corp.	\$ 150.000	2,50 %	21.10.2022	148.394	0,04 %
Protective Life Global Funding	\$ 150.000	1,56 %	13.09.2019	148.267	0,04 %
Bank of America Corp.	\$ 150.000	3,25 %	21.10.2027	148.177	0,04 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	\$ 150.000	1,30 %	15.08.2019	148.118	0,04 %
SunTrust Bank	\$ 150.000	2,45 %	01.08.2022	148.061	0,04 %
Microsoft Corp.	\$ 150.000	1,10 %	08.08.2019	147.950	0,04 %
Pricoa Global Funding I	\$ 150.000	2,45 %	21.09.2022	147.858	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 150.000	4,52 %	15.09.2048	147.743	0,04 %
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 150.000	3,00 %	19.09.2027	147.700	0,04 %
Apple, Inc.	\$ 150.000	2,90 %	12.09.2027	147.693	0,04 %
Home Depot, Inc.	\$ 150.000	2,80 %	14.09.2027	147.309	0,04 %
Microsoft Corp.	\$ 125.000	4,50 %	06.02.2057	147.210	0,04 %
Bank of America Corp.	£ 100.000	5,50 %	04.12.2019	146.729	0,04 %
Bunge Ltd. Finance Corp.	\$ 150.000	3,75 %	25.09.2027	146.588	0,04 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	\$ 150.000	3,20 %	23.09.2026	146.568	0,04 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 125.000	6,38 %	23.10.2035	146.477	0,04 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 150.000	2,90 %	20.05.2024	146.279	0,04 %
Microsoft Corp.	€ 100.000	3,13 %	06.12.2028	145.615	0,04 %
Target Corp.	\$ 100.000	7,00 %	15.01.2038	145.254	0,04 %
Kimco Realty Corp.	\$ 150.000	2,70 %	01.03.2024	144.980	0,04 %
General Electric Co.	\$ 100.000	6,88 %	10.01.2039	143.812	0,04 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 125.000	4,88 %	15.11.2043	142.671	0,04 %
MetLife, Inc.	\$ 125.000	4,60 %	13.05.2046	142.483	0,04 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 100.000	6,20 %	15.04.2038	141.082	0,04 %
BlackRock, Inc.	\$ 133.000	4,25 %	24.05.2021	140.367	0,04 %
Oracle Corp.	\$ 125.000	4,30 %	08.07.2034	138.896	0,04 %
JPMorgan Chase & Co.	€ 100.000	3,00 %	19.02.2026	138.089	0,04 %
Wal-Mart Stores, Inc.	€ 100.000	2,55 %	08.04.2026	136.766	0,04 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 100.000	6,20 %	15.01.2038	136.478	0,04 %
General Motors Co.	\$ 125.000	5,40 %	01.04.2048	136.346	0,04 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 125.000	4,95 %	15.10.2054	136.177	0,04 %
PepsiCo, Inc.	€ 100.000	2,63 %	28.04.2026	136.174	0,04 %
Philip Morris International, Inc.	€ 100.000	2,88 %	03.03.2026	136.146	0,04 %
Prologis LP	€ 100.000	3,00 %	02.06.2026	135.533	0,04 %
Apache Corp.	\$ 125.000	5,10 %	01.09.2040	135.200	0,04 %
Goldman Sachs Group Inc/The	€ 100.000	3,00 %	12.02.2031	135.091	0,04 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 125.000	5,45 %	15.06.2023	135.080	0,04 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 100.000	5,63 %	01.04.2040	134.829	0,04 %
Northwestern Mutual Life Insurance Co.	\$ 100.000	6,06 %	30.03.2040	134.427	0,04 %
Nasdaq, Inc.	€ 100.000	3,88 %	07.06.2021	134.261	0,04 %
Discovery Communications LLC	£ 100.000	2,50 %	20.09.2024	133.915	0,04 %
ERP Operating LP	\$ 125.000	4,63 %	15.12.2021	133.788	0,04 %
Procter & Gamble Co.	£ 100.000	1,38 %	03.05.2025	133.625	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sabine Pass Liquefaction LLC	\$ 125.000	5,63 %	01.02.2021	133.594	0,04 %
JPMorgan Chase & Co.	€ 100.000	2,75 %	01.02.2023	133.490	0,04 %
Capital One Financial Corp.	\$ 125.000	4,75 %	15.07.2021	133.352	0,04 %
Welltower, Inc.	\$ 125.000	4,50 %	15.01.2024	133.324	0,04 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	€ 100.000	2,63 %	15.03.2023	133.025	0,04 %
McDonald's Corp.	\$ 100.000	6,30 %	01.03.2038	132.887	0,04 %
United Technologies Corp.	\$ 100.000	6,13 %	15.07.2038	132.872	0,04 %
Oracle Corp.	\$ 125.000	4,00 %	15.11.2047	132.823	0,04 %
Amazon.com, Inc.	\$ 125.000	3,88 %	22.08.2037	132.643	0,04 %
Travelers Cos, Inc.	\$ 125.000	4,00 %	30.05.2047	132.305	0,04 %
Cargill, Inc.	€ 100.000	2,50 %	15.02.2023	132.134	0,04 %
Prologis LP	€ 100.000	3,00 %	18.01.2022	131.779	0,04 %
Halliburton Co.	\$ 125.000	4,50 %	15.11.2041	131.703	0,04 %
Bank of America Corp.	€ 100.000	2,38 %	19.06.2024	131.625	0,04 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 100.000	6,00 %	15.05.2037	131.370	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 100.000	5,13 %	23.10.2019	131.238	0,04 %
Prudential Financial, Inc.^	\$ 120.000	5,88 %	15.09.2042	131.186	0,04 %
Aon Corp.	\$ 100.000	8,21 %	01.01.2027	130.875	0,04 %
Duke Energy Corp.	\$ 125.000	5,05 %	15.09.2019	130.347	0,04 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 100.000	5,75 %	01.05.2040	130.183	0,04 %
Commonwealth Edison Co.	\$ 100.000	5,90 %	15.03.2036	130.135	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	€ 100.000	2,38 %	17.02.2022	129.831	0,04 %
JPMorgan Chase & Co.	€ 100.000	2,63 %	23.04.2021	129.804	0,04 %
Merck & Co., Inc.	€ 100.000	1,88 %	15.10.2026	129.628	0,04 %
International Business Machines Corp.	\$ 125.000	3,45 %	19.02.2026	129.170	0,04 %
Invesco Finance plc	\$ 125.000	3,75 %	15.01.2026	129.168	0,04 %
Citigroup, Inc.	\$ 125.000	3,75 %	16.06.2024	129.166	0,04 %
Comcast Corp.	\$ 125.000	3,97 %	01.11.2047	129.112	0,04 %
Citigroup, Inc.	€ 100.000	2,13 %	10.09.2026	129.010	0,04 %
General Electric Co.	\$ 100.000	5,88 %	14.01.2038	129.000	0,04 %
Texas Eastern Transmission LP	\$ 100.000	7,00 %	15.07.2032	128.897	0,04 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 100.000	6,20 %	15.12.2034	128.863	0,04 %
Illinois Tool Works, Inc.	€ 100.000	2,13 %	22.05.2030	128.650	0,04 %
HCP, Inc.	\$ 125.000	4,00 %	01.06.2025	128.515	0,04 %
Morgan Stanley	€ 100.000	2,38 %	31.03.2021	128.329	0,04 %
Comcast Corp.	\$ 125.000	3,38 %	15.08.2025	128.215	0,04 %
Xylem, Inc.	€ 100.000	2,25 %	11.03.2023	128.203	0,04 %
Kroger Co.	\$ 125.000	4,65 %	15.01.2048	128.186	0,04 %
Morgan Stanley	€ 100.000	5,00 %	02.05.2019	128.168	0,04 %
Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC	\$ 100.000	7,85 %	01.02.2026	127.824	0,04 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 125.000	4,40 %	13.07.2027	127.789	0,04 %
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 100.000	6,60 %	15.03.2046	127.589	0,04 %
Bank of America Corp.	€ 100.000	2,50 %	27.07.2020	127.500	0,04 %
Phillips 66	\$ 100.000	5,88 %	01.05.2042	127.461	0,04 %
United Technologies Corp.	€ 100.000	1,88 %	22.02.2026	127.349	0,04 %
Morgan Stanley	€ 100.000	1,88 %	30.03.2023	127.324	0,04 %
Citigroup, Inc.	\$ 100.000	6,63 %	15.06.2032	127.267	0,04 %
United Technologies Corp.	\$ 100.000	5,70 %	15.04.2040	127.261	0,04 %
Bank of America Corp.	\$ 100.000	6,11 %	29.01.2037	127.258	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 125.000	3,50 %	01.11.2024	127.246	0,04 %
Tyson Foods, Inc.	\$ 125.000	3,55 %	02.06.2027	127.058	0,04 %
Simon Property Group LP	€ 100.000	2,38 %	02.10.2020	127.010	0,04 %
Time Warner, Inc.	\$ 125.000	3,55 %	01.06.2024	126.909	0,04 %
DH Europe Finance SA	€ 100.000	1,70 %	04.01.2022	126.863	0,04 %
Dover Corp.	€ 100.000	2,13 %	01.12.2020	126.678	0,04 %
Time Warner, Inc.	€ 100.000	1,95 %	15.09.2023	126.656	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 125.000	3,13 %	16.03.2022	126.623	0,04 %
Eli Lilly & Co.	€ 100.000	1,63 %	02.06.2026	126.515	0,04 %
TD Ameritrade Holding Corp.	\$ 125.000	2,95 %	01.04.2022	126.188	0,04 %
Emerson Electric Co.	\$ 125.000	2,63 %	01.12.2021	126.161	0,04 %
JPMorgan Chase & Co.	€ 100.000	1,50 %	26.10.2022	126.069	0,04 %
McDonald's Corp.	€ 100.000	1,88 %	26.05.2027	126.016	0,04 %
LYB International Finance II BV	€ 100.000	1,88 %	02.03.2022	125.939	0,04 %
Kellogg Co.	€ 100.000	1,75 %	24.05.2021	125.858	0,04 %
Altria Group, Inc.	\$ 125.000	2,63 %	14.01.2020	125.754	0,04 %
Eastman Chemical Co.	€ 100.000	1,88 %	23.11.2026	125.741	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
TD Ameritrade Holding Corp.	\$ 125.000	3,30 %	01.04.2027	125.646	0,04 %
American Express Credit Corp.	\$ 125.000	2,60 %	14.09.2020	125.520	0,04 %
Citigroup, Inc.^	\$ 125.000	3,52 %	27.10.2028	125.377	0,04 %
Metropolitan Life Global Funding I	€ 100.000	2,38 %	30.09.2019	125.330	0,04 %
Marathon Petroleum Corp.	\$ 100.000	6,50 %	01.03.2041	125.179	0,04 %
JPMorgan Chase & Co.	€ 100.000	1,38 %	16.09.2021	125.099	0,04 %
Citigroup, Inc.	€ 100.000	1,38 %	27.10.2021	125.067	0,04 %
El du Pont de Nemours & Co.	\$ 125.000	2,80 %	15.02.2023	124.911	0,04 %
Mylan NV	€ 100.000	2,25 %	22.11.2024	124.884	0,04 %
Southern Power Co.	€ 100.000	1,85 %	20.06.2026	124.815	0,04 %
Time Warner, Inc.	\$ 125.000	3,80 %	15.02.2027	124.763	0,04 %
Honeywell International, Inc.	€ 100.000	1,30 %	22.02.2023	124.694	0,04 %
Delta Air Lines, Inc.	\$ 125.000	2,60 %	04.12.2020	124.639	0,04 %
ConocoPhillips Co.	\$ 125.000	2,20 %	15.05.2020	124.550	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 100.000	1,38 %	26.07.2022	124.541	0,04 %
Amgen, Inc.	€ 100.000	2,13 %	13.09.2019	124.539	0,04 %
ERP Operating LP	\$ 125.000	3,25 %	01.08.2027	124.443	0,04 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 100.000	7,30 %	15.08.2033	124.424	0,04 %
Metropolitan Life Global Funding I	€ 100.000	1,25 %	17.09.2021	124.344	0,04 %
Morgan Stanley	€ 100.000	1,88 %	27.04.2027	124.294	0,04 %
Intel Corp.	\$ 125.000	2,35 %	11.05.2022	124.256	0,04 %
Berkshire Hathaway, Inc.	€ 100.000	1,30 %	15.03.2024	124.187	0,04 %
Liberty Mutual Finance Europe DAC	€ 100.000	1,75 %	27.03.2024	124.143	0,04 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 100.000	5,63 %	16.08.2043	124.127	0,04 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	€ 100.000	2,13 %	20.11.2026	123.957	0,04 %
Wells Fargo & Co.	€ 100.000	1,13 %	29.10.2021	123.876	0,04 %
Walt Disney Co.	\$ 125.000	1,80 %	05.06.2020	123.800	0,04 %
Mastercard, Inc.	€ 100.000	1,10 %	01.12.2022	123.784	0,04 %
Bank of America Corp.^	€ 100.000	1,38 %	07.02.2025	123.461	0,04 %
Principal Financial Group, Inc.	\$ 125.000	3,10 %	15.11.2026	123.425	0,04 %
Toyota Motor Credit Corp.	€ 100.000	1,00 %	09.03.2021	123.380	0,04 %
Crown Castle International Corp.	\$ 125.000	3,20 %	01.09.2024	123.336	0,04 %
Williams Partners LP	\$ 100.000	6,30 %	15.04.2040	123.313	0,04 %
AT&T, Inc.	€ 100.000	3,15 %	04.09.2036	123.166	0,04 %
3M Co.	€ 100.000	0,95 %	15.05.2023	123.162	0,04 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 100.000	4,75 %	02.10.2043	123.156	0,04 %
Jackson National Life Global Funding	\$ 125.000	2,50 %	27.06.2022	123.043	0,04 %
Fidelity National Information Services, Inc.	\$ 125.000	2,25 %	15.08.2021	123.010	0,04 %
General Motors Financial International BV	€ 100.000	1,17 %	18.05.2020	122.902	0,04 %
Mondelez International, Inc.	€ 100.000	1,00 %	07.03.2022	122.847	0,04 %
Apple, Inc.	€ 100.000	1,38 %	24.05.2029	122.751	0,04 %
Tyco Electronics Group SA	€ 100.000	1,10 %	01.03.2023	122.731	0,04 %
Cox Communications, Inc.	\$ 125.000	3,15 %	15.08.2024	122.690	0,04 %
AbbVie, Inc.	€ 100.000	1,38 %	17.05.2024	122.598	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 100.000	1,38 %	15.05.2024	122.577	0,04 %
American Tower Corp.	\$ 125.000	3,38 %	15.10.2026	122.575	0,04 %
FedEx Corp.	€ 100.000	1,63 %	11.01.2027	122.338	0,04 %
PPG Industries, Inc.	€ 100.000	0,88 %	13.03.2022	122.305	0,04 %
Kraft Heinz Foods Co.	€ 100.000	1,50 %	24.05.2024	122.298	0,04 %
Southern California Edison Co.	\$ 100.000	5,35 %	15.07.2035	122.256	0,04 %
Priceline Group, Inc.	€ 100.000	1,80 %	03.03.2027	122.130	0,04 %
McKesson Corp.	€ 100.000	1,50 %	17.11.2025	121.926	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	€ 100.000	2,88 %	15.01.2038	121.602	0,04 %
Johnson & Johnson	€ 100.000	1,15 %	20.11.2028	121.564	0,04 %
Priceline Group, Inc.	€ 100.000	0,80 %	10.03.2022	121.532	0,04 %
3M Co.	\$ 125.000	1,63 %	19.09.2021	121.211	0,04 %
International Business Machines Corp.	€ 100.000	0,95 %	23.05.2025	121.098	0,04 %
McDonald's Corp.	€ 100.000	0,50 %	15.01.2021	121.042	0,04 %
Molson Coors Brewing Co.	€ 100.000	1,25 %	15.07.2024	120.975	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 100.000	1,25 %	01.05.2025	120.971	0,04 %
AbbVie, Inc.	€ 100.000	0,38 %	18.11.2019	120.803	0,04 %
DH Europe Finance SA	€ 100.000	1,20 %	30.06.2027	120.750	0,04 %
Becton Dickinson & Co.	€ 100.000	1,00 %	15.12.2022	120.673	0,04 %
Johnson & Johnson	€ 100.000	0,25 %	20.01.2022	120.667	0,04 %
US Bancorp	€ 100.000	0,85 %	07.06.2024	120.635	0,04 %
Berkshire Hathaway, Inc.	€ 100.000	0,25 %	17.01.2021	120.569	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
NiSource Finance Corp.	\$ 100.000	5,25 %	15.02.2043	120.517	0,04 %
Becton Dickinson & Co.	€ 100.000	0,37 %	06.06.2019	120.500	0,04 %
International Lease Finance Corp.	\$ 100.000	8,63 %	15.01.2022	120.500	0,04 %
Memorial Sloan-Kettering Cancer Center	\$ 100.000	5,00 %	01.07.2042	120.390	0,04 %
Citigroup, Inc.	€ 100.000	0,75 %	26.10.2023	120.274	0,04 %
Morgan Stanley	€ 100.000	1,38 %	27.10.2026	120.190	0,04 %
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 100.000	6,20 %	15.03.2040	120.166	0,04 %
Pfizer, Inc.	€ 100.000	0,00 %	06.03.2020	120.155	0,04 %
Pfizer, Inc.	€ 100.000	0,25 %	06.03.2022	120.082	0,04 %
General Electric Co.	€ 100.000	0,38 %	17.05.2022	119.912	0,03 %
John Deere Cash Management SA	€ 100.000	0,50 %	15.09.2023	119.809	0,03 %
Citigroup, Inc.	€ 100.000	1,50 %	26.10.2028	119.692	0,03 %
Allergan Funding SCS	€ 100.000	1,25 %	01.06.2024	119.513	0,03 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 125.000	3,13 %	15.01.2025	119.411	0,03 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	€ 100.000	1,45 %	16.03.2027	119.298	0,03 %
Discovery Communications LLC	€ 100.000	1,90 %	19.03.2027	119.295	0,03 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	\$ 100.000	5,30 %	01.02.2044	119.221	0,03 %
General Electric Co.	€ 100.000	2,13 %	17.05.2037	119.104	0,03 %
Ford Credit Canada Co.	CAD 150.000	2,58 %	10.05.2021	118.749	0,03 %
United Parcel Service, Inc.	€ 100.000	1,50 %	15.11.2032	118.295	0,03 %
Eaton Capital Unlimited Co.	€ 100.000	0,75 %	20.09.2024	118.218	0,03 %
Time Warner Cable LLC	\$ 125.000	4,50 %	15.09.2042	117.895	0,03 %
Verizon Communications, Inc.	AUD 150.000	4,05 %	17.02.2025	117.855	0,03 %
Devon Energy Corp.	\$ 100.000	5,60 %	15.07.2041	117.589	0,03 %
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl	€ 100.000	1,10 %	09.11.2027	117.346	0,03 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	€ 100.000	0,75 %	12.09.2024	117.324	0,03 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 100.000	5,13 %	15.11.2043	117.225	0,03 %
MetLife, Inc.	\$ 100.000	4,88 %	13.11.2043	117.175	0,03 %
Dow Chemical Co.	\$ 100.000	5,25 %	15.11.2041	116.828	0,03 %
AT&T, Inc.	CAD 150.000	2,85 %	25.05.2024	116.647	0,03 %
Philip Morris International, Inc.	€ 100.000	1,88 %	06.11.2037	116.419	0,03 %
CVS Health Corp.	\$ 100.000	5,30 %	05.12.2043	116.165	0,03 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 100.000	4,90 %	01.02.2046	115.771	0,03 %
Commonwealth Edison Co.	\$ 100.000	4,60 %	15.08.2043	115.286	0,03 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 100.000	4,50 %	01.12.2045	114.919	0,03 %
CVS Health Corp.	\$ 100.000	5,13 %	20.07.2045	114.809	0,03 %
Teachers Insurance & Annuity Association of America	\$ 100.000	4,90 %	15.09.2044	114.801	0,03 %
Southwestern Public Service Co.	\$ 100.000	4,50 %	15.08.2041	114.340	0,03 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 100.000	4,65 %	15.04.2042	114.203	0,03 %
Berkshire Hathaway, Inc.	\$ 100.000	4,50 %	11.02.2043	114.193	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 100.000	4,75 %	21.10.2045	113.917	0,03 %
Visa, Inc.	\$ 100.000	4,30 %	14.12.2045	113.739	0,03 %
AutoNation, Inc.	\$ 115.000	3,80 %	15.11.2027	113.680	0,03 %
Celgene Corp.	\$ 100.000	5,00 %	15.08.2045	113.110	0,03 %
Enbridge Energy Partners LP	\$ 100.000	5,88 %	15.10.2025	113.038	0,03 %
FedEx Corp.	\$ 100.000	4,75 %	15.11.2045	112.650	0,03 %
Home Depot, Inc.	\$ 100.000	4,25 %	01.04.2046	111.589	0,03 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 100.000	4,13 %	15.06.2047	111.562	0,03 %
Aviation Capital Group LLC	\$ 100.000	7,13 %	15.10.2020	111.529	0,03 %
Wells Fargo & Co.	\$ 100.000	4,75 %	07.12.2046	111.218	0,03 %
Morgan Stanley	\$ 80.000	6,38 %	24.07.2042	111.179	0,03 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 100.000	4,11 %	01.03.2046	111.138	0,03 %
Pfizer, Inc.	\$ 100.000	4,13 %	15.12.2046	111.048	0,03 %
Visa, Inc.	\$ 100.000	4,15 %	14.12.2035	110.964	0,03 %
Danaher Corp.	\$ 100.000	4,38 %	15.09.2045	110.900	0,03 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	\$ 100.000	4,35 %	30.01.2047	110.883	0,03 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	\$ 100.000	5,75 %	15.05.2024	110.750	0,03 %
Citigroup, Inc.	\$ 100.000	4,75 %	18.05.2046	110.385	0,03 %
FedEx Corp.	\$ 100.000	4,55 %	01.04.2046	109.913	0,03 %
XLIT Ltd.	\$ 100.000	5,75 %	01.10.2021	109.537	0,03 %
Allstate Corp.	\$ 100.000	4,20 %	15.12.2046	109.340	0,03 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	\$ 100.000	5,63 %	15.04.2023	109.250	0,03 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 100.000	5,00 %	15.07.2035	109.155	0,03 %
LYB International Finance BV	\$ 100.000	4,88 %	15.03.2044	109.083	0,03 %
ConocoPhillips Co.	\$ 100.000	4,30 %	15.11.2044	109.021	0,03 %
NBCUniversal Media LLC	\$ 100.000	4,45 %	15.01.2043	109.021	0,03 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Amazon.com, Inc.	\$ 100.000	4,25 %	22.08.2057	108.876	0,03 %
Coca-Cola Co.	€ 100.000	1,10 %	02.09.2036	108.766	0,03 %
Morgan Stanley	\$ 100.000	4,38 %	22.01.2047	108.665	0,03 %
PacifiCorp	\$ 75.000	7,70 %	15.11.2031	108.595	0,03 %
Energy Transfer LP	\$ 100.000	9,70 %	15.03.2019	108.262	0,03 %
General Motors Co.	\$ 100.000	4,88 %	02.10.2023	107.896	0,03 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 100.000	6,50 %	01.04.2020	107.787	0,03 %
Viacom, Inc.	\$ 125.000	4,38 %	15.03.2043	107.719	0,03 %
Amazon.com, Inc.	\$ 100.000	4,05 %	22.08.2047	107.701	0,03 %
Morgan Stanley	\$ 100.000	4,88 %	01.11.2022	107.516	0,03 %
MPLX LP	\$ 100.000	4,88 %	01.12.2024	107.410	0,03 %
Allergan Funding SCS	\$ 100.000	4,85 %	15.06.2044	107.182	0,03 %
General Electric Co.	\$ 100.000	4,65 %	17.10.2021	107.143	0,03 %
FedEx Corp.	\$ 100.000	4,40 %	15.01.2047	106.774	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 100.000	4,50 %	24.01.2022	106.746	0,03 %
General Motors Co.	\$ 100.000	5,15 %	01.04.2038	106.561	0,03 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 100.000	5,63 %	01.09.2041	106.393	0,03 %
Host Hotels & Resorts LP	\$ 100.000	4,75 %	01.03.2023	106.363	0,03 %
Illinois Tool Works, Inc.	\$ 100.000	3,90 %	01.09.2042	106.333	0,03 %
Lear Corp.	\$ 100.000	5,25 %	15.01.2025	106.250	0,03 %
Kinder Morgan, Inc.	\$ 100.000	5,30 %	01.12.2034	106.175	0,03 %
Williams Partners LP	\$ 100.000	4,90 %	15.01.2045	106.157	0,03 %
General Electric Co.	\$ 100.000	5,50 %	08.01.2020	106.142	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 100.000	4,25 %	01.10.2027	106.020	0,03 %
Magellan Midstream Partners LP	\$ 100.000	6,55 %	15.07.2019	105.910	0,03 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 100.000	3,75 %	01.04.2024	105.790	0,03 %
Wells Fargo & Co.	\$ 100.000	4,40 %	14.06.2046	105.786	0,03 %
Omnicom Group, Inc.	\$ 100.000	6,25 %	15.07.2019	105.772	0,03 %
Affiliated Managers Group, Inc.	\$ 100.000	4,25 %	15.02.2024	105.706	0,03 %
Oracle Corp.	\$ 100.000	3,85 %	15.07.2036	105.671	0,03 %
Williams Partners LP	\$ 100.000	4,50 %	15.11.2023	105.668	0,03 %
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 100.000	4,85 %	15.03.2021	105.617	0,03 %
Duke Energy Florida LLC	\$ 75.000	6,40 %	15.06.2038	105.566	0,03 %
Home Depot, Inc.	\$ 100.000	3,75 %	15.02.2024	105.394	0,03 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 100.000	4,90 %	15.10.2025	105.385	0,03 %
DR Horton, Inc.	\$ 100.000	4,38 %	15.09.2022	105.288	0,03 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 100.000	5,25 %	31.01.2020	105.270	0,03 %
Comcast Corp.	\$ 100.000	5,70 %	01.07.2019	105.159	0,03 %
Metropolitan Edison Co.	\$ 100.000	7,70 %	15.01.2019	105.152	0,03 %
Liberty Mutual Group, Inc.	\$ 100.000	4,25 %	15.06.2023	105.086	0,03 %
DDR Corp.	\$ 100.000	4,63 %	15.07.2022	105.042	0,03 %
Ascension Health	\$ 100.000	3,95 %	15.11.2046	104.981	0,03 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	\$ 100.000	5,00 %	01.02.2021	104.830	0,03 %
Owens Corning	\$ 100.000	4,20 %	15.12.2022	104.801	0,03 %
Energy Transfer LP	\$ 100.000	4,65 %	01.06.2021	104.797	0,03 %
L3 Technologies, Inc.	\$ 100.000	5,20 %	15.10.2019	104.797	0,03 %
International Lease Finance Corp.	\$ 100.000	6,25 %	15.05.2019	104.625	0,03 %
Johnson Controls International plc	\$ 100.000	3,90 %	14.02.2026	104.568	0,03 %
International Paper Co.	\$ 100.000	4,35 %	15.08.2048	104.455	0,03 %
Teachers Insurance & Annuity Association of America	\$ 74.000	6,85 %	16.12.2039	104.441	0,03 %
Welltower, Inc.	\$ 100.000	4,25 %	01.04.2026	104.419	0,03 %
International Business Machines Corp.	\$ 100.000	3,63 %	12.02.2024	104.403	0,03 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 100.000	6,50 %	31.01.2019	104.389	0,03 %
Aflac, Inc.	\$ 100.000	3,63 %	15.11.2024	104.327	0,03 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 100.000	3,90 %	01.10.2025	104.314	0,03 %
Ford Motor Co.	\$ 100.000	4,35 %	08.12.2026	104.219	0,03 %
Time Warner, Inc.	\$ 100.000	4,00 %	15.01.2022	104.217	0,03 %
Newmont Mining Corp.	\$ 100.000	5,13 %	01.10.2019	104.165	0,03 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital ¹	\$ 100.000	4,46 %	23.07.2022	104.090	0,03 %
Kinder Morgan, Inc.	\$ 100.000	4,30 %	01.06.2025	104.089	0,03 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 100.000	4,30 %	01.05.2024	104.072	0,03 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 100.000	4,50 %	17.07.2025	104.054	0,03 %
CNA Financial Corp.	\$ 100.000	3,95 %	15.05.2024	103.933	0,03 %
Ameriprise Financial, Inc.	\$ 100.000	3,70 %	15.10.2024	103.925	0,03 %
BlackRock, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	18.03.2024	103.819	0,03 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 100.000	3,55 %	15.01.2026	103.795	0,03 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
American International Group, Inc.	\$ 100.000	3,90 %	01.04.2026	103.727	0,03 %
Duke Energy Indiana LLC	\$ 75.000	6,35 %	15.08.2038	103.570	0,03 %
GE Capital UK Funding Unlimited Co.	£ 50.000	6,25 %	05.05.2038	103.519	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.^	\$ 100.000	4,03 %	24.07.2048	103.459	0,03 %
Union Pacific Corp.	\$ 100.000	3,60 %	15.09.2037	103.380	0,03 %
Union Pacific Corp.	\$ 100.000	4,10 %	15.09.2067	103.378	0,03 %
International Paper Co.	\$ 100.000	3,80 %	15.01.2026	103.328	0,03 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 75.000	6,65 %	15.11.2037	103.287	0,03 %
Discovery Communications LLC	\$ 100.000	5,00 %	20.09.2037	103.251	0,03 %
Wells Fargo & Co.	\$ 100.000	3,90 %	01.05.2045	103.150	0,03 %
Eagle Materials, Inc.	\$ 100.000	4,50 %	01.08.2026	103.125	0,03 %
DTE Energy Co.	\$ 100.000	3,80 %	15.03.2027	103.098	0,03 %
AutoZone, Inc.	\$ 100.000	3,70 %	15.04.2022	102.853	0,03 %
Kohl's Corp.	\$ 100.000	4,00 %	01.11.2021	102.840	0,03 %
Capital One Financial Corp.	\$ 100.000	4,20 %	29.10.2025	102.830	0,03 %
Southern Copper Corp.	\$ 85.000	5,88 %	23.04.2045	102.754	0,03 %
Capital One Financial Corp.	\$ 100.000	3,75 %	24.04.2024	102.714	0,03 %
Realty Income Corp.	\$ 100.000	3,88 %	15.07.2024	102.676	0,03 %
Occidental Petroleum Corp.	\$ 100.000	3,40 %	15.04.2026	102.583	0,03 %
Sammons Financial Group, Inc.	\$ 100.000	4,45 %	12.05.2027	102.580	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 100.000	3,85 %	26.01.2027	102.478	0,03 %
Medtronic, Inc.	\$ 100.000	3,15 %	15.03.2022	102.435	0,03 %
Apache Corp.	\$ 100.000	3,63 %	01.02.2021	102.312	0,03 %
Raytheon Co.	\$ 100.000	3,13 %	15.10.2020	102.294	0,03 %
Apple, Inc.	\$ 100.000	3,75 %	12.09.2047	102.259	0,03 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	\$ 100.000	3,80 %	18.11.2024	102.157	0,03 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 100.000	3,60 %	15.10.2020	102.101	0,03 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 100.000	3,80 %	01.11.2025	102.085	0,03 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 75.000	5,63 %	15.04.2041	102.077	0,03 %
MPLX LP	\$ 100.000	4,13 %	01.03.2027	102.067	0,03 %
AT&T, Inc.	\$ 100.000	4,25 %	01.03.2027	101.940	0,03 %
Apple, Inc.	\$ 100.000	3,20 %	13.05.2025	101.877	0,03 %
United Technologies Corp.	\$ 100.000	3,10 %	01.06.2022	101.841	0,03 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 100.000	3,58 %	23.07.2020	101.811	0,03 %
McDonald's Corp.	\$ 100.000	3,25 %	10.06.2024	101.778	0,03 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	\$ 100.000	3,30 %	18.11.2021	101.657	0,03 %
Praxair, Inc.	\$ 100.000	3,00 %	01.09.2021	101.650	0,03 %
GATX Corp.	\$ 100.000	3,85 %	30.03.2027	101.596	0,03 %
Ares Capital Corp.	\$ 100.000	3,88 %	15.01.2020	101.555	0,03 %
ONEOK, Inc.	\$ 100.000	4,00 %	13.07.2027	101.550	0,03 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 100.000	3,30 %	25.02.2021	101.539	0,03 %
CVS Health Corp.	\$ 100.000	3,50 %	20.07.2022	101.493	0,03 %
Oracle Corp.	\$ 100.000	3,25 %	15.11.2027	101.481	0,03 %
Principal Financial Group, Inc.	\$ 100.000	3,40 %	15.05.2025	101.469	0,03 %
Boston Properties LP	\$ 100.000	3,65 %	01.02.2026	101.437	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 100.000	3,69 %	05.06.2028	101.404	0,03 %
DDR Corp.	\$ 100.000	3,50 %	15.01.2021	101.396	0,03 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	\$ 100.000	3,20 %	15.07.2020	101.292	0,03 %
Westlake Chemical Corp.	\$ 100.000	3,60 %	15.08.2026	101.149	0,03 %
Cox Communications, Inc.	\$ 100.000	4,60 %	15.08.2047	101.078	0,03 %
Amazon.com, Inc.	\$ 100.000	2,60 %	05.12.2019	101.025	0,03 %
Andeavor Logistics LP/Tesoro Logistics Finance Corp.	\$ 100.000	4,25 %	01.12.2027	101.000	0,03 %
American Express Credit Corp.	\$ 100.000	3,30 %	03.05.2027	100.956	0,03 %
Chubb INA Holdings, Inc.	\$ 100.000	2,88 %	03.11.2022	100.946	0,03 %
FedEx Corp.	\$ 100.000	3,25 %	01.04.2026	100.831	0,03 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 100.000	3,25 %	15.06.2023	100.822	0,03 %
EPR Properties	\$ 100.000	4,50 %	01.06.2027	100.803	0,03 %
PSEG Power LLC	\$ 100.000	3,00 %	15.06.2021	100.736	0,03 %
Kroger Co.	\$ 100.000	3,70 %	01.08.2027	100.685	0,03 %
AvalonBay Communities, Inc.	\$ 100.000	3,35 %	15.05.2027	100.683	0,03 %
Chevron Corp.	\$ 100.000	2,90 %	03.03.2024	100.677	0,03 %
Rockwell Collins, Inc.	\$ 100.000	3,20 %	15.03.2024	100.645	0,03 %
FirstEnergy Corp.	\$ 75.000	7,38 %	15.11.2031	100.640	0,03 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 100.000	3,10 %	15.01.2019	100.635	0,03 %
CSX Corp.	\$ 100.000	4,25 %	01.11.2066	100.547	0,03 %
Invesco Finance plc	\$ 100.000	3,13 %	30.11.2022	100.544	0,03 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Home Depot, Inc.	\$ 100.000	2,63 %	01.06.2022	100.498	0,03 %
Kinder Morgan, Inc.	\$ 100.000	3,05 %	01.12.2019	100.436	0,03 %
CVS Health Corp.	\$ 100.000	2,80 %	20.07.2020	100.418	0,03 %
AT&T, Inc.	\$ 100.000	4,10 %	15.02.2028	100.294	0,03 %
Berkshire Hathaway, Inc.	\$ 100.000	2,10 %	14.08.2019	100.216	0,03 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 100.000	3,25 %	15.01.2028	100.204	0,03 %
Deere & Co.	\$ 100.000	2,60 %	08.06.2022	100.188	0,03 %
CVS Health Corp.	\$ 100.000	3,38 %	12.08.2024	100.177	0,03 %
New York Life Global Funding	\$ 100.000	2,15 %	18.06.2019	100.167	0,03 %
Penske Truck Leasing Co LP/PTL Finance Corp.	\$ 100.000	2,50 %	15.06.2019	100.165	0,03 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	\$ 100.000	2,70 %	01.04.2020	100.152	0,03 %
O'Reilly Automotive, Inc.	\$ 100.000	3,60 %	01.09.2027	100.122	0,03 %
Mid-America Apartments LP	\$ 100.000	3,60 %	01.06.2027	100.121	0,03 %
Comcast Corp.	\$ 100.000	2,75 %	01.03.2023	100.119	0,03 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 100.000	2,60 %	28.02.2023	100.072	0,03 %
Morgan Stanley	\$ 100.000	2,20 %	07.12.2018	100.069	0,03 %
International Business Machines Corp.	\$ 100.000	2,50 %	27.01.2022	100.058	0,03 %
Athene Global Funding	\$ 100.000	2,75 %	20.04.2020	100.044	0,03 %
McDonald's Corp.	\$ 100.000	2,63 %	15.01.2022	100.039	0,03 %
Allergan Funding SCS	\$ 100.000	2,45 %	15.06.2019	100.023	0,03 %
Ventas Realty LP	\$ 100.000	3,13 %	15.06.2023	100.001	0,03 %
Xerox Corp.	\$ 100.000	2,75 %	15.03.2019	99.983	0,03 %
Microsoft Corp.	\$ 100.000	2,40 %	06.02.2022	99.981	0,03 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 100.000	2,40 %	06.03.2022	99.971	0,03 %
Mastercard, Inc.	\$ 100.000	2,95 %	21.11.2026	99.964	0,03 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 100.000	3,05 %	15.11.2027	99.963	0,03 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 100.000	2,58 %	01.07.2020	99.952	0,03 %
eBay, Inc.	\$ 100.000	2,20 %	01.08.2019	99.902	0,03 %
FedEx Corp.	\$ 100.000	2,63 %	01.08.2022	99.872	0,03 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 100.000	3,15 %	30.06.2022	99.866	0,03 %
United Technologies Corp.	\$ 100.000	3,13 %	04.05.2027	99.841	0,03 %
El du Pont de Nemours & Co.	\$ 100.000	2,20 %	01.05.2020	99.821	0,03 %
John Deere Capital Corp.	\$ 100.000	1,95 %	08.01.2019	99.817	0,03 %
CSX Corp.	\$ 100.000	3,25 %	01.06.2027	99.801	0,03 %
General Electric Co.	\$ 100.000	2,70 %	09.10.2022	99.799	0,03 %
Costco Wholesale Corp.	\$ 100.000	2,75 %	18.05.2024	99.798	0,03 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 100.000	2,10 %	10.01.2020	99.786	0,03 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	\$ 100.000	4,45 %	15.08.2045	99.779	0,03 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 75.000	6,20 %	15.06.2036	99.743	0,03 %
Discovery Communications LLC	\$ 100.000	4,88 %	01.04.2043	99.730	0,03 %
Chevron Corp.	\$ 100.000	2,95 %	16.05.2026	99.700	0,03 %
Amazon.com, Inc.	\$ 100.000	2,80 %	22.08.2024	99.671	0,03 %
Regency Centers LP	\$ 100.000	3,60 %	01.02.2027	99.657	0,03 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 100.000	1,75 %	09.10.2019	99.648	0,03 %
E*TRADE Financial Corp.	\$ 100.000	3,80 %	24.08.2027	99.561	0,03 %
Procter & Gamble Co.	\$ 100.000	2,30 %	06.02.2022	99.555	0,03 %
Time Warner, Inc.	\$ 100.000	2,10 %	01.06.2019	99.540	0,03 %
Southern Co.	\$ 100.000	2,35 %	01.07.2021	99.519	0,03 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 100.000	2,10 %	20.05.2020	99.518	0,03 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 100.000	2,35 %	16.05.2022	99.485	0,03 %
Apple, Inc.	\$ 100.000	3,00 %	13.11.2027	99.453	0,03 %
Intel Corp.	\$ 100.000	1,85 %	11.05.2020	99.430	0,03 %
3M Co.	\$ 100.000	2,00 %	07.08.2020	99.425	0,03 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 100.000	3,95 %	01.12.2047	99.410	0,03 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 100.000	2,38 %	15.01.2020	99.402	0,03 %
IBM Credit LLC	\$ 100.000	1,63 %	06.09.2019	99.331	0,03 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 100.000	2,40 %	06.06.2022	99.314	0,03 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 100.000	3,00 %	15.01.2022	99.305	0,03 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 100.000	2,10 %	04.10.2019	99.277	0,03 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 100.000	2,80 %	15.11.2024	99.274	0,03 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 100.000	2,50 %	01.04.2023	99.259	0,03 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 100.000	4,20 %	15.03.2028	99.240	0,03 %
United Technologies Corp.	\$ 100.000	2,80 %	04.05.2024	99.226	0,03 %
United Airlines 2016-1 Klasse AA Pass Through Trust	\$ 100.000	3,10 %	07.07.2028	99.200	0,03 %
Brixmor Operating Partnership LP	\$ 100.000	3,65 %	15.06.2024	99.179	0,03 %
Allegion US Holding Co., Inc.	\$ 100.000	3,20 %	01.10.2024	99.178	0,03 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Northrop Grumman Corp.	\$ 100.000	2,55 %	15.10.2022	99.131	0,03 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 100.000	3,30 %	01.12.2027	99.125	0,03 %
Edison International	\$ 100.000	2,13 %	15.04.2020	99.086	0,03 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 75.000	6,15 %	01.09.2036	99.074	0,03 %
Consolidated Edison, Inc.	\$ 100.000	2,00 %	15.03.2020	99.064	0,03 %
Duke Energy Carolinas LLC	\$ 100.000	2,50 %	15.03.2023	99.059	0,03 %
Air Lease Corp.	\$ 100.000	3,00 %	15.09.2023	98.990	0,03 %
Boardwalk Pipelines LP	\$ 100.000	3,38 %	01.02.2023	98.941	0,03 %
Apple, Inc.	\$ 100.000	2,40 %	03.05.2023	98.936	0,03 %
Procter & Gamble Co.	\$ 100.000	2,15 %	11.08.2022	98.895	0,03 %
Duke Energy Corp.	\$ 100.000	3,75 %	01.09.2046	98.891	0,03 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	\$ 100.000	3,45 %	01.06.2026	98.886	0,03 %
Buckeye Partners LP	\$ 100.000	4,13 %	01.12.2027	98.825	0,03 %
Energy Transfer LP	\$ 100.000	4,20 %	15.04.2027	98.825	0,03 %
Aetna, Inc.	\$ 100.000	2,75 %	15.11.2022	98.808	0,03 %
Martin Marietta Materials, Inc.	\$ 100.000	3,45 %	01.06.2027	98.696	0,03 %
John Deere Capital Corp.	\$ 100.000	2,65 %	24.06.2024	98.682	0,03 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 75.000	5,50 %	15.01.2040	98.676	0,03 %
Visa, Inc.	\$ 100.000	2,75 %	15.09.2027	98.617	0,03 %
DDR Corp.	\$ 100.000	3,63 %	01.02.2025	98.527	0,03 %
Cox Communications, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	15.08.2027	98.515	0,03 %
IBM Credit LLC	\$ 100.000	1,80 %	20.01.2021	98.407	0,03 %
Marriott International, Inc.	\$ 100.000	3,13 %	15.06.2026	98.323	0,03 %
Crown Castle International Corp.	\$ 100.000	2,25 %	01.09.2021	98.286	0,03 %
IBM Credit LLC	\$ 100.000	2,20 %	08.09.2022	98.053	0,03 %
National Retail Properties, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	15.10.2027	97.845	0,03 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 100.000	2,20 %	15.01.2021	97.818	0,03 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 100.000	2,00 %	15.08.2021	97.755	0,03 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 100.000	3,25 %	20.05.2027	97.587	0,03 %
Oracle Corp.	\$ 100.000	2,65 %	15.07.2026	97.496	0,03 %
DTE Energy Co.	\$ 75.000	6,38 %	15.04.2033	97.496	0,03 %
Omega Healthcare Investors, Inc.	\$ 100.000	4,50 %	01.04.2027	97.375	0,03 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 100.000	1,70 %	09.08.2021	97.313	0,03 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 100.000	2,70 %	01.11.2023	97.200	0,03 %
Columbia Property Trust Operating Partnership LP	\$ 100.000	3,65 %	15.08.2026	97.080	0,03 %
Cigna Corp.	\$ 100.000	3,05 %	15.10.2027	97.066	0,03 %
Duke Energy Corp.	\$ 100.000	1,80 %	01.09.2021	97.036	0,03 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 75.000	8,35 %	15.07.2046	96.641	0,03 %
Target Corp.	\$ 75.000	6,35 %	01.11.2032	96.479	0,03 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 100.000	2,65 %	15.01.2023	96.435	0,03 %
NiSource Finance Corp.	\$ 75.000	5,95 %	15.06.2041	95.857	0,03 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 75.000	5,72 %	01.06.2040	95.746	0,03 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	\$ 100.000	2,85 %	31.01.2023	95.620	0,03 %
Duke Energy Corp.	\$ 100.000	2,65 %	01.09.2026	95.614	0,03 %
Georgia-Pacific LLC	\$ 75.000	8,00 %	15.01.2024	95.390	0,03 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 100.000	3,50 %	15.01.2028	95.291	0,03 %
CubeSmart LP	\$ 100.000	3,13 %	01.09.2026	95.023	0,03 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 75.000	8,10 %	15.07.2036	94.709	0,03 %
ONEOK Partners LP	\$ 75.000	6,85 %	15.10.2037	94.116	0,03 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 75.000	5,80 %	01.03.2037	93.826	0,03 %
Kentucky Utilities Co.	\$ 75.000	5,13 %	01.11.2040	92.513	0,03 %
Wells Fargo & Co.	\$ 75.000	5,38 %	07.02.2035	90.858	0,03 %
Weyerhaeuser Co.	\$ 71.000	6,95 %	01.10.2027	89.301	0,03 %
LYB International Finance BV	\$ 85.000	4,00 %	15.07.2023	89.018	0,03 %
Biogen, Inc.	\$ 75.000	5,20 %	15.09.2045	88.945	0,03 %
Exelon Corp.	\$ 75.000	5,10 %	15.06.2045	88.477	0,03 %
Devon Energy Corp.	\$ 75.000	5,85 %	15.12.2025	87.444	0,03 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 75.000	4,65 %	15.08.2043	87.221	0,03 %
XLIT Ltd.	\$ 75.000	6,38 %	15.11.2024	87.041	0,03 %
Blackstone Holdings Finance Co. LLC	\$ 75.000	5,00 %	15.06.2044	86.190	0,03 %
Walt Disney Co.	\$ 80.000	4,13 %	01.12.2041	86.115	0,03 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 75.000	4,45 %	15.03.2044	85.423	0,02 %
Cleveland Electric Illuminating Co.	\$ 75.000	5,50 %	15.08.2024	85.333	0,02 %
Oracle Corp.	\$ 75.000	4,50 %	08.07.2044	85.167	0,02 %
Nationwide Mutual Insurance Co.	\$ 50.000	9,38 %	15.08.2039	85.040	0,02 %
Vereit Operating Partnership LP	\$ 80.000	4,88 %	01.06.2026	84.500	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 75.000	5,55 %	15.03.2026	83.975	0,02 %
Georgia Power Co.	\$ 75.000	4,75 %	01.09.2040	83.163	0,02 %
FirstEnergy Corp.	\$ 75.000	4,85 %	15.07.2047	83.154	0,02 %
General Electric Co.	\$ 75.000	4,50 %	11.03.2044	83.084	0,02 %
Illinois Tool Works, Inc.	\$ 85.000	2,65 %	15.11.2026	82.863	0,02 %
CBS Corp.	\$ 75.000	5,50 %	15.05.2033	82.433	0,02 %
Hess Corp.	\$ 75.000	6,00 %	15.01.2040	82.155	0,02 %
Crown Castle International Corp.	\$ 75.000	5,25 %	15.01.2023	82.114	0,02 %
Citigroup, Inc.	CAD 100.000	3,39 %	18.11.2021	81.923	0,02 %
Kinder Morgan, Inc.	\$ 75.000	5,55 %	01.06.2045	81.663	0,02 %
CME Group, Inc.	\$ 80.000	3,00 %	15.03.2025	81.184	0,02 %
Deere & Co.	\$ 75.000	3,90 %	09.06.2042	81.140	0,02 %
Norfolk Southern Corp.	\$ 70.000	4,84 %	01.10.2041	81.125	0,02 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 75.000	4,65 %	20.05.2035	80.731	0,02 %
WestRock RKT Co.	\$ 75.000	4,90 %	01.03.2022	80.701	0,02 %
Expedia, Inc.	\$ 75.000	5,95 %	15.08.2020	80.684	0,02 %
AvalonBay Communities, Inc.	\$ 80.000	2,95 %	15.09.2022	80.647	0,02 %
Westar Energy, Inc.	\$ 75.000	4,13 %	01.03.2042	80.637	0,02 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	\$ 75.000	4,40 %	30.05.2047	80.513	0,02 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	\$ 75.000	4,80 %	18.11.2044	80.392	0,02 %
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 75.000	8,70 %	15.03.2019	80.354	0,02 %
ONEOK Partners LP	\$ 75.000	5,00 %	15.09.2023	80.345	0,02 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 75.000	5,50 %	01.03.2044	80.163	0,02 %
Southern Co.	\$ 75.000	4,40 %	01.07.2046	80.024	0,02 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	\$ 75.000	5,00 %	15.03.2027	79.875	0,02 %
Hartford Financial Services Group, Inc.	\$ 75.000	5,50 %	30.03.2020	79.806	0,02 %
NBCUniversal Media LLC	\$ 75.000	5,15 %	30.04.2020	79.724	0,02 %
Oracle Corp.	\$ 75.000	4,00 %	15.07.2046	79.715	0,02 %
Morgan Stanley	CAD 100.000	3,00 %	07.02.2024	79.374	0,02 %
American Express Co.	\$ 80.000	2,20 %	30.10.2020	79.372	0,02 %
Phillips 66	\$ 75.000	4,30 %	01.04.2022	79.209	0,02 %
Monsanto Co.	\$ 75.000	4,65 %	15.11.2043	79.145	0,02 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 75.000	3,63 %	04.03.2024	79.072	0,02 %
International Business Machines Corp.	\$ 75.000	4,00 %	20.06.2042	79.051	0,02 %
Republic Services, Inc.	\$ 75.000	5,50 %	15.09.2019	78.959	0,02 %
Apple, Inc.	CAD 100.000	2,51 %	19.08.2024	78.872	0,02 %
CSX Corp.	\$ 75.000	4,25 %	01.06.2021	78.801	0,02 %
Schlumberger Investment SA	\$ 75.000	3,65 %	01.12.2023	78.700	0,02 %
Interpublic Group of Cos, Inc.	\$ 75.000	4,20 %	15.04.2024	78.693	0,02 %
Sempra Energy	\$ 75.000	4,05 %	01.12.2023	78.347	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	CAD 100.000	2,43 %	26.04.2023	78.298	0,02 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 75.000	3,70 %	15.10.2025	78.276	0,02 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	\$ 75.000	3,75 %	15.11.2023	78.272	0,02 %
Target Corp.	\$ 75.000	3,88 %	15.07.2020	78.137	0,02 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	CAD 100.000	2,60 %	15.05.2024	78.118	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 75.000	4,35 %	17.01.2027	77.987	0,02 %
Airgas, Inc.	\$ 75.000	3,65 %	15.07.2024	77.942	0,02 %
Eaton Corp.	\$ 75.000	4,15 %	02.11.2042	77.801	0,02 %
Halliburton Co.	\$ 75.000	3,80 %	15.11.2025	77.765	0,02 %
Travelers Cos, Inc.	\$ 75.000	3,90 %	01.11.2020	77.746	0,02 %
Precision Castparts Corp.	\$ 75.000	3,90 %	15.01.2043	77.643	0,02 %
Wells Fargo & Co.	CAD 100.000	2,98 %	19.05.2026	77.601	0,02 %
International Paper Co.	\$ 75.000	3,65 %	15.06.2024	77.552	0,02 %
American Tower Corp.	\$ 75.000	4,00 %	01.06.2025	77.290	0,02 %
Valero Energy Corp.	\$ 75.000	3,65 %	15.03.2025	77.277	0,02 %
Microsoft Corp.	\$ 75.000	3,45 %	08.08.2036	77.252	0,02 %
Duke Energy Carolinas LLC	\$ 75.000	3,70 %	01.12.2047	77.147	0,02 %
Apple, Inc.	\$ 75.000	3,75 %	13.11.2047	77.112	0,02 %
Eastman Chemical Co.	\$ 75.000	3,60 %	15.08.2022	77.105	0,02 %
ConocoPhillips Co.	\$ 75.000	3,35 %	15.05.2025	76.899	0,02 %
Southwestern Public Service Co.	\$ 75.000	3,70 %	15.08.2047	76.719	0,02 %
AT&T, Inc.	\$ 75.000	3,80 %	01.03.2024	76.718	0,02 %
FirstEnergy Corp.	\$ 75.000	3,90 %	15.07.2027	76.713	0,02 %
Comcast Corp.	\$ 75.000	4,00 %	01.11.2049	76.705	0,02 %
AT&T, Inc.	\$ 75.000	5,15 %	15.11.2046	76.664	0,02 %
Lincoln National Corp.	\$ 75.000	3,63 %	12.12.2026	76.498	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
GE Capital UK Funding Unlimited Co.	£ 50.000	5,88 %	04.11.2020	76.417	0,02 %
Duke Energy Progress LLC	\$ 75.000	3,25 %	15.08.2025	76.398	0,02 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 75.000	3,25 %	15.06.2027	76.381	0,02 %
Florida Power & Light Co.	\$ 75.000	3,13 %	01.12.2025	76.320	0,02 %
Intel Corp.	\$ 75.000	3,15 %	11.05.2027	76.313	0,02 %
Motorola Solutions, Inc.	\$ 75.000	3,50 %	01.09.2021	76.277	0,02 %
VMware, Inc.	\$ 75.000	3,90 %	21.08.2027	76.238	0,02 %
Viacom, Inc.	\$ 75.000	4,25 %	01.09.2023	76.148	0,02 %
Sherwin-Williams Co.	\$ 75.000	3,45 %	01.06.2027	76.057	0,02 %
Marathon Petroleum Corp.	\$ 75.000	5,00 %	15.09.2054	75.963	0,02 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 75.000	3,00 %	15.09.2022	75.837	0,02 %
Omnicom Group, Inc.	\$ 75.000	3,60 %	15.04.2026	75.832	0,02 %
Ford Motor Co.	\$ 75.000	4,75 %	15.01.2043	75.821	0,02 %
Exelon Generation Co. LLC	\$ 75.000	2,95 %	15.01.2020	75.755	0,02 %
Mylan NV	\$ 75.000	3,95 %	15.06.2026	75.673	0,02 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 75.000	2,50 %	23.11.2020	75.565	0,02 %
Boeing Co.	\$ 75.000	2,85 %	30.10.2024	75.488	0,02 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 75.000	3,10 %	15.05.2025	75.370	0,02 %
Analog Devices, Inc.	\$ 75.000	3,13 %	05.12.2023	75.323	0,02 %
Time Warner, Inc.	\$ 75.000	4,65 %	01.06.2044	75.302	0,02 %
Priceline Group, Inc.	\$ 75.000	3,60 %	01.06.2026	75.299	0,02 %
ACE Capital Trust II	\$ 50.000	9,70 %	01.04.2030	75.250	0,02 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 75.000	3,70 %	15.04.2046	75.217	0,02 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	\$ 75.000	2,40 %	01.02.2020	75.137	0,02 %
Eaton Corp.	\$ 75.000	2,75 %	02.11.2022	75.084	0,02 %
JM Smucker Co.	\$ 75.000	3,38 %	15.12.2027	75.065	0,02 %
Roper Technologies, Inc.	\$ 75.000	2,80 %	15.12.2021	75.042	0,02 %
Occidental Petroleum Corp.	\$ 75.000	2,60 %	15.04.2022	74.984	0,02 %
DTE Energy Co.	\$ 75.000	2,40 %	01.12.2019	74.953	0,02 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 75.000	3,50 %	01.09.2023	74.941	0,02 %
JM Smucker Co.	\$ 75.000	2,20 %	06.12.2019	74.897	0,02 %
VMware, Inc.	\$ 75.000	2,95 %	21.08.2022	74.854	0,02 %
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 75.000	1,75 %	19.12.2018	74.770	0,02 %
Crown Castle International Corp.	\$ 75.000	3,65 %	01.09.2027	74.486	0,02 %
Amazon.com, Inc.	\$ 75.000	1,90 %	21.08.2020	74.467	0,02 %
Walt Disney Co.	\$ 75.000	2,95 %	15.06.2027	74.421	0,02 %
VMware, Inc.	\$ 75.000	2,30 %	21.08.2020	74.356	0,02 %
Energy Transfer LP	\$ 75.000	5,30 %	15.04.2047	74.297	0,02 %
Discovery Communications LLC	\$ 75.000	3,95 %	20.03.2028	74.285	0,02 %
Activision Blizzard, Inc.	\$ 75.000	2,30 %	15.09.2021	74.093	0,02 %
Discovery Communications LLC	\$ 75.000	2,95 %	20.03.2023	74.087	0,02 %
Citigroup, Inc.	\$ 75.000	2,35 %	02.08.2021	74.053	0,02 %
Markel Corp.	\$ 75.000	3,50 %	01.11.2027	74.048	0,02 %
EQT Corp.	\$ 75.000	3,00 %	01.10.2022	74.002	0,02 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	\$ 75.000	3,25 %	15.06.2026	73.884	0,02 %
Masco Corp.	\$ 75.000	3,50 %	15.11.2027	73.862	0,02 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 75.000	1,85 %	04.09.2020	73.788	0,02 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 75.000	3,88 %	15.01.2027	73.767	0,02 %
PepsiCo, Inc.	\$ 75.000	3,60 %	13.08.2042	73.748	0,02 %
Owens Corning	\$ 75.000	4,30 %	15.07.2047	73.726	0,02 %
Spectra Energy Partners LP	\$ 75.000	3,38 %	15.10.2026	73.711	0,02 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	\$ 75.000	2,40 %	23.09.2021	73.701	0,02 %
Honeywell International, Inc.	\$ 75.000	1,85 %	01.11.2021	73.567	0,02 %
Southern Co.	\$ 75.000	3,25 %	01.07.2026	73.554	0,02 %
Baltimore Gas & Electric Co.	\$ 75.000	3,50 %	15.08.2046	73.484	0,02 %
Intel Corp.	\$ 75.000	1,70 %	19.05.2021	73.462	0,02 %
PPL Capital Funding, Inc.	\$ 75.000	3,10 %	15.05.2026	73.401	0,02 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 75.000	4,20 %	01.11.2046	73.369	0,02 %
Monsanto Co.	\$ 75.000	2,85 %	15.04.2025	73.331	0,02 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 75.000	2,60 %	30.01.2023	73.027	0,02 %
Entergy Corp.	\$ 75.000	2,95 %	01.09.2026	72.679	0,02 %
Fidelity National Information Services, Inc.	\$ 75.000	3,00 %	15.08.2026	72.531	0,02 %
Entergy Mississippi, Inc.	\$ 75.000	2,85 %	01.06.2028	72.467	0,02 %
General Dynamics Corp.	\$ 75.000	2,63 %	15.11.2027	72.456	0,02 %
Air Products & Chemicals, Inc.	\$ 70.000	4,38 %	21.08.2019	72.379	0,02 %
Starbucks Corp.	\$ 75.000	2,45 %	15.06.2026	71.862	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Progressive Corp.	\$ 75.000	2,45 %	15.01.2027	71.674	0,02 %
Alphabet, Inc.	\$ 75.000	2,00 %	15.08.2026	70.618	0,02 %
Massachusetts Institute of Technology	\$ 50.000	5,60 %	01.07.2111	70.114	0,02 %
Georgia-Pacific LLC	\$ 50.000	7,75 %	15.11.2029	69.985	0,02 %
Prudential Financial, Inc.	\$ 68.000	3,94 %	07.12.2049	69.501	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 75.000	4,13 %	15.08.2046	69.318	0,02 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	\$ 50.000	7,00 %	01.05.2032	68.458	0,02 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 50.000	5,90 %	15.02.2039	68.319	0,02 %
Northern States Power Co.	\$ 50.000	6,20 %	01.07.2037	67.812	0,02 %
Florida Power & Light Co.	\$ 50.000	5,95 %	01.02.2038	67.091	0,02 %
Southern California Edison Co.	\$ 50.000	6,05 %	15.03.2039	67.033	0,02 %
Home Depot, Inc.	\$ 50.000	5,95 %	01.04.2041	66.931	0,02 %
Southwestern Electric Power Co.	\$ 50.000	6,20 %	15.03.2040	66.761	0,02 %
Liberty Mutual Group, Inc.	\$ 50.000	6,50 %	01.05.2042	66.732	0,02 %
HCP, Inc.	\$ 50.000	6,75 %	01.02.2041	66.624	0,02 %
Nucor Corp.	\$ 50.000	6,40 %	01.12.2037	66.497	0,02 %
Prudential Financial, Inc.	\$ 50.000	6,20 %	15.11.2040	66.350	0,02 %
Realty Income Corp.	\$ 60.000	4,65 %	15.03.2047	66.197	0,02 %
Valero Energy Corp.	\$ 50.000	6,63 %	15.06.2037	66.139	0,02 %
Applied Materials, Inc.	\$ 50.000	5,85 %	15.06.2041	66.065	0,02 %
ConocoPhillips	\$ 50.000	5,90 %	15.05.2038	65.695	0,02 %
Highwoods Realty LP	\$ 65.000	3,20 %	15.06.2021	65.519	0,02 %
NiSource Finance Corp.	\$ 65.000	2,65 %	17.11.2022	64.573	0,02 %
Sempra Energy	\$ 50.000	6,00 %	15.10.2039	64.500	0,02 %
CME Group, Inc.	\$ 50.000	5,30 %	15.09.2043	64.047	0,02 %
Newmont Mining Corp.	\$ 50.000	6,25 %	01.10.2039	63.819	0,02 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	\$ 50.000	5,85 %	15.03.2036	63.728	0,02 %
South Carolina Electric & Gas Co.	\$ 50.000	6,63 %	01.02.2032	63.434	0,02 %
Georgia Power Co.	\$ 50.000	5,95 %	01.02.2039	63.432	0,02 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 50.000	5,95 %	15.06.2035	63.224	0,02 %
Oracle Corp.	\$ 50.000	5,38 %	15.07.2040	63.048	0,02 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 55.000	4,75 %	15.09.2044	62.989	0,02 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	CAD 75.000	4,32 %	15.05.2047	62.838	0,02 %
Caterpillar, Inc.	\$ 50.000	5,20 %	27.05.2041	62.727	0,02 %
Loews Corp.	\$ 50.000	6,00 %	01.02.2035	62.691	0,02 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	\$ 50.000	5,30 %	01.06.2042	62.657	0,02 %
Aflac, Inc.	\$ 60.000	3,63 %	15.06.2023	62.533	0,02 %
Goldman Sachs Capital I	\$ 50.000	6,35 %	15.02.2034	62.500	0,02 %
McDonald's Corp.	\$ 55.000	4,70 %	09.12.2035	62.443	0,02 %
Cleveland Electric Illuminating Co.	\$ 50.000	5,95 %	15.12.2036	62.227	0,02 %
Welltower, Inc.	\$ 60.000	3,75 %	15.03.2023	62.195	0,02 %
Invesco Finance plc	\$ 50.000	5,38 %	30.11.2043	61.640	0,02 %
Thomson Reuters Corp.	CAD 75.000	3,31 %	12.11.2021	61.274	0,02 %
Swiss Re America Holding Corp.	\$ 50.000	7,00 %	15.02.2026	61.182	0,02 %
Northwestern University	\$ 50.000	4,64 %	01.12.2044	60.666	0,02 %
Amazon.com, Inc.	\$ 50.000	4,95 %	05.12.2044	60.559	0,02 %
Marathon Oil Corp.	\$ 50.000	6,80 %	15.03.2032	60.469	0,02 %
Illinois Tool Works, Inc.	\$ 50.000	4,88 %	15.09.2041	60.160	0,02 %
Raytheon Co.	\$ 50.000	4,88 %	15.10.2040	60.085	0,02 %
Sonoco Products Co.	\$ 50.000	5,75 %	01.11.2040	59.951	0,02 %
Home Depot, Inc.	\$ 50.000	4,88 %	15.02.2044	59.751	0,02 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 50.000	6,50 %	01.09.2039	58.864	0,02 %
Baker Hughes a GE Co. LLC	\$ 50.000	5,13 %	15.09.2040	58.723	0,02 %
Southern California Edison Co.	\$ 50.000	4,65 %	01.10.2043	58.540	0,02 %
Nationwide Financial Services, Inc.	\$ 50.000	5,30 %	18.11.2044	58.332	0,02 %
Jefferies Group LLC	\$ 50.000	6,50 %	20.01.2043	58.302	0,02 %
Exelon Generation Co. LLC	\$ 50.000	6,25 %	01.10.2039	58.197	0,02 %
CenterPoint Energy Houston Electric LLC	\$ 50.000	4,50 %	01.04.2044	58.123	0,02 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 50.000	4,70 %	15.05.2046	58.117	0,02 %
Baxalta, Inc.	\$ 50.000	5,25 %	23.06.2045	58.025	0,02 %
Arch Capital Finance LLC	\$ 50.000	5,03 %	15.12.2046	57.816	0,02 %
MetLife, Inc.	\$ 50.000	6,40 %	15.12.2036	57.750	0,02 %
International Paper Co.	\$ 50.000	5,15 %	15.05.2046	57.617	0,02 %
NYU Hospitals Center	\$ 50.000	4,78 %	01.07.2044	57.497	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 50.000	5,50 %	16.03.2047	56.978	0,02 %
Phillips 66	\$ 50.000	4,88 %	15.11.2044	56.953	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Microsoft Corp.	\$ 50.000	4,20 %	03.11.2035	56.579	0,02 %
Puget Sound Energy, Inc.	\$ 50.000	4,30 %	20.05.2045	56.401	0,02 %
Allstate Corp.^	\$ 47.000	6,50 %	15.05.2057	56.400	0,02 %
Magellan Midstream Partners LP	\$ 50.000	5,15 %	15.10.2043	56.385	0,02 %
Occidental Petroleum Corp.	\$ 50.000	4,63 %	15.06.2045	56.318	0,02 %
Ecolab, Inc.	\$ 55.000	3,95 %	01.12.2047	56.229	0,02 %
Connecticut Light & Power Co.	\$ 50.000	4,30 %	15.04.2044	56.062	0,02 %
CSX Corp.	\$ 50.000	4,75 %	30.05.2042	56.032	0,02 %
Anthem, Inc.	\$ 55.000	3,65 %	01.12.2027	55.987	0,02 %
Southern Power Co.	\$ 50.000	5,15 %	15.09.2041	55.926	0,02 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 50.000	4,38 %	01.09.2042	55.918	0,02 %
Jefferies Group LLC	\$ 50.000	6,88 %	15.04.2021	55.892	0,02 %
Basin Electric Power Cooperative	\$ 50.000	4,75 %	26.04.2047	55.752	0,02 %
Devon Energy Corp.	\$ 50.000	5,00 %	15.06.2045	55.579	0,02 %
Aon plc	\$ 50.000	4,75 %	15.05.2045	55.462	0,02 %
Voya Financial, Inc.	\$ 50.000	4,80 %	15.06.2046	55.368	0,02 %
Puget Energy, Inc.	\$ 50.000	6,00 %	01.09.2021	55.355	0,02 %
VW Grainger, Inc.	\$ 50.000	4,60 %	15.06.2045	55.208	0,02 %
Dover Corp.	\$ 45.000	5,38 %	01.03.2041	55.187	0,02 %
Ameren Illinois Co.	\$ 50.000	4,15 %	15.03.2046	55.185	0,02 %
Florida Power & Light Co.	\$ 50.000	4,13 %	01.02.2042	55.109	0,02 %
Andeavor	\$ 50.000	5,13 %	15.12.2026	55.000	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 50.000	5,25 %	16.03.2037	54.963	0,02 %
NV Energy, Inc.	\$ 50.000	6,25 %	15.11.2020	54.777	0,02 %
Dominion Energy Gas Holdings LLC	\$ 50.000	4,60 %	15.12.2044	54.625	0,02 %
Florida Power & Light Co.	\$ 50.000	4,05 %	01.06.2042	54.541	0,02 %
MPLX LP	\$ 50.000	5,20 %	01.03.2047	54.468	0,02 %
Dow Chemical Co.	\$ 50.000	4,63 %	01.10.2044	54.462	0,02 %
Federal Realty Investment Trust	\$ 50.000	4,50 %	01.12.2044	54.450	0,02 %
Constellation Brands, Inc.	\$ 50.000	4,50 %	09.05.2047	54.441	0,02 %
Noble Energy, Inc.	\$ 50.000	5,25 %	15.11.2043	54.413	0,02 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 50.000	6,20 %	15.10.2035	54.209	0,02 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 50.000	5,80 %	01.03.2021	54.198	0,02 %
Ford Motor Co.	\$ 50.000	5,29 %	08.12.2046	54.185	0,02 %
Sherwin-Williams Co.	\$ 50.000	4,55 %	01.08.2045	54.183	0,02 %
Assured Guaranty US Holdings, Inc.	\$ 50.000	5,00 %	01.07.2024	54.159	0,02 %
Progressive Corp.	\$ 50.000	4,13 %	15.04.2047	54.029	0,02 %
Mylan NV	\$ 50.000	5,25 %	15.06.2046	54.011	0,02 %
Sempra Energy	\$ 50.000	9,80 %	15.02.2019	53.979	0,02 %
Atmos Energy Corp.	\$ 50.000	4,15 %	15.01.2043	53.961	0,02 %
Duke Energy Progress LLC	\$ 50.000	4,10 %	15.05.2042	53.915	0,02 %
Georgia-Pacific LLC	\$ 50.000	5,40 %	01.11.2020	53.906	0,02 %
Public Service Electric & Gas Co.	\$ 50.000	3,95 %	01.05.2042	53.887	0,02 %
Total System Services, Inc.	\$ 50.000	4,80 %	01.04.2026	53.785	0,02 %
Unum Group	\$ 50.000	5,63 %	15.09.2020	53.769	0,02 %
Lincoln National Corp.	\$ 50.000	6,25 %	15.02.2020	53.767	0,02 %
Andeavor	\$ 50.000	4,75 %	15.12.2023	53.750	0,02 %
NYU Hospitals Center	\$ 50.000	4,37 %	01.07.2047	53.732	0,02 %
Farmers Exchange Capital III^	\$ 50.000	5,45 %	15.10.2054	53.713	0,02 %
Oracle Corp.	\$ 50.000	4,13 %	15.05.2045	53.692	0,02 %
Pioneer Natural Resources Co.	\$ 50.000	4,45 %	15.01.2026	53.538	0,02 %
Board of Trustees of The Leland Stanford Junior University	\$ 50.000	3,65 %	01.05.2048	53.470	0,02 %
Time Warner Cable LLC	\$ 50.000	8,25 %	01.04.2019	53.439	0,02 %
MidAmerican Energy Co.	\$ 50.000	3,95 %	01.08.2047	53.322	0,02 %
Caterpillar, Inc.	\$ 50.000	3,80 %	15.08.2042	53.308	0,02 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 50.000	9,00 %	01.02.2019	53.298	0,02 %
Columbia Pipeline Group, Inc.	\$ 50.000	4,50 %	01.06.2025	53.256	0,02 %
Block Financial LLC	\$ 50.000	5,25 %	01.10.2025	53.218	0,02 %
Anthem, Inc.	\$ 50.000	4,38 %	01.12.2047	53.217	0,02 %
Time Warner, Inc.	\$ 50.000	4,75 %	29.03.2021	53.165	0,02 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 50.000	3,90 %	01.08.2046	53.095	0,02 %
Waste Management, Inc.	\$ 50.000	4,60 %	01.03.2021	53.070	0,02 %
Albemarle Corp.	\$ 50.000	4,15 %	01.12.2024	52.973	0,02 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 50.000	6,35 %	15.10.2045	52.952	0,02 %
Noble Energy, Inc.	\$ 50.000	4,95 %	15.08.2047	52.949	0,02 %
Massachusetts Mutual Life Insurance Co.	\$ 50.000	4,50 %	15.04.2065	52.927	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Boeing Co.	\$ 50.000	4,88 %	15.02.2020	52.815	0,02 %
Western Gas Partners LP	\$ 50.000	5,38 %	01.06.2021	52.766	0,02 %
Dr Pepper Snapple Group, Inc.	\$ 50.000	4,42 %	15.12.2046	52.751	0,02 %
Simon Property Group LP	\$ 50.000	4,25 %	30.11.2046	52.715	0,02 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	\$ 50.000	4,10 %	01.06.2022	52.647	0,02 %
EnLink Midstream Partners LP	\$ 50.000	5,60 %	01.04.2044	52.646	0,02 %
Republic Services, Inc.	\$ 50.000	5,00 %	01.03.2020	52.635	0,02 %
Adobe Systems, Inc.	\$ 50.000	4,75 %	01.02.2020	52.628	0,02 %
Weyerhaeuser Co.	\$ 50.000	4,70 %	15.03.2021	52.613	0,02 %
Nuveen Finance LLC	\$ 50.000	4,13 %	01.11.2024	52.613	0,02 %
S&P Global, Inc.	\$ 50.000	4,00 %	15.06.2025	52.583	0,02 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 50.000	4,40 %	15.10.2022	52.538	0,02 %
Waste Management, Inc.	\$ 50.000	3,90 %	01.03.2035	52.471	0,02 %
CNH Industrial Capital LLC	\$ 50.000	4,88 %	01.04.2021	52.437	0,02 %
Buckeye Partners LP	\$ 50.000	4,88 %	01.02.2021	52.409	0,02 %
General Electric Co.	\$ 50.000	4,13 %	09.10.2042	52.399	0,02 %
Apollo Management Holdings LP	\$ 50.000	4,40 %	27.05.2026	52.356	0,02 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 50.000	4,09 %	15.09.2052	52.346	0,02 %
Viacom, Inc.	\$ 50.000	5,63 %	15.09.2019	52.333	0,02 %
Duke Energy Carolinas LLC	\$ 50.000	3,90 %	15.06.2021	52.258	0,02 %
FirstEnergy Corp.	\$ 50.000	4,25 %	15.03.2023	52.215	0,02 %
Xcel Energy, Inc.	\$ 50.000	4,70 %	15.05.2020	52.171	0,02 %
Enbridge Energy Partners LP	\$ 50.000	4,38 %	15.10.2020	52.162	0,02 %
Time Warner Cable LLC	\$ 50.000	5,00 %	01.02.2020	52.144	0,02 %
Entergy Louisiana LLC	\$ 50.000	4,95 %	15.01.2045	52.125	0,02 %
McDonald's Corp.	\$ 50.000	3,70 %	30.01.2026	52.112	0,02 %
Western Gas Partners LP	\$ 50.000	4,65 %	01.07.2026	51.940	0,02 %
Avnet, Inc.	\$ 50.000	4,63 %	15.04.2026	51.916	0,02 %
Sherwin-Williams Co.	\$ 50.000	3,95 %	15.01.2026	51.903	0,02 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 50.000	3,75 %	15.04.2021	51.853	0,02 %
Mylan, Inc.	\$ 50.000	4,20 %	29.11.2023	51.839	0,02 %
Praxair, Inc.	\$ 50.000	4,50 %	15.08.2019	51.829	0,02 %
Verisk Analytics, Inc.	\$ 50.000	4,00 %	15.06.2025	51.778	0,02 %
Mosaic Co.	\$ 50.000	4,25 %	15.11.2023	51.771	0,01 %
Harris Corp.	\$ 50.000	3,83 %	27.04.2025	51.700	0,01 %
Ingersoll-Rand Luxembourg Finance SA	\$ 50.000	3,55 %	01.11.2024	51.609	0,01 %
Loews Corp.	\$ 50.000	3,75 %	01.04.2026	51.594	0,01 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 50.000	5,38 %	01.05.2047	51.571	0,01 %
Roper Technologies, Inc.	\$ 50.000	3,80 %	15.12.2026	51.553	0,01 %
Regency Centers LP	\$ 50.000	4,40 %	01.02.2047	51.551	0,01 %
Duke Energy Carolinas LLC	\$ 50.000	3,75 %	01.06.2045	51.531	0,01 %
Cboe Global Markets Inc.	\$ 50.000	3,65 %	12.01.2027	51.501	0,01 %
CVS Health Corp.	\$ 50.000	3,88 %	20.07.2025	51.486	0,01 %
El du Pont de Nemours & Co.	\$ 50.000	4,15 %	15.02.2043	51.471	0,01 %
Electronic Arts, Inc.	\$ 50.000	3,70 %	01.03.2021	51.451	0,01 %
EnLink Midstream Partners LP	\$ 50.000	4,40 %	01.04.2024	51.394	0,01 %
Block Financial LLC	\$ 50.000	4,13 %	01.10.2020	51.338	0,01 %
Phillips 66 Partners LP	\$ 50.000	4,68 %	15.02.2045	51.295	0,01 %
Duke Energy Corp.	\$ 50.000	3,95 %	15.08.2047	51.291	0,01 %
3M Co.	\$ 50.000	3,63 %	15.10.2047	51.287	0,01 %
Adobe Systems, Inc.	\$ 50.000	3,25 %	01.02.2025	51.259	0,01 %
Southwestern Electric Power Co.	\$ 50.000	3,90 %	01.04.2045	51.239	0,01 %
Packaging Corp. of America	\$ 50.000	3,65 %	15.09.2024	51.211	0,01 %
PPL Capital Funding, Inc.	\$ 50.000	4,00 %	15.09.2047	51.195	0,01 %
Puget Energy, Inc.	\$ 50.000	3,65 %	15.05.2025	51.186	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 50.000	4,00 %	01.12.2046	51.167	0,01 %
Honeywell International, Inc.	\$ 40.000	5,38 %	01.03.2041	51.139	0,01 %
Total System Services, Inc.	\$ 50.000	3,80 %	01.04.2021	51.125	0,01 %
Cimarex Energy Co.	\$ 50.000	3,90 %	15.05.2027	51.101	0,01 %
Parker-Hannifin Corp.	\$ 50.000	3,30 %	21.11.2024	51.099	0,01 %
Assurant, Inc.	\$ 50.000	4,00 %	15.03.2023	51.094	0,01 %
Marathon Petroleum Corp.	\$ 50.000	3,40 %	15.12.2020	51.087	0,01 %
Comcast Corp.	\$ 50.000	4,05 %	01.11.2052	51.085	0,01 %
CA, Inc.	\$ 50.000	3,60 %	01.08.2020	51.076	0,01 %
Scripps Networks Interactive, Inc.	\$ 50.000	3,90 %	15.11.2024	51.073	0,01 %
Kentucky Utilities Co.	\$ 50.000	3,25 %	01.11.2020	51.046	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Arizona Public Service Co.	\$ 50.000	3,75 %	15.05.2046	51.022	0,01 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	\$ 50.000	3,50 %	15.09.2021	51.000	0,01 %
Newmont Mining Corp.	\$ 50.000	3,50 %	15.03.2022	50.989	0,01 %
Marriott International, Inc.	\$ 50.000	3,38 %	15.10.2020	50.980	0,01 %
eBay, Inc.	\$ 50.000	3,25 %	15.10.2020	50.975	0,01 %
Baltimore Gas & Electric Co.	\$ 50.000	3,35 %	01.07.2023	50.970	0,01 %
PPL Capital Funding, Inc.	\$ 50.000	3,40 %	01.06.2023	50.954	0,01 %
American International Group, Inc.	\$ 50.000	4,38 %	15.01.2055	50.936	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 50.000	4,40 %	01.11.2034	50.930	0,01 %
S&P Global, Inc.	\$ 50.000	3,30 %	14.08.2020	50.930	0,01 %
Baker Hughes a GE Co. LLC	\$ 50.000	3,20 %	15.08.2021	50.916	0,01 %
Exelon Generation Co. LLC	\$ 50.000	3,40 %	15.03.2022	50.912	0,01 %
Corporate Office Properties LP	\$ 50.000	3,70 %	15.06.2021	50.884	0,01 %
Darden Restaurants, Inc.	\$ 50.000	3,85 %	01.05.2027	50.844	0,01 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	\$ 50.000	2,90 %	15.10.2020	50.832	0,01 %
Citrix Systems, Inc.	\$ 50.000	4,50 %	01.12.2027	50.812	0,01 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 50.000	3,10 %	15.01.2023	50.782	0,01 %
Indiana Michigan Power Co.	\$ 50.000	3,75 %	01.07.2047	50.774	0,01 %
Xcel Energy, Inc.	\$ 50.000	3,35 %	01.12.2026	50.753	0,01 %
Applied Materials, Inc.	\$ 50.000	3,30 %	01.04.2027	50.739	0,01 %
Boardwalk Pipelines LP	\$ 50.000	4,45 %	15.07.2027	50.720	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 50.000	3,50 %	15.06.2025	50.707	0,01 %
American Electric Power Co., Inc.	\$ 50.000	2,95 %	15.12.2022	50.703	0,01 %
Scripps Networks Interactive, Inc.	\$ 50.000	3,95 %	15.06.2025	50.662	0,01 %
Interstate Power & Light Co.	\$ 50.000	3,25 %	01.12.2024	50.635	0,01 %
CBS Corp.	\$ 50.000	4,60 %	15.01.2045	50.595	0,01 %
Dominion Energy Gas Holdings LLC	\$ 50.000	3,55 %	01.11.2023	50.591	0,01 %
NSTAR Electric Co.	\$ 50.000	3,20 %	15.05.2027	50.588	0,01 %
AmerisourceBergen Corp.	\$ 50.000	4,30 %	15.12.2047	50.557	0,01 %
Analog Devices, Inc.	\$ 50.000	3,50 %	05.12.2026	50.556	0,01 %
Concho Resources, Inc.	\$ 50.000	3,75 %	01.10.2027	50.500	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 50.000	3,15 %	15.01.2020	50.492	0,01 %
Magellan Midstream Partners LP	\$ 50.000	4,20 %	03.10.2047	50.472	0,01 %
Roper Technologies, Inc.	\$ 50.000	3,13 %	15.11.2022	50.405	0,01 %
Seagate HDD Cayman	\$ 50.000	4,25 %	01.03.2022	50.375	0,01 %
Waste Management, Inc.	\$ 50.000	3,13 %	01.03.2025	50.352	0,01 %
Capital One Financial Corp.	\$ 50.000	3,75 %	09.03.2027	50.327	0,01 %
Fiserv, Inc.	\$ 50.000	2,70 %	01.06.2020	50.327	0,01 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 50.000	4,30 %	20.05.2047	50.300	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 50.000	3,63 %	01.10.2042	50.257	0,01 %
Boeing Co.	\$ 50.000	3,65 %	01.03.2047	50.233	0,01 %
MidAmerican Energy Co.	\$ 50.000	3,10 %	01.05.2027	50.223	0,01 %
Pacific Life Insurance Co.^	\$ 50.000	4,30 %	24.10.2067	50.217	0,01 %
Praxair, Inc.	\$ 50.000	3,55 %	07.11.2042	50.214	0,01 %
CBS Corp.	\$ 50.000	3,50 %	15.01.2025	50.141	0,01 %
Energy Transfer LP	\$ 50.000	3,60 %	01.02.2023	50.126	0,01 %
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.^	\$ 50.000	4,80 %	01.12.2077	50.125	0,01 %
Old Republic International Corp.	\$ 50.000	3,88 %	26.08.2026	50.124	0,01 %
Praxair, Inc.	\$ 50.000	2,45 %	15.02.2022	50.107	0,01 %
Activision Blizzard, Inc.	\$ 50.000	3,40 %	15.06.2027	50.102	0,01 %
Mosaic Co.	\$ 50.000	4,05 %	15.11.2027	50.101	0,01 %
Williams Partners LP	\$ 50.000	3,75 %	15.06.2027	50.100	0,01 %
Hess Corp.	\$ 50.000	4,30 %	01.04.2027	50.094	0,01 %
EOG Resources, Inc.	\$ 50.000	2,45 %	01.04.2020	50.087	0,01 %
Duke Realty LP	\$ 50.000	3,38 %	15.12.2027	50.085	0,01 %
LYB International Finance II BV	\$ 50.000	3,50 %	02.03.2027	50.063	0,01 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 50.000	3,00 %	20.05.2022	50.051	0,01 %
Tech Data Corp.	\$ 50.000	3,70 %	15.02.2022	50.046	0,01 %
Moody's Corp.	\$ 50.000	2,75 %	15.12.2021	50.028	0,01 %
Sempra Energy	\$ 50.000	2,40 %	15.03.2020	50.022	0,01 %
CBS Corp.	\$ 50.000	2,30 %	15.08.2019	50.021	0,01 %
NVIDIA Corp.	\$ 50.000	3,20 %	16.09.2026	50.019	0,01 %
Massachusetts Institute of Technology	\$ 50.000	3,89 %	01.07.2116	50.016	0,01 %
Anthem, Inc.	\$ 50.000	2,95 %	01.12.2022	50.011	0,01 %
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	\$ 50.000	2,25 %	15.01.2019	50.003	0,01 %
Marathon Oil Corp.	\$ 50.000	2,70 %	01.06.2020	49.966	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	\$ 50.000	2,30 %	01.04.2019	49.955	0,01 %
Reliance Standard Life Global Funding II	\$ 50.000	2,50 %	15.01.2020	49.952	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 50.000	2,75 %	15.03.2023	49.915	0,01 %
Eversource Energy	\$ 50.000	2,75 %	15.03.2022	49.891	0,01 %
SunTrust Banks, Inc.	\$ 50.000	2,70 %	27.01.2022	49.862	0,01 %
Public Service Electric & Gas Co.	\$ 50.000	3,00 %	15.05.2027	49.859	0,01 %
Chubb INA Holdings, Inc.	\$ 50.000	2,70 %	13.03.2023	49.843	0,01 %
Florida Power & Light Co.	\$ 50.000	2,75 %	01.06.2023	49.838	0,01 %
ITC Holdings Corp.	\$ 50.000	2,70 %	15.11.2022	49.830	0,01 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 50.000	1,85 %	20.05.2019	49.822	0,01 %
Phillips 66 Partners LP	\$ 50.000	3,75 %	01.03.2028	49.813	0,01 %
SL Green Operating Partnership LP	\$ 50.000	3,25 %	15.10.2022	49.790	0,01 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	\$ 50.000	2,00 %	27.01.2020	49.770	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 50.000	4,27 %	15.01.2036	49.740	0,01 %
Enable Midstream Partners LP	\$ 50.000	2,40 %	15.05.2019	49.724	0,01 %
Amphenol Corp.	\$ 50.000	2,20 %	01.04.2020	49.718	0,01 %
Southern Co.	\$ 50.000	1,85 %	01.07.2019	49.713	0,01 %
CSX Corp.	\$ 50.000	3,80 %	01.11.2046	49.710	0,01 %
Textron, Inc.	\$ 50.000	3,38 %	01.03.2028	49.669	0,01 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	\$ 50.000	2,85 %	27.01.2025	49.669	0,01 %
National Fuel Gas Co.	\$ 50.000	3,95 %	15.09.2027	49.662	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	\$ 50.000	2,60 %	15.12.2019	49.649	0,01 %
AmerisourceBergen Corp.	\$ 50.000	3,45 %	15.12.2027	49.647	0,01 %
Duke Energy Corp.	\$ 50.000	3,15 %	15.08.2027	49.570	0,01 %
eBay, Inc.	\$ 50.000	3,60 %	05.06.2027	49.547	0,01 %
Southern Power Co.	\$ 50.000	2,50 %	15.12.2021	49.526	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC^	\$ 50.000	5,25 %	16.08.2077	49.514	0,01 %
NVIDIA Corp.	\$ 50.000	2,20 %	16.09.2021	49.499	0,01 %
Public Service Enterprise Group, Inc.	\$ 50.000	2,65 %	15.11.2022	49.492	0,01 %
Brandywine Operating Partnership LP	\$ 50.000	3,95 %	15.11.2027	49.457	0,01 %
Moody's Corp.	\$ 50.000	2,63 %	15.01.2023	49.451	0,01 %
Boston Gas Co.	\$ 50.000	3,15 %	01.08.2027	49.410	0,01 %
FirstEnergy Corp.	\$ 50.000	2,85 %	15.07.2022	49.402	0,01 %
Tyco Electronics Group SA	\$ 50.000	3,13 %	15.08.2027	49.361	0,01 %
Ecolab, Inc.	\$ 50.000	2,38 %	10.08.2022	49.333	0,01 %
President & Fellows of Harvard College	\$ 50.000	3,30 %	15.07.2056	49.314	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 50.000	2,38 %	17.08.2022	49.245	0,01 %
Ares Capital Corp.	\$ 50.000	3,50 %	10.02.2023	49.213	0,01 %
Corning, Inc.	\$ 50.000	4,38 %	15.11.2057	49.178	0,01 %
Public Service Co. of Colorado	\$ 50.000	2,25 %	15.09.2022	49.154	0,01 %
Enable Midstream Partners LP	\$ 50.000	5,00 %	15.05.2044	49.107	0,01 %
Duke Energy Corp.	\$ 50.000	2,40 %	15.08.2022	49.086	0,01 %
Waste Management, Inc.	\$ 50.000	2,40 %	15.05.2023	49.022	0,01 %
Seagate HDD Cayman	\$ 50.000	4,75 %	01.01.2025	49.000	0,01 %
Arrow Electronics, Inc.	\$ 50.000	3,25 %	08.09.2024	48.952	0,01 %
Texas Instruments, Inc.	\$ 50.000	1,85 %	15.05.2022	48.795	0,01 %
General Dynamics Corp.	\$ 50.000	2,38 %	15.11.2024	48.787	0,01 %
CBS Corp.	\$ 50.000	2,50 %	15.02.2023	48.694	0,01 %
Xerox Corp.	\$ 50.000	3,63 %	15.03.2023	48.677	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	\$ 50.000	5,15 %	01.06.2042	48.622	0,01 %
MetLife, Inc.	\$ 45.000	4,37 %	15.09.2023	48.521	0,01 %
Apache Corp.	\$ 50.000	4,25 %	15.01.2044	48.459	0,01 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 50.000	2,50 %	20.09.2026	48.452	0,01 %
Honeywell International, Inc.	\$ 50.000	2,50 %	01.11.2026	48.169	0,01 %
Seagate HDD Cayman	\$ 50.000	5,75 %	01.12.2034	48.117	0,01 %
Bemis Co., Inc.	\$ 50.000	3,10 %	15.09.2026	48.093	0,01 %
Boeing Co.	\$ 50.000	1,88 %	15.06.2023	48.083	0,01 %
NIKE, Inc.	\$ 50.000	3,38 %	01.11.2046	48.050	0,01 %
CBS Corp.	\$ 50.000	3,38 %	15.02.2028	48.046	0,01 %
Southwestern Electric Power Co.	\$ 50.000	2,75 %	01.10.2026	48.019	0,01 %
Viacom, Inc.	\$ 50.000	3,45 %	04.10.2026	47.470	0,01 %
University of Southern California	\$ 50.000	3,03 %	01.10.2039	47.104	0,01 %
Synchrony Financial	\$ 45.000	4,50 %	23.07.2025	47.039	0,01 %
TJX Cos, Inc.	\$ 50.000	2,25 %	15.09.2026	46.910	0,01 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	\$ 50.000	2,88 %	15.02.2023	46.747	0,01 %
Target Corp.	\$ 45.000	4,00 %	01.07.2042	46.185	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Guardian Life Insurance Co. of America	\$ 40.000	4,88 %	19.06.2064	45.739	0,01 %
Rockwell Collins, Inc.	\$ 45.000	3,50 %	15.03.2027	45.692	0,01 %
Bed Bath & Beyond, Inc.	\$ 50.000	5,17 %	01.08.2044	44.164	0,01 %
National Oilwell Varco, Inc.	\$ 50.000	3,95 %	01.12.2042	44.104	0,01 %
Boeing Co.	\$ 30.000	6,88 %	15.03.2039	44.057	0,01 %
Dow Chemical Co.	\$ 25.000	9,40 %	15.05.2039	42.632	0,01 %
MetLife, Inc.	\$ 25.000	10,75 %	01.08.2039	41.750	0,01 %
Darden Restaurants, Inc.	\$ 30.000	6,80 %	15.10.2037	40.049	0,01 %
Rockwell Collins, Inc.	\$ 40.000	2,80 %	15.03.2022	40.039	0,01 %
Walt Disney Co.	CAD 50.000	2,76 %	07.10.2024	39.830	0,01 %
RPM International, Inc.	\$ 40.000	4,25 %	15.01.2048	39.771	0,01 %
Expedia, Inc.	\$ 40.000	3,80 %	15.02.2028	38.645	0,01 %
American Financial Group, Inc.	\$ 35.000	4,50 %	15.06.2047	36.143	0,01 %
Tyco Electronics Group SA	\$ 25.000	7,13 %	01.10.2037	35.927	0,01 %
Wyndham Worldwide Corp.	\$ 35.000	4,25 %	01.03.2022	35.607	0,01 %
Anthem, Inc.	\$ 35.000	3,35 %	01.12.2024	35.387	0,01 %
Nevada Power Co.	\$ 25.000	6,75 %	01.07.2037	35.161	0,01 %
WestRock MWV LLC	\$ 25.000	8,20 %	15.01.2030	35.085	0,01 %
American Water Capital Corp.	\$ 25.000	6,59 %	15.10.2037	34.936	0,01 %
International Paper Co.	\$ 25.000	7,30 %	15.11.2039	34.923	0,01 %
Transatlantic Holdings, Inc.	\$ 25.000	8,00 %	30.11.2039	34.320	0,01 %
PacifiCorp	\$ 25.000	6,25 %	15.10.2037	34.213	0,01 %
Wisconsin Power & Light Co.	\$ 25.000	6,38 %	15.08.2037	33.828	0,01 %
Comcast Corp.	\$ 25.000	6,50 %	15.11.2035	33.761	0,01 %
Puget Sound Energy, Inc.	\$ 25.000	6,27 %	15.03.2037	33.647	0,01 %
Interstate Power & Light Co.	\$ 25.000	6,25 %	15.07.2039	33.534	0,01 %
Nordstrom, Inc.	\$ 35.000	5,00 %	15.01.2044	33.510	0,01 %
Caterpillar, Inc.	\$ 25.000	6,05 %	15.08.2036	33.486	0,01 %
General Dynamics Corp.	\$ 34.000	2,25 %	15.11.2022	33.467	0,01 %
Enbridge Energy Partners LP	\$ 25.000	7,38 %	15.10.2045	33.242	0,01 %
Time Warner, Inc.	\$ 30.000	5,35 %	15.12.2043	33.226	0,01 %
S&P Global, Inc.	\$ 25.000	6,55 %	15.11.2037	33.089	0,01 %
Hartford Financial Services Group, Inc.	\$ 25.000	6,10 %	01.10.2041	33.076	0,01 %
Alabama Power Co.	\$ 25.000	6,00 %	01.03.2039	32.800	0,01 %
Public Service Electric & Gas Co.	\$ 25.000	5,80 %	01.05.2037	32.595	0,01 %
Tri-State Generation & Transmission Association, Inc.	\$ 25.000	6,00 %	15.06.2040	32.566	0,01 %
International Business Machines Corp.	\$ 25.000	5,60 %	30.11.2039	32.560	0,01 %
Johnson Controls International plc	\$ 30.000	4,50 %	15.02.2047	32.548	0,01 %
Ford Motor Co.	\$ 25.000	7,45 %	16.07.2031	32.432	0,01 %
Endurance Specialty Holdings Ltd.	\$ 25.000	7,00 %	15.07.2034	31.914	0,01 %
Atmos Energy Corp.	\$ 25.000	5,50 %	15.06.2041	31.631	0,01 %
CBS Corp.	\$ 30.000	4,85 %	01.07.2042	31.534	0,01 %
Ingersoll-Rand Global Holding Co., Ltd.	\$ 25.000	5,75 %	15.06.2043	31.416	0,01 %
QVC, Inc.	\$ 30.000	4,85 %	01.04.2024	31.387	0,01 %
Republic Services, Inc.	\$ 25.000	5,70 %	15.05.2041	31.089	0,01 %
Motiva Enterprises LLC	\$ 25.000	6,85 %	15.01.2040	31.082	0,01 %
KeySpan Corp.	\$ 25.000	5,80 %	01.04.2035	30.739	0,01 %
Unum Group	\$ 25.000	5,75 %	15.08.2042	30.585	0,01 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	\$ 30.000	6,38 %	15.03.2037	30.570	0,01 %
Ford Motor Co.	\$ 25.000	6,63 %	01.10.2028	30.429	0,01 %
ITC Holdings Corp.	\$ 25.000	5,30 %	01.07.2043	30.193	0,01 %
Nucor Corp.	\$ 25.000	5,20 %	01.08.2043	30.121	0,01 %
QVC, Inc.	\$ 30.000	5,45 %	15.08.2034	30.118	0,01 %
Applied Materials, Inc.	\$ 25.000	5,10 %	01.10.2035	30.093	0,01 %
Synchrony Financial	\$ 30.000	2,70 %	03.02.2020	30.065	0,01 %
Moody's Corp.	\$ 25.000	5,25 %	15.07.2044	30.063	0,01 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	\$ 25.000	5,15 %	15.11.2043	30.032	0,01 %
Leggett & Platt, Inc.	\$ 30.000	3,50 %	15.11.2027	29.692	0,01 %
South Carolina Electric & Gas Co.	\$ 25.000	5,45 %	01.02.2041	29.614	0,01 %
Albemarle Corp.	\$ 25.000	5,45 %	01.12.2044	29.540	0,01 %
Oglethorpe Power Corp.	\$ 25.000	5,38 %	01.11.2040	29.351	0,01 %
Harris Corp.	\$ 25.000	5,05 %	27.04.2045	29.338	0,01 %
Caterpillar, Inc.	\$ 25.000	4,75 %	15.05.2064	29.337	0,01 %
American Transmission Systems, Inc.	\$ 25.000	5,00 %	01.09.2044	29.196	0,01 %
CMS Energy Corp.	\$ 25.000	4,88 %	01.03.2044	29.183	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 25.000	4,45 %	03.11.2045	29.134	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Verisk Analytics, Inc.	\$ 25.000	5,50 %	15.06.2045	28.901	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 25.000	4,50 %	23.02.2036	28.612	0,01 %
Piedmont Natural Gas Co., Inc.	\$ 25.000	4,65 %	01.08.2043	28.573	0,01 %
South Carolina Electric & Gas Co.	\$ 25.000	5,10 %	01.06.2065	28.506	0,01 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 25.000	4,70 %	01.12.2044	28.387	0,01 %
Arizona Public Service Co.	\$ 25.000	4,50 %	01.04.2042	28.123	0,01 %
Westlake Chemical Corp.	\$ 25.000	5,00 %	15.08.2046	28.070	0,01 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	\$ 25.000	4,50 %	01.02.2045	28.017	0,01 %
Alabama Power Co.	\$ 25.000	4,30 %	02.01.2046	27.864	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 25.000	4,38 %	15.05.2055	27.835	0,01 %
Duquesne Light Holdings, Inc.	\$ 25.000	5,90 %	01.12.2021	27.681	0,01 %
American Water Capital Corp.	\$ 25.000	4,30 %	01.09.2045	27.632	0,01 %
Puget Energy, Inc.	\$ 25.000	6,50 %	15.12.2020	27.565	0,01 %
Eastman Chemical Co.	\$ 25.000	4,80 %	01.09.2042	27.559	0,01 %
Cleco Corporate Holdings LLC	\$ 25.000	4,97 %	01.05.2046	27.548	0,01 %
Southern Natural Gas Co. LLC	\$ 25.000	4,80 %	15.03.2047	27.537	0,01 %
Guardian Life Insurance Co. of America	\$ 25.000	4,85 %	24.01.2077	27.453	0,01 %
Electronic Arts, Inc.	\$ 25.000	4,80 %	01.03.2026	27.411	0,01 %
Exelon Generation Co. LLC	\$ 25.000	5,60 %	15.06.2042	27.350	0,01 %
CMS Energy Corp.	\$ 25.000	5,05 %	15.03.2022	27.104	0,01 %
Harley-Davidson, Inc.	\$ 25.000	4,63 %	28.07.2045	27.089	0,01 %
Rockwell Collins, Inc.	\$ 25.000	4,35 %	15.04.2047	27.075	0,01 %
Parker-Hannifin Corp.	\$ 25.000	4,20 %	21.11.2034	27.070	0,01 %
PacifiCorp	\$ 25.000	4,10 %	01.02.2042	27.070	0,01 %
KLA-Tencor Corp.	\$ 25.000	4,65 %	01.11.2024	27.040	0,01 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 25.000	4,80 %	20.05.2045	27.025	0,01 %
Mosaic Co.	\$ 25.000	5,45 %	15.11.2033	27.010	0,01 %
HP, Inc.	\$ 25.000	6,00 %	15.09.2041	26.977	0,01 %
S&P Global, Inc.	\$ 25.000	4,40 %	15.02.2026	26.954	0,01 %
Consumers Energy Co.	\$ 25.000	3,95 %	15.07.2047	26.946	0,01 %
Western Union Co.	\$ 25.000	6,20 %	17.11.2036	26.934	0,01 %
Southern California Edison Co.	\$ 25.000	4,00 %	01.04.2047	26.875	0,01 %
Alleghany Corp.	\$ 25.000	5,63 %	15.09.2020	26.851	0,01 %
Georgia Power Co.	\$ 25.000	4,30 %	15.03.2042	26.826	0,01 %
DTE Electric Co.	\$ 25.000	4,00 %	01.04.2043	26.805	0,01 %
Parker-Hannifin Corp.	\$ 25.000	4,10 %	01.03.2047	26.803	0,01 %
Consumers Energy Co.	\$ 25.000	6,70 %	15.09.2019	26.752	0,01 %
AXIS Specialty Finance LLC	\$ 25.000	5,88 %	01.06.2020	26.726	0,01 %
Xerox Corp.	\$ 25.000	6,75 %	15.12.2039	26.688	0,01 %
Fortive Corp.	\$ 25.000	4,30 %	15.06.2046	26.650	0,01 %
Applied Materials, Inc.	\$ 25.000	3,90 %	01.10.2025	26.554	0,01 %
DXC Technology Co.	\$ 25.000	4,75 %	15.04.2027	26.551	0,01 %
Aspen Insurance Holdings Ltd.	\$ 25.000	4,65 %	15.11.2023	26.546	0,01 %
Comcast Corp.	\$ 25.000	5,15 %	01.03.2020	26.543	0,01 %
Applied Materials, Inc.	\$ 25.000	4,30 %	15.06.2021	26.525	0,01 %
Entergy Louisiana LLC	\$ 25.000	4,05 %	01.09.2023	26.484	0,01 %
International Flavors & Fragrances, Inc.	\$ 25.000	4,38 %	01.06.2047	26.461	0,01 %
Entergy Corp.	\$ 25.000	5,13 %	15.09.2020	26.421	0,01 %
Trinity Health Corp.	\$ 25.000	4,13 %	01.12.2045	26.420	0,01 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	\$ 25.000	4,02 %	01.11.2032	26.399	0,01 %
Bemis Co., Inc.	\$ 25.000	4,50 %	15.10.2021	26.354	0,01 %
Dover Corp.	\$ 25.000	4,30 %	01.03.2021	26.347	0,01 %
Southern California Edison Co.	\$ 25.000	3,90 %	15.03.2043	26.304	0,01 %
Crown Castle International Corp.	\$ 25.000	4,75 %	15.05.2047	26.290	0,01 %
Time Warner, Inc.	\$ 25.000	4,90 %	15.06.2042	26.270	0,01 %
Southern Co.	\$ 25.000	4,25 %	01.07.2036	26.268	0,01 %
CenterPoint Energy Resources Corp.	\$ 25.000	4,10 %	01.09.2047	26.263	0,01 %
Tech Data Corp.	\$ 25.000	4,95 %	15.02.2027	26.244	0,01 %
San Diego Gas & Electric Co.	\$ 25.000	3,75 %	01.06.2047	26.218	0,01 %
Activision Blizzard, Inc.	\$ 25.000	4,50 %	15.06.2047	26.200	0,01 %
Discovery Communications LLC	\$ 25.000	5,20 %	20.09.2047	26.191	0,01 %
United Technologies Corp.	\$ 25.000	4,05 %	04.05.2047	26.172	0,01 %
Alphabet, Inc.	\$ 25.000	3,63 %	19.05.2021	26.149	0,01 %
Alphabet, Inc.	\$ 25.000	3,38 %	25.02.2024	26.130	0,01 %
CenterPoint Energy Resources Corp.	\$ 25.000	4,50 %	15.01.2021	26.128	0,01 %
Entergy Corp.	\$ 25.000	4,00 %	15.07.2022	26.112	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
KLA-Tencor Corp.	\$ 25.000	4,13 %	01.11.2021	26.088	0,01 %
Verisk Analytics, Inc.	\$ 25.000	4,13 %	12.09.2022	26.071	0,01 %
DXC Technology Co.	\$ 25.000	4,25 %	15.04.2024	26.028	0,01 %
Fiserv, Inc.	\$ 25.000	3,85 %	01.06.2025	26.006	0,01 %
Monsanto Co.	\$ 25.000	4,70 %	15.07.2064	26.002	0,01 %
Honeywell International, Inc.	\$ 25.000	3,35 %	01.12.2023	26.000	0,01 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	\$ 25.000	3,80 %	30.09.2047	25.983	0,01 %
Eastman Chemical Co.	\$ 25.000	3,80 %	15.03.2025	25.982	0,01 %
Fidelity National Information Services, Inc.	\$ 25.000	4,50 %	15.08.2046	25.970	0,01 %
Commonwealth Edison Co.	\$ 25.000	3,75 %	15.08.2047	25.940	0,01 %
Honeywell International, Inc.	\$ 20.000	5,70 %	15.03.2036	25.938	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 25.000	3,80 %	15.09.2047	25.936	0,01 %
Oklahoma Gas & Electric Co.	\$ 25.000	3,85 %	15.08.2047	25.929	0,01 %
CA, Inc.	\$ 25.000	4,70 %	15.03.2027	25.897	0,01 %
SCANA Corp.	\$ 25.000	4,75 %	15.05.2021	25.883	0,01 %
Niagara Mohawk Power Corp.	\$ 25.000	3,51 %	01.10.2024	25.840	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 25.000	3,50 %	15.03.2027	25.826	0,01 %
Loews Corp.	\$ 25.000	4,13 %	15.05.2043	25.764	0,01 %
First American Financial Corp.	\$ 25.000	4,60 %	15.11.2024	25.764	0,01 %
Fiserv, Inc.	\$ 25.000	3,50 %	01.10.2022	25.733	0,01 %
Nordstrom, Inc.	\$ 25.000	4,00 %	15.10.2021	25.711	0,01 %
American Water Capital Corp.	\$ 25.000	3,40 %	01.03.2025	25.676	0,01 %
American Water Capital Corp.	\$ 25.000	3,75 %	01.09.2047	25.655	0,01 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 25.000	4,05 %	15.09.2042	25.655	0,01 %
EOG Resources, Inc.	\$ 25.000	3,90 %	01.04.2035	25.654	0,01 %
Tyco Electronics Group SA	\$ 25.000	3,45 %	01.08.2024	25.630	0,01 %
Baltimore Gas & Electric Co.	\$ 25.000	3,75 %	15.08.2047	25.616	0,01 %
ITC Holdings Corp.	\$ 25.000	3,65 %	15.06.2024	25.615	0,01 %
ERAC USA Finance LLC	\$ 25.000	4,50 %	15.02.2045	25.612	0,01 %
Motorola Solutions, Inc.	\$ 25.000	4,00 %	01.09.2024	25.595	0,01 %
John Sevier Combined Cycle Generation LLC	\$ 23.059	4,63 %	15.01.2042	25.527	0,01 %
South Carolina Electric & Gas Co.	\$ 25.000	4,10 %	15.06.2046	25.492	0,01 %
Ameren Corp.	\$ 25.000	3,65 %	15.02.2026	25.485	0,01 %
Alabama Power Co.	\$ 25.000	3,70 %	01.12.2047	25.483	0,01 %
Vulcan Materials Co.	\$ 25.000	4,50 %	15.06.2047	25.478	0,01 %
Ameren Illinois Co.	\$ 25.000	3,25 %	01.03.2025	25.473	0,01 %
Alabama Power Co.	\$ 25.000	3,75 %	01.03.2045	25.455	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	\$ 25.000	4,50 %	15.12.2026	25.452	0,01 %
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	\$ 25.000	3,55 %	01.05.2027	25.448	0,01 %
NiSource Finance Corp.	\$ 25.000	3,49 %	15.05.2027	25.431	0,01 %
Exelon Corp.	\$ 25.000	3,50 %	01.06.2022	25.391	0,01 %
Texas Instruments, Inc.	\$ 25.000	2,75 %	12.03.2021	25.325	0,01 %
General Dynamics Corp.	\$ 25.000	3,60 %	15.11.2042	25.313	0,01 %
Scripps Networks Interactive, Inc.	\$ 25.000	3,50 %	15.06.2022	25.304	0,01 %
TJX Cos, Inc.	\$ 25.000	2,75 %	15.06.2021	25.301	0,01 %
Andeavor	\$ 25.000	4,50 %	01.04.2048	25.276	0,01 %
Duke Energy Florida LLC	\$ 25.000	3,20 %	15.01.2027	25.265	0,01 %
Applied Materials, Inc.	\$ 25.000	2,63 %	01.10.2020	25.262	0,01 %
Maxim Integrated Products, Inc.	\$ 25.000	3,38 %	15.03.2023	25.261	0,01 %
RPM International, Inc.	\$ 25.000	3,75 %	15.03.2027	25.243	0,01 %
PacifiCorp	\$ 25.000	2,95 %	01.06.2023	25.231	0,01 %
Consumers Energy Co.	\$ 25.000	2,85 %	15.05.2022	25.231	0,01 %
Mount Sinai Hospitals Group, Inc.	\$ 25.000	3,98 %	01.07.2048	25.225	0,01 %
Parker-Hannifin Corp.	\$ 25.000	3,25 %	01.03.2027	25.208	0,01 %
Southwest Gas Corp.	\$ 25.000	3,80 %	29.09.2046	25.201	0,01 %
Motorola Solutions, Inc.	\$ 25.000	5,50 %	01.09.2044	25.197	0,01 %
Xilinx, Inc.	\$ 25.000	3,00 %	15.03.2021	25.194	0,01 %
Voya Financial, Inc.	\$ 25.000	3,65 %	15.06.2026	25.173	0,01 %
University of Notre Dame du Lac	\$ 25.000	3,39 %	15.02.2048	25.143	0,01 %
Amphenol Corp.	\$ 25.000	3,20 %	01.04.2024	25.106	0,01 %
Cleco Corporate Holdings LLC	\$ 25.000	3,74 %	01.05.2026	25.103	0,01 %
DXC Technology Co.	\$ 25.000	2,88 %	27.03.2020	25.100	0,01 %
Andeavor	\$ 25.000	3,80 %	01.04.2028	25.055	0,01 %
Georgia Power Co.	\$ 25.000	3,25 %	30.03.2027	25.030	0,01 %
Ameren Corp.	\$ 25.000	2,70 %	15.11.2020	25.021	0,01 %
ITC Holdings Corp.	\$ 25.000	3,35 %	15.11.2027	25.011	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Westar Energy, Inc.	\$ 25.000	3,10 %	01.04.2027	25.010	0,01 %
Interstate Power & Light Co.	\$ 25.000	3,70 %	15.09.2046	24.983	0,01 %
EnLink Midstream Partners LP	\$ 25.000	2,70 %	01.04.2019	24.980	0,01 %
Cigna Corp.	\$ 25.000	3,88 %	15.10.2047	24.960	0,01 %
Xcel Energy, Inc.	\$ 25.000	2,60 %	15.03.2022	24.946	0,01 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	\$ 25.000	2,40 %	25.04.2022	24.895	0,01 %
Duquesne Light Holdings, Inc.	\$ 25.000	3,62 %	01.08.2027	24.882	0,01 %
Arrow Electronics, Inc.	\$ 25.000	3,88 %	12.01.2028	24.857	0,01 %
Southern Co.	\$ 25.000	2,95 %	01.07.2023	24.856	0,01 %
Alabama Power Co.	\$ 25.000	2,45 %	30.03.2022	24.835	0,01 %
Texas Instruments, Inc.	\$ 25.000	2,63 %	15.05.2024	24.826	0,01 %
Xilinx, Inc.	\$ 25.000	2,95 %	01.06.2024	24.820	0,01 %
Atmos Energy Corp.	\$ 25.000	3,00 %	15.06.2027	24.808	0,01 %
Analog Devices, Inc.	\$ 25.000	2,50 %	05.12.2021	24.792	0,01 %
NetApp, Inc.	\$ 25.000	2,00 %	27.09.2019	24.792	0,01 %
John Deere Capital Corp.	\$ 25.000	1,95 %	22.06.2020	24.792	0,01 %
Texas Instruments, Inc.	\$ 25.000	2,90 %	03.11.2027	24.779	0,01 %
Eversource Energy	\$ 25.000	2,90 %	01.10.2024	24.772	0,01 %
Sempra Energy	\$ 25.000	3,25 %	15.06.2027	24.770	0,01 %
NetApp, Inc.	\$ 25.000	3,30 %	29.09.2024	24.754	0,01 %
American Water Capital Corp.	\$ 25.000	2,95 %	01.09.2027	24.747	0,01 %
Athene Global Funding	\$ 25.000	3,00 %	01.07.2022	24.736	0,01 %
Commonwealth Edison Co.	\$ 25.000	2,95 %	15.08.2027	24.701	0,01 %
Guardian Life Global Funding	\$ 25.000	2,50 %	08.05.2022	24.680	0,01 %
Moody's Corp.	\$ 25.000	3,25 %	15.01.2028	24.653	0,01 %
CenterPoint Energy, Inc.	\$ 25.000	2,50 %	01.09.2022	24.572	0,01 %
AEP Texas, Inc.	\$ 25.000	2,40 %	01.10.2022	24.542	0,01 %
Black Hills Corp.	\$ 25.000	3,15 %	15.01.2027	24.394	0,01 %
Edison International	\$ 25.000	2,40 %	15.09.2022	24.266	0,01 %
San Diego Gas & Electric Co.	\$ 25.000	2,50 %	15.05.2026	24.001	0,01 %
DTE Energy Co.	\$ 25.000	2,85 %	01.10.2026	23.977	0,01 %
Ecolab, Inc.	\$ 25.000	2,70 %	01.11.2026	23.962	0,01 %
eBay, Inc.	\$ 25.000	4,00 %	15.07.2042	22.967	0,01 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	\$ 20.000	6,90 %	01.04.2029	21.128	0,01 %
Bed Bath & Beyond, Inc.	\$ 20.000	4,92 %	01.08.2034	18.065	0,01 %
CMS Energy Corp.	\$ 16.000	8,75 %	15.06.2019	17.378	0,00 %
Southern California Edison Co.	\$ 16.071	1,85 %	01.02.2022	15.713	0,00 %
Vulcan Materials Co.	\$ 15.000	3,90 %	01.04.2027	15.333	0,00 %
Branch Banking & Trust Co.	\$ 15.000	2,25 %	01.06.2020	14.983	0,00 %
Packaging Corp. of America	\$ 10.000	3,40 %	15.12.2027	10.021	0,00 %
Packaging Corp. of America	\$ 10.000	2,45 %	15.12.2020	10.014	0,00 %
US Treasury Bond ¹	\$ 10.000	2,75 %	15.08.2047	10.009	0,00 %
Ecolab, Inc.	\$ 7.000	5,50 %	08.12.2041	8.753	0,00 %
				192.734.531	56,54 %
Summe Anleihen				334.250.908	98,05 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				334.250.908	98,05 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures 0,00 %				
US Lond Bond März 2018	10	1.516.875	13.125	0,00 %
US 10-Year Note März 2018	(9)	(1.119.812)	3.391	0,00 %
US 5-Year Note März 2018	(23)	(2.674.568)	2.794	0,00 %
AUS 10-Year Bond Futures März 2018	(3)	(305.341)	2.279	0,00 %
US Ultra Bond März 2018	(4)	(672.375)	1.750	0,00 %
US 10-Year Ultra Futures März 2018	(2)	(267.944)	819	0,00 %
Euro-Bobl Futures März 2018	1	159.190	(1.153)	(0,00 %)
AUS 3-Year Bond Futures März 2018	9	785.419	(3.370)	(0,00 %)
Can 10-Year Bond Futures März 2018	8	873.139	(12.578)	(0,00 %)
			7.057	0,00 %

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf- betrag)	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte (0,19 %)							
USD	4.745.277	JPY	(530.000.000)	BNP Paribas	05.01.2018	39.949	0,01 %
USD	18.298.022	GBP	(13.500.000)	BNP Paribas	03.01.2018	35.899	0,01 %
JPY	530.000.000	USD	(4.704.838)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	491	0,00 %
EUR	1.600.000	USD	(1.924.640)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	297	0,00 %
USD	1.486.076	AUD	(1.900.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(38)	(0,00 %)
USD	9.182.370	CAD	(11.500.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(293)	(0,00 %)
USD	4.711.069	JPY	(530.000.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(880)	(0,00 %)
USD	133.858	GBP	(100.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(1.417)	(0,00 %)
USD	18.414.264	GBP	(13.600.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(2.641)	(0,00 %)
USD	1.194.970	EUR	(1.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(5.830)	(0,00 %)
USD	310.657	CAD	(400.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(8.590)	(0,00 %)
USD	81.677.929	EUR	(67.900.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(11.589)	(0,01 %)
USD	1.187.577	EUR	(1.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(13.223)	(0,01 %)
USD	1.442.180	AUD	(1.900.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(43.905)	(0,01 %)
USD	8.620.723	CAD	(11.100.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(238.369)	(0,07 %)
USD	78.748.523	EUR	(65.900.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(384.211)	(0,11 %)
						(634.350)	(0,19 %)
Offene Devisenterminkontrakte zu Absicherungszwecken auf Ebene der Anteilsklasse (0,17 %)							
GBP	251.152.649	USD	(340.058.175)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	48.763	0,02 %
GBP	783.424	USD	(1.050.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	9.777	0,00 %
GBP	2.257.537	USD	(3.050.000)	BNP Paribas	03.01.2018	3.882	0,00 %
GBP	290.540	USD	(390.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	3.027	0,00 %
GBP	244.523	USD	(330.000)	BNP Paribas	03.01.2018	779	0,00 %
GBP	1.647.112	USD	(2.230.000)	BNP Paribas	02.02.2018	493	0,00 %
USD	340.058.175	GBP	(251.382.868)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	50	0,00 %
GBP	476.520	USD	(644.612)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	—	0,00 %
USD	1.030.000	GBP	(760.731)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(171)	(0,00 %)
USD	392.374	GBP	(292.421)	BNP Paribas	03.01.2018	(3.198)	(0,00 %)
GBP	5.643.720	USD	(7.650.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(15.459)	(0,00 %)
GBP	241.979.026	USD	(327.980.549)	BNP Paribas	03.01.2018	(643.470)	(0,19 %)
						(595.527)	(0,17 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente						(1.222.820)	(0,36 %)
						Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva						7.885.664	2,31 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)						340.913.752	100,00 %
							% des Gesamt- US-Dollar (\$) nettovermögens
Analyse des Gesamtvermögens							
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind						250.389.549	73,45 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						74.317.375	21,80 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						9.543.984	2,80 %
(d) Derivative Finanzinstrumente						(1.222.820)	(0,36 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva						7.885.664	2,31 %
Gesamtnettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)						340.913.752	100,00 %

[^] Zinsvariable Anleihe (FRN). Der Effektivzins zum 31. Dezember 2017.

¹ Bezeichnet Wertpapiere, die vollständig oder teilweise als Sicherheiten für offene Derivate verpfändet wurden.

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017¹

	Kapital	Kosten US-Dollar (\$)		Kapital	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
US Treasury Note 1,75 % 30.11.2019	\$ 1.225.000	1.223.952	US Treasury Note 2,25 % 15.11.2027	\$ 1.185.000	1.173.352
US Treasury Note 2,25 % 15.11.2027	\$ 1.185.000	1.173.818	United Kingdom Gilt 0,75 % 22.07.2023	£ 400.000	521.799
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd. 1,39 % 31.5.2022	¥ 100.000.000	933.198	US Treasury Bond 2,75 % 15.8.2047	\$ 410.500	409.909
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. 2,65 % 1.2.2021	\$ 900.000	909.351	Commonwealth Bank of Australia 1,75 % 7.11.2019	\$ 310.000	306.894
Panasonic Corp. 0,57 % 18.3.2022	¥ 100.000.000	898.630	UBS AG 2,20 % 8.6.2020	\$ 300.000	299.100
Japan Government Bond 0,10 % 15.9.2019	¥ 100.000.000	880.803	Macquarie Group Ltd. 6,00 % 14.1.2020	\$ 250.000	267.445
Abbott Laboratories 2,90 % 30.11.2021	\$ 800.000	809.032	US Treasury Note 2,00 % 30.11.2022	\$ 250.000	248.377
AbbVie, Inc. 4,50 % 14.5.2035	\$ 600.000	639.909	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4,44 % 6.10.2048	\$ 225.000	239.855
PepsiCo, Inc. 3,60 % 1.3.2024	\$ 600.000	631.080	Caterpillar Financial Services Corp. 1,85 % 4.9.2020	\$ 225.000	222.775
Bank of America Corp. 2,60 % 15.1.2019	\$ 600.000	604.080	Constellation Brands, Inc. 4,50 % 9.5.2047	\$ 200.000	216.075
Japan Government Bond 0,10 % 20.9.2022	¥ 65.000.000	575.409	General Motors Financial Co., Inc. 3,15 % 15.1.2020	\$ 200.000	202.304
Coca-Cola Co. 1,38 % 30.5.2019	\$ 550.000	546.811	FedEx Corp. 2,30 % 1.2.2020	\$ 200.000	199.272
Cooperatieve Rabobank UA 3,95 % 9.11.2022	\$ 500.000	524.085	British Telecommunications plc 5,75 % 7.12.2028	£ 100.000	172.888
Bank of America Corp. 3,88 % 1.8.2025	\$ 500.000	520.640	Protective Life Global Funding 2,62 % 22.8.2022	\$ 175.000	172.646
United Kingdom Gilt 0,75 % 22.07.2023	£ 400.000	519.581	American Campus Communities Operating Partnership LP 4,13 % 1.7.2024	\$ 150.000	156.501
UBS Group Funding Switzerland AG 3,49 % 23.5.2023	\$ 500.000	512.950	Merck & Co., Inc. 1,85 % 10.2.2020	\$ 150.000	149.243
Medtronic, Inc. 2,50 % 15.3.2020	\$ 500.000	505.713	Commonwealth Bank of Australia 2,25 % 7.12.2018	£ 100.000	135.598
Citigroup, Inc. 2,05 % 7.6.2019	\$ 500.000	498.915	AbbVie, Inc. 4,50 % 14.5.2035	\$ 125.000	134.656
CK Hutchison International 17 II Ltd. 2,75 % 29.3.2023	\$ 500.000	496.070	Sherwin-Williams Co. 4,20 % 15.1.2022	\$ 125.000	131.000
Mizuho Financial Group, Inc. 2,27 % 13.9.2021	\$ 500.000	491.585	BNP Paribas SA 1,63 % 23.2.2026	€ 100.000	125.139
			CRH Finland Services OYJ 2,75 % 15.10.2020	€ 100.000	124.733
			SANEF SA 1,88 % 16.3.2026	€ 100.000	124.519
			ING Bank NV 3,50 % 21.11.2023	€ 100.000	122.433
			RCI Banque SA 1,63 % 11.4.2025	€ 100.000	122.273
			Gecina SA 2,00 % 30.6.2032	€ 100.000	121.242
			APRR SA 1,63 % 13.1.2032	€ 100.000	119.306
			Gas Natural Capital Markets SA 1,13 % 11.4.2024	€ 100.000	118.997
			Newell Brands, Inc. 5,38 % 1.4.2036	\$ 100.000	116.220
			General Motors Financial Co., Inc. 5,25 % 1.3.2026	\$ 100.000	109.502
			Intel Corp. 4,10 % 11.5.2047	\$ 100.000	109.425
			Pfizer, Inc. 4,00 % 15.12.2036	\$ 100.000	108.858
			Coca-Cola Co. 1,10 % 2.9.2036	€ 100.000	107.883
			Kraft Heinz Foods Co. 5,00 % 4.6.2042	\$ 100.000	106.505
			Macquarie Bank Ltd. 3,90 % 15.1.2026	\$ 100.000	104.145
			Burlington Northern Santa Fe LLC 3,45 % 15.9.2021	\$ 100.000	103.595
			American International Group, Inc. 3,38 % 15.8.2020	\$ 100.000	102.379
			Tencent Holdings Ltd. 3,38 % 2.5.2019	\$ 100.000	101.420

1 Der Fonds wurde am 2. November 2017 aufgelegt.

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden.

Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017
Umlaufvermögen	
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	334.250.908
Derivative Finanzinstrumente	167.565
Barmittel und liquide Vermögenswerte	5.475.619
Forderungen:	
Zinsen und Dividenden	3.294.254
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	4.329
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	21.528
Summe Umlaufvermögen	343.214.203
Kurzfristige Passiva	
Derivative Finanzinstrumente	1.390.385
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	441
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:	
Erworbene Kapitalanlagen	860.510
An Broker zu zahlende Bareinschüsse	14.661
Zahlbare Verwaltungsgebühren	34.454
Summe kurzfristige Passiva	2.300.451
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	340.913.752

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹
Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in USD (\$)	
Nettovermögen	5.019
Anzahl der umlaufenden Anteile	50
Nettoinventarwert je Anteil	100,38
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP (£)	
Gegenwert in US (\$)	340.753.835
Nettovermögen	251.897.133
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.503.451
Nettoinventarwert je Anteil	100,62
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in GBP (£)	
Gegenwert in US (\$)	154.898
Nettovermögen	114.506
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.138
Nettoinventarwert je Anteil	100,62

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Berichtszeitraum bis zum 31. Dezember 2017 ¹
Anlageerträge/(-verluste)	
Zinserträge	1.159.927
Verschiedene Erträge	22.796
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	10.832.873
Summe Anlageerträge/(-verluste)	12.015.596
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühren	58.653
Transaktionsgebühren und Provisionen	1.973
Sonstige Aufwendungen	55
Summe Aufwendungen	60.681
Finanzierungskosten	
Zinsaufwand	2.746
Summe Finanzierungskosten	2.746
Nettoanlageerträge/(-verluste)	11.952.169
Ausländische Quellensteuer	(16.545)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	11.935.624

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer
gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Berichtszeitraum bis zum 31. Dezember 2017 ¹
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens	
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	11.935.624
Kapitalgeschäfte	
Zeichnungen	328.978.796
Rücknahmen	(668)
Summe Kapitalgeschäfte	328.978.128
Gesamtsteigerung/(-minderung) für den Zeitraum	340.913.752
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	
Zu Beginn des Berichtszeitraums	—
Ende des Berichtszeitraums	340.913.752

¹ Der Fonds wurde am 2. November 2017 aufgelegt.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Berichtszeitraums verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für den Berichtszeitraum beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Global Credit Bond Fund

Verwaltet durch The Vanguard Group, Inc.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Dieser Fonds zielt darauf ab, moderate und nachhaltige laufende Erträge zu erzielen, indem er in ein diversifiziertes Portfolio aus weltweiten festverzinslichen Anleihen investiert.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	347	13.352
Rendite auf Endfälligkeit	2,8 % ³	2,4 %
Durchschnittlicher Kupon	3,7 %	3,4 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	8,1 Jahre	8,8 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	A3	A3
Durchschnittliche Duration	6,6 Jahre	6,5 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Thesaurierungsanteile	0,30 %	
Anlegeranteile Thesaurierungsanteile	0,35 %	
Kurzfristige Reserven	0,8 %	—

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds
Industriegüter	27,9 %
Finanzinstitute	27,8
Behörden	8,7
Staatlich	7,2
Supranationale Anleihen	6,7
Versorger	4,8
Forderungsbesicherte Wertpapiere	4,3
Barmittel	3,5
Lokale Behörde	3,4
Commercial Mortgage-Backed Security	2,0
Treasury/Federal	1,9
Sonstige	1,3
Provincials/Municipals	0,5

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	9,8 %
Aa	14,4
A	30,4
Baa	40,8
Weniger als Baa	3,7
nicht eingestuft	0,9

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	38,3 %
5-10 Jahre	40,8
Mehr als 10 Jahre	20,9

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit

Durchschnittliche Fälligkeit	Kurz	Mittel	Lang
Kreditqualität Staats-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index Hedged.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen. Der Fonds wird aktiv verwaltet und strebt eine Anlage gemäss der Beschreibung im Prospekt an. Die folgenden Performanceangaben zeigen den Vergleich der Rendite des Fonds mit der Rendite einer Benchmark, deren Anlagemerkmale mit denen des Fonds vergleichbar sind.

Global Credit Bond Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index Hedged

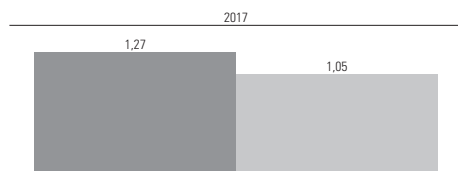
Abgesichert in US-Dollar

	Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017 Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in USD	1,27 %	\$ 5.063.625
Benchmark	1,05	5.052.577

	Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017 Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von \$ 100.000
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in USD	1,26 %	\$ 101.257
Benchmark	1,05	101.052

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,22 Prozentpunkte für in USD abgesicherte institutionelle Thesaurierungsanteile und 0,21 Prozentpunkte für in USD abgesicherte thesaurierende Anlegeranteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 14. September 2017–31. Dezember 2017



	Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in USD
	Benchmark

¹ 14. September 2017.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

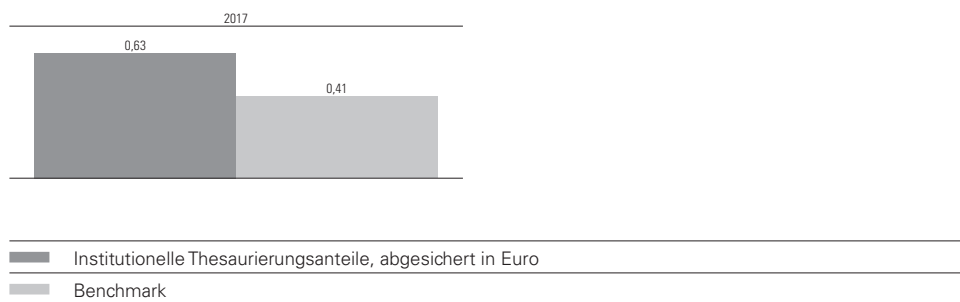
Global Credit Bond Fund
Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index Euro-Hedged

Abgesichert in Euro

	Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017 Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von € 5.000.000
Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in Euro	0,63 %	€ 5.031.610
Benchmark	0,41	5.020.573

Der Tracking-Unterschied für den Zeitraum betrug 0,22 Prozentpunkte für in Euro abgesicherte institutionelle Thesaurierungsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 14. September 2017–31. Dezember 2017



¹ 14. September 2017.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

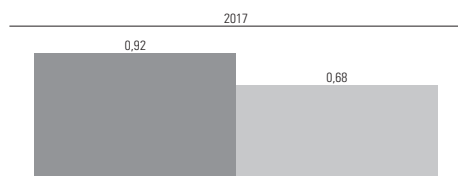
Global Credit Bond Fund
Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index Hedged

Abgesichert in GBP

	Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017 Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von £ 100.000
Thesaurierende Anlegeteile, abgesichert in GBP	0,92 %	£ 100.917
Benchmark	0,68	100.681

Der Tracking-Unterschied für den Zeitraum betrug 0,24 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte thesaurierende Anlegeteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 14. September 2017–31. Dezember 2017



■ Thesaurierende Anlegeteile, abgesichert in GBP
 ■ Benchmark

¹ 14. September 2017.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 95,77 %					
Argentinien 0,84 %					
Argentine Republic Government International Bond	€ 250.000	3,38 %	15.01.2023	306.036	0,51 %
YPF SA	\$ 200.000	7,00 %	15.12.2047	199.000	0,33 %
				505.036	0,84 %
Australien 3,25 %					
Macquarie Group Ltd.	AUD 500.000	4,15 %	15.12.2027	386.120	0,64 %
Westpac Banking Corp.	AUD 400.000	3,82 %	14.03.2024	316.807	0,53 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 250.000	4,50 %	09.12.2025	261.109	0,44 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 250.000	2,40 %	07.12.2021	248.469	0,41 %
DBNGP Finance Co. Pty Ltd.	AUD 250.000	6,00 %	11.10.2019	202.356	0,34 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 200.000	2,50 %	18.09.2022	197.848	0,33 %
Qantas Airways Ltd.	AUD 200.000	7,50 %	11.06.2021	176.467	0,29 %
Commonwealth Bank of Australia	AUD 200.000	3,65 %	05.11.2024	159.140	0,27 %
				1.948.316	3,25 %
Belgien 1,00 %					
Dexia Credit Local SA	\$ 600.000	1,88 %	28.03.2019	597.006	1,00 %
				597.006	1,00 %
Bermuda 1,69 %					
Enstar Group Ltd.	\$ 600.000	4,50 %	10.03.2022	612.000	1,02 %
Bermuda Government International Bond	\$ 400.000	3,72 %	25.01.2027	400.144	0,67 %
				1.012.144	1,69 %
Brasilien 0,18 %					
Embraer Netherlands Finance BV	\$ 100.000	5,40 %	01.02.2027	107.845	0,18 %
				107.845	0,18 %
Kanada 6,26 %					
Province Ontario Kanada	\$ 1.500.000	1,25 %	17.06.2019	1.481.749	2,47 %
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust	\$ 400.000	3,88 %	20.03.2027	408.404	0,68 %
CDP Financial, Inc.	\$ 350.000	4,40 %	25.11.2019	364.118	0,61 %
Province Ontario Kanada	\$ 300.000	4,40 %	14.04.2020	314.327	0,52 %
Bank of Nova Scotia	\$ 250.000	1,88 %	26.04.2021	244.519	0,41 %
Provinz Quebec (Kanada)	\$ 155.000	7,50 %	15.09.2029	219.526	0,37 %
Royal Bank of Canada	\$ 210.000	2,15 %	26.10.2020	208.413	0,35 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 200.000	4,25 %	15.04.2027	198.500	0,33 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 100.000	6,20 %	15.10.2037	131.768	0,22 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 90.000	5,40 %	15.06.2047	94.050	0,16 %
Air Canada 2017-1 Klasse AA Pass Through Trust	\$ 35.000	3,30 %	15.01.2030	35.366	0,06 %
Air Canada 2017-1 Klasse B Pass Through Trust	\$ 30.000	3,70 %	15.01.2026	30.281	0,05 %
Air Canada 2017-1 Klasse A Pass Through Trust	\$ 20.000	3,55 %	15.01.2030	19.991	0,03 %
				3.751.012	6,26 %
Chile 0,32 %					
Empresa Nacional del Petroleo	\$ 200.000	4,50 %	14.09.2047	191.344	0,32 %
				191.344	0,32 %
China 1,05 %					
CNOOC Curtis Funding No 1 Pty Ltd.	\$ 400.000	4,50 %	03.10.2023	425.690	0,71 %
Export-Import Bank von China	\$ 200.000	4,00 %	28.11.2047	203.720	0,34 %
				629.410	1,05 %
Kolumbien 0,62 %					
Colombia Government International Bond	\$ 200.000	7,38 %	18.03.2019	211.842	0,35 %
Colombia Government International Bond	\$ 100.000	10,38 %	28.01.2033	157.945	0,27 %
				369.787	0,62 %
Kroatien 0,51 %					
Croatia Government International Bond	€ 250.000	2,75 %	27.01.2030	303.953	0,51 %
				303.953	0,51 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Dominikanische Republik 0,36 %					
Internationale Staatsanleihe der Dominikanischen Republik	\$ 200.000	7,50 %	06.05.2021	218.250	0,36 %
				218.250	0,36 %
Frankreich 0,84 %					
Air Liquide Finance SA	\$ 200.000	2,50 %	27.09.2026	190.958	0,32 %
BPCE SA	AUD 200.000	3,50 %	24.04.2020	158.666	0,26 %
Electricite de France SA	\$ 150.000	3,63 %	13.10.2025	153.331	0,26 %
				502.955	0,84 %
Deutschland 4,38 %					
Kreditanstalt für Wiederaufbau	€ 900.000	0,00 %	15.12.2022	1.082.541	1,81 %
Deutsche Bank AG	£ 300.000	1,88 %	28.02.2020	408.696	0,68 %
Aroundtown SA	£ 200.000	3,00 %	16.10.2029	271.597	0,45 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 250.000	3,40 %	16.03.2027	253.862	0,43 %
ADLER Real Estate AG	€ 200.000	1,50 %	06.12.2021	237.876	0,40 %
Volkswagen International Finance NV^	€ 100.000	3,88 %	14.06.2166	126.764	0,21 %
DVB Bank SE	€ 100.000	1,25 %	15.09.2021	120.657	0,20 %
DVB Bank SE	€ 100.000	0,88 %	09.04.2021	119.626	0,20 %
				2.621.619	4,38 %
Hongkong 0,50 %					
AIA Group Ltd.	\$ 300.000	3,20 %	11.03.2025	298.380	0,50 %
				298.380	0,50 %
Ungarn 0,37 %					
Hungary Government International Bond	\$ 200.000	6,38 %	29.03.2021	222.250	0,37 %
				222.250	0,37 %
Indien 0,66 %					
Indian Railway Finance Corp., Ltd.	\$ 200.000	3,84 %	13.12.2027	198.582	0,33 %
ICICI Bank Ltd.	\$ 200.000	3,80 %	14.12.2027	197.638	0,33 %
				396.220	0,66 %
Indonesien 0,86 %					
Indonesia Government International Bond	\$ 240.000	6,63 %	17.02.2037	306.900	0,51 %
Indonesia Government International Bond	\$ 200.000	3,75 %	25.04.2022	205.750	0,35 %
				512.650	0,86 %
Irland 0,79 %					
Roadster Finance Designated Activity Co.	€ 400.000	2,38 %	08.12.2027	476.364	0,79 %
				476.364	0,79 %
Israel 1,04 %					
Israel Government International Bond	€ 200.000	2,88 %	29.01.2024	272.582	0,45 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	€ 200.000	1,13 %	15.10.2024	207.637	0,35 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	\$ 185.000	4,10 %	01.10.2046	142.226	0,24 %
				622.445	1,04 %
Italien 0,70 %					
Enel Finance International NV	\$ 300.000	3,63 %	25.05.2027	297.410	0,50 %
Leonardo SpA	€ 100.000	1,50 %	07.06.2024	120.197	0,20 %
				417.607	0,70 %
Japan 0,26 %					
Japanische Staatsanleihe	¥ 15.000.000	1,50 %	20.06.2032	156.185	0,26 %
				156.185	0,26 %
Jersey 0,74 %					
UBS Group Funding Switzerland AG	\$ 450.000	2,65 %	01.02.2022	445.104	0,74 %
				445.104	0,74 %
Kasachstan 0,34 %					
KazMunayGas National Co JSC	\$ 200.000	9,13 %	02.07.2018	206.132	0,34 %
				206.132	0,34 %
Mexiko 1,75 %					
Mexico Government International Bond	\$ 1.000.000	4,00 %	02.10.2023	1.047.307	1,75 %
				1.047.307	1,75 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Marokko 0,36 %					
OCP SA	\$ 200.000	5,63 %	25.04.2024	214.000	0,36 %
				214.000	0,36 %
Niederlande 1,63 %					
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 250.000	4,63 %	01.12.2023	267.309	0,45 %
NIBC Bank NV^	€ 200.000	6,00 %	15.04.2166	248.568	0,41 %
Cooperatieve Rabobank UA	AUD 300.000	4,28 %	02.07.2025	240.625	0,40 %
Shell International Finance BV	\$ 200.000	4,13 %	11.05.2035	218.781	0,37 %
				975.283	1,63 %
Norwegen 0,22 %					
Statoil A.S.A	\$ 110.000	5,10 %	17.08.2040	133.195	0,22 %
				133.195	0,22 %
Portugal 1,40 %					
EDP Finance BV	\$ 341.000	4,13 %	15.01.2020	351.307	0,59 %
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT	€ 200.000	4,13 %	14.04.2027	284.656	0,47 %
EDP Finance BV	\$ 200.000	3,63 %	15.07.2024	201.628	0,34 %
				837.591	1,40 %
Russland 1,61 %					
Lukoil International Finance BV	\$ 550.000	3,42 %	24.04.2018	550.688	0,92 %
Gazprom OAO Via Gaz Capital SA	\$ 200.000	9,25 %	23.04.2019	215.750	0,36 %
MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC	\$ 200.000	4,10 %	11.04.2023	201.250	0,33 %
				967.688	1,61 %
Saudi-Arabien 0,33 %					
Saudi Government International Bond	\$ 200.000	4,50 %	26.10.2046	199.890	0,33 %
				199.890	0,33 %
Serbien 0,34 %					
Serbia International Bond	\$ 200.000	5,88 %	03.12.2018	205.500	0,34 %
				205.500	0,34 %
Südkorea 1,00 %					
Koreanische Entwicklungsbank	\$ 400.000	2,29 %	19.09.2020	399.452	0,67 %
Harvest Operations Corp	\$ 200.000	3,00 %	21.09.2022	197.384	0,33 %
				596.836	1,00 %
Supranational 6,72 %					
European Financial Stability Facility	€ 1.600.000	1,75 %	29.10.2020	2.034.534	3,39 %
European Stability Mechanism	€ 1.000.000	0,00 %	18.10.2022	1.204.130	2,01 %
Europäische Investitionsbank	€ 400.000	0,25 %	15.10.2020	489.135	0,82 %
Corp.Andina de Fomento	\$ 300.000	2,00 %	10.05.2019	298.594	0,50 %
				4.026.393	6,72 %
Schweden 0,34 %					
Skandinaviska Enskilda Banken AB^	\$ 200.000	5,75 %	13.05.2166	205.748	0,34 %
				205.748	0,34 %
Schweiz 1,29 %					
UBS AG	\$ 525.000	2,45 %	01.12.2020	523.107	0,87 %
ELM BV for Swiss Reinsurance Co., Ltd.^	€ 200.000	2,60 %	01.09.2166	251.539	0,42 %
				774.646	1,29 %
Thailand 0,35 %					
Bangkok Bank PCL	\$ 200.000	4,80 %	18.10.2020	210.254	0,35 %
				210.254	0,35 %
Türkei 0,33 %					
Turkey Government International Bond	\$ 200.000	5,75 %	11.05.2047	195.000	0,33 %
				195.000	0,33 %
Vereinigtes Königreich 6,08 %					
Phoenix Group Holdings	£ 300.000	6,63 %	18.12.2025	484.149	0,81 %
HSBC Holdings plc	£ 300.000	2,63 %	16.08.2028	414.040	0,69 %
Bazalgette Finance plc	£ 300.000	2,38 %	29.11.2027	403.982	0,67 %
United Kingdom Gilt	£ 158.000	3,50 %	22.07.2068	356.832	0,60 %
BP Capital Markets plc	\$ 300.000	3,28 %	19.09.2027	302.845	0,51 %
HSBC Holdings plc^	£ 200.000	2,26 %	13.11.2026	271.404	0,45 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
HSBC Holdings plc^	\$ 200.000	4,04 %	13.03.2028	208.184	0,35 %
HSBC Holdings plc^	\$ 200.000	3,26 %	13.03.2023	202.545	0,34 %
HSBC Holdings plc^	\$ 200.000	3,03 %	22.11.2023	200.342	0,33 %
Lloyds Banking Group plc^	\$ 200.000	2,91 %	07.11.2023	198.052	0,33 %
BAT Capital Corp.	\$ 175.000	3,56 %	15.08.2027	175.174	0,29 %
BAT Capital Corp.	\$ 160.000	4,39 %	15.08.2037	167.600	0,28 %
Sky plc	€ 100.000	2,50 %	15.09.2026	131.997	0,22 %
Sky Group Finance plc	\$ 75.000	6,50 %	15.10.2035	95.210	0,16 %
CNH Industrial NV	\$ 30.000	3,85 %	15.11.2027	29.925	0,05 %
				3.642.281	6,08 %
USA 44,46 %					
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 850.000	4,46 %	23.07.2022	884.769	1,48 %
Morgan Stanley	\$ 850.000	2,50 %	21.04.2021	847.521	1,41 %
Brown-Forman Corp.	£ 500.000	2,60 %	07.07.2028	693.038	1,16 %
Newell Brands Inc.	\$ 585.000	4,20 %	01.04.2026	610.056	1,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 400.000	2,88 %	03.06.2026	535.169	0,89 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	\$ 500.000	3,50 %	03.06.2024	515.652	0,86 %
Discovery Communications LLC	\$ 500.000	3,80 %	13.03.2024	507.031	0,85 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 500.000	3,70 %	28.03.2022	505.760	0,84 %
NBCUniversal Media LLC	\$ 500.000	2,88 %	15.01.2023	504.449	0,84 %
Citigroup, Inc.	£ 300.000	4,50 %	03.03.2031	476.977	0,80 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 465.000	3,30 %	01.04.2026	466.840	0,78 %
Marathon Oil Corp.	\$ 450.000	2,80 %	01.11.2022	443.290	0,74 %
Physicians Realty LP	\$ 390.000	3,95 %	15.01.2028	386.318	0,64 %
AbbVie, Inc.	\$ 375.000	3,60 %	14.05.2025	385.395	0,64 %
Nuveen Finance LLC	\$ 350.000	4,13 %	01.11.2024	368.288	0,61 %
DXC Technology Co.	\$ 350.000	4,25 %	15.04.2024	364.386	0,61 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 365.000	4,52 %	15.09.2048	359.508	0,60 %
Abbott Laboratories	\$ 350.000	3,75 %	30.11.2026	359.490	0,60 %
General Electric Co.	€ 300.000	2,13 %	17.05.2037	357.313	0,60 %
Wells Fargo & Co.	£ 200.000	4,88 %	29.11.2035	344.514	0,57 %
Brixmor Operating Partnership LP	\$ 350.000	3,25 %	15.09.2023	341.878	0,57 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 300.000	4,70 %	01.02.2036	336.586	0,56 %
Entergy Arkansas, Inc.	\$ 325.000	3,50 %	01.04.2026	334.516	0,56 %
State of California	\$ 200.000	7,63 %	01.03.2040	312.890	0,52 %
CF Industries, Inc.	\$ 300.000	4,50 %	01.12.2026	312.869	0,52 %
Goldman Sachs Group, Inc.	£ 200.000	4,25 %	29.01.2026	308.280	0,51 %
Andeavor	\$ 275.000	5,13 %	15.12.2026	302.500	0,50 %
US Treasury Bond	\$ 300.000	2,75 %	15.08.2047	300.281	0,50 %
VMware, Inc.	\$ 300.000	2,95 %	21.08.2022	299.418	0,50 %
AT&T, Inc.	\$ 275.000	4,25 %	01.03.2027	280.335	0,47 %
Morgan Stanley	£ 200.000	2,63 %	09.03.2027	276.296	0,46 %
General Motors Co.	\$ 250.000	5,15 %	01.04.2038	266.403	0,44 %
FirstEnergy Corp.	\$ 260.000	3,90 %	15.07.2027	265.939	0,44 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 250.000	3,70 %	01.02.2024	261.288	0,44 %
General Electric Co.	£ 150.000	5,25 %	07.12.2028	261.286	0,44 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 250.000	4,02 %	31.10.2038	256.116	0,43 %
Morgan Stanley^	€ 200.000	1,34 %	23.10.2026	239.853	0,40 %
Flowserve Corp.	€ 200.000	1,25 %	17.03.2022	237.255	0,40 %
Synchrony Financial	\$ 230.000	3,95 %	01.12.2027	228.977	0,38 %
ConocoPhillips Co.	\$ 200.000	4,95 %	15.03.2026	226.997	0,38 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 180.000	6,05 %	01.03.2034	225.475	0,38 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	\$ 225.000	3,55 %	01.04.2025	225.070	0,38 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 175.000	5,65 %	01.12.2041	222.216	0,37 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 225.000	3,88 %	15.01.2027	221.300	0,37 %
GMF Floorplan Owner Revolving Trust	\$ 220.000	2,05 %	18.01.2022	221.117	0,37 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 200.000	6,02 %	15.06.2026	220.524	0,37 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2017	\$ 220.000	2,36 %	15.03.2029	217.829	0,36 %
Ford Motor Co.	\$ 200.000	5,29 %	08.12.2046	216.739	0,36 %
Ally Master Owner Trust	\$ 210.000	1,82 %	15.06.2021	210.447	0,35 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	4,39 %	08.01.2026	209.276	0,35 %
Columbia Property Trust Operating Partnership LP	\$ 200.000	4,15 %	01.04.2025	203.063	0,34 %
SMB Private Education Loan Trust 2017	\$ 200.000	2,38 %	15.09.2034	202.551	0,34 %
Comcast Corp.	\$ 200.000	3,15 %	15.02.2028	200.769	0,33 %
Hyundai Auto Lease Securitization Trust 2017	\$ 200.000	2,13 %	15.04.2021	199.393	0,33 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 200.000	3,63 %	15.01.2024	199.039	0,33 %
MassMutual Global Funding II	\$ 200.000	2,75 %	22.06.2024	198.422	0,33 %
Verizon Communications, Inc.	AUD 250.000	4,05 %	17.02.2025	196.425	0,33 %
Synchrony Financial	\$ 175.000	4,25 %	15.08.2024	181.074	0,30 %
Camden Property Trust	\$ 170.000	4,25 %	15.01.2024	177.967	0,30 %
Verisk Analytics, Inc.	\$ 150.000	5,50 %	15.06.2045	173.406	0,29 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 150.000	4,75 %	15.09.2044	171.789	0,29 %
Goldman Sachs Group, Inc.	AUD 200.000	5,00 %	21.08.2019	162.443	0,27 %
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC	\$ 160.000	2,99 %	20.06.2022	160.940	0,27 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014	\$ 155.000	3,49 %	15.01.2048	159.639	0,27 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 150.000	4,35 %	17.01.2027	155.975	0,26 %
AXIS Specialty Finance plc	\$ 155.000	4,00 %	06.12.2027	155.698	0,26 %
Realty Income Corp.	\$ 155.000	3,65 %	15.01.2028	155.580	0,26 %
Brandywine Operating Partnership LP	\$ 150.000	4,55 %	01.10.2029	153.916	0,26 %
Kroger Co.	\$ 150.000	3,70 %	01.08.2027	151.028	0,25 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	\$ 125.000	5,75 %	15.05.2024	138.437	0,23 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 125.000	4,80 %	15.07.2046	132.789	0,22 %
Life Storage LP	\$ 130.000	3,88 %	15.12.2027	129.471	0,22 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 100.000	8,10 %	15.07.2036	126.279	0,21 %
AmeriCredit Automobile Receivables 2016	\$ 119.000	3,59 %	08.02.2022	120.992	0,20 %
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC	\$ 120.000	3,07 %	20.09.2023	120.846	0,20 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 120.000	3,27 %	29.09.2025	119.062	0,20 %
South Carolina Electric & Gas Co.	\$ 100.000	5,45 %	01.02.2041	118.457	0,20 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 110.000	3,40 %	18.01.2023	109.568	0,18 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 100.000	6,35 %	15.10.2045	105.904	0,18 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 100.000	4,90 %	15.10.2025	105.385	0,18 %
FirstEnergy Transmission LLC	\$ 100.000	4,35 %	15.01.2025	105.357	0,18 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015	\$ 100.000	3,80 %	15.08.2048	104.646	0,17 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014	\$ 100.000	3,64 %	10.10.2047	103.786	0,17 %
277PC Commercial Mortgage Trust 2014^	\$ 100.000	3,61 %	10.08.2049	103.693	0,17 %
Hilton USA Trust 2016	\$ 100.000	3,72 %	05.11.2038	102.979	0,17 %
Drive Auto Receivables Trust 2017	\$ 100.000	3,84 %	15.03.2023	101.994	0,17 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	01.11.2024	101.796	0,17 %
Hertz Vehicle Financing II LP	\$ 100.000	4,20 %	25.10.2023	101.102	0,17 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 100.000	3,70 %	15.04.2046	100.289	0,17 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2017	\$ 100.000	2,62 %	15.10.2025	100.129	0,17 %
Georgia Power Co.	\$ 100.000	3,25 %	01.04.2026	100.108	0,17 %
SoFi Professional Loan Program 2017-F LLC	\$ 100.000	2,84 %	25.01.2041	100.076	0,17 %
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC	\$ 100.000	2,97 %	20.03.2024	99.905	0,17 %
Santander Retail Auto Lease Trust 2017	\$ 100.000	2,68 %	20.01.2022	99.710	0,17 %
SMB Private Education Loan Trust 2017	\$ 100.000	2,82 %	15.10.2035	99.620	0,17 %
Invitation Homes 2017	\$ 99.582	2,34 %	17.12.2036	99.582	0,17 %
Hyundai Auto Lease Securitization Trust 2017	\$ 100.000	2,46 %	15.07.2022	99.490	0,17 %
DLL Securitization Trust 2017	\$ 100.000	2,43 %	17.11.2025	99.324	0,17 %
Progress Residential 2017	\$ 100.000	2,90 %	17.12.2034	99.259	0,17 %
Houston Galleria Mall Trust 2015	\$ 100.000	3,09 %	05.03.2037	98.383	0,16 %
Georgia Power Co.	\$ 80.000	5,40 %	01.06.2040	96.154	0,16 %
Anthem, Inc.	\$ 90.000	3,65 %	01.12.2027	91.615	0,15 %
Oracle Corp.	\$ 85.000	3,25 %	15.11.2027	86.259	0,14 %
Oracle Corp.	\$ 85.000	2,95 %	15.11.2024	85.607	0,14 %
Marathon Oil Corp.	\$ 75.000	5,20 %	01.06.2045	82.424	0,14 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 80.000	3,47 %	15.09.2050	81.656	0,14 %
Metropolitan Life Global Funding I	AUD 100.000	4,50 %	16.04.2019	80.146	0,13 %
Andeavor Logistics LP/Tesoro Logistics Finance Corp.	\$ 75.000	5,20 %	01.12.2047	78.000	0,13 %
AT&T, Inc.	\$ 75.000	3,40 %	14.08.2024	75.421	0,13 %
Georgia Power Co.	\$ 65.000	4,75 %	01.09.2040	72.075	0,12 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 75.000	3,50 %	15.01.2028	71.468	0,12 %
DDR Corp.	\$ 65.000	3,90 %	15.08.2024	65.510	0,11 %
South Carolina Electric & Gas Co.	\$ 50.000	6,05 %	15.01.2038	62.182	0,10 %
Oracle Corp.	\$ 55.000	4,00 %	15.11.2047	58.442	0,10 %
Oracle Corp.	\$ 55.000	3,80 %	15.11.2037	57.719	0,10 %
Kansas City Southern	\$ 50.000	4,95 %	15.08.2045	56.797	0,09 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013^	\$ 50.000	5,08 %	15.11.2045	52.302	0,09 %
Morgan Stanley Capital I, Inc.	\$ 50.000	3,59 %	15.12.2050	51.543	0,09 %
Bank 2018-BNK8	\$ 50.000	3,54 %	15.11.2054	51.505	0,09 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 50.000	4,19 %	15.09.2050	51.256	0,08 %
Volvo Financial Equipment Master Owner Trust 2017	\$ 50.000	1,98 %	15.11.2022	50.142	0,08 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Wendys Funding LLC 2018	\$ 50.000	3,88 %	15.03.2048	50.035	0,08 %
Wendys Funding LLC 2018	\$ 50.000	3,57 %	15.03.2048	49.984	0,08 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2017	\$ 50.000	2,82 %	15.10.2025	49.871	0,08 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 50.000	4,27 %	15.09.2050	49.855	0,08 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2017	\$ 50.000	3,01 %	15.10.2025	49.854	0,08 %
Healthcare Realty Trust, Inc.	\$ 50.000	3,63 %	15.01.2028	49.460	0,08 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 50.000	3,13 %	15.01.2025	47.765	0,08 %
Brandywine Operating Partnership LP	\$ 35.000	3,95 %	15.11.2027	34.620	0,06 %
CD 2017-CD5 Mortgage Trust	\$ 30.000	3,43 %	15.08.2050	30.761	0,05 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 30.000	3,47 %	12.10.2050	30.719	0,05 %
Verizon Owner Trust 2017-3	\$ 30.000	2,53 %	20.04.2022	29.791	0,05 %
Goodman US Finance Three LLC	\$ 25.000	3,70 %	15.03.2028	24.738	0,04 %
CCRE25Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 20.000	3,76 %	10.08.2048	20.949	0,03 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 20.000	3,58 %	15.10.2050	20.638	0,03 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 20.000	3,59 %	15.12.2050	20.637	0,03 %
Bank 2018-BNK8	\$ 20.000	3,49 %	15.11.2050	20.518	0,03 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 20.000	3,50 %	07.11.2024	19.874	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.^	\$ 18.000	3,96 %	15.11.2048	18.572	0,03 %
South Carolina Electric & Gas Co.	\$ 10.000	4,60 %	15.06.2043	10.829	0,02 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 10.000	3,78 %	10.09.2058	10.483	0,02 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015	\$ 10.000	3,64 %	15.06.2048	10.390	0,02 %
Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017	\$ 10.000	3,57 %	15.02.2050	10.348	0,02 %
GS Mortgage Securities Trust 2014	\$ 10.000	3,63 %	10.11.2047	10.348	0,02 %
CD 2017-CD6 Mortgage Trust	\$ 10.000	3,46 %	13.11.2050	10.293	0,02 %
Bank 2018-BNK8	\$ 10.000	3,25 %	15.07.2060	10.120	0,02 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2016	\$ 10.000	2,95 %	15.05.2024	9.992	0,02 %
DDR Corp.	\$ 10.000	3,63 %	01.02.2025	9.853	0,02 %
Andeavor	\$ 5.000	4,50 %	01.04.2048	5.055	0,01 %
				26.637.830	44,46 %
Summe Anleihen				57.381.456	95,77 %
Staatsanleihen 2,67 %					
Japan 2,67 %					
Japan Treasury Discount Bill	¥ 180.000.000	0,00 %	13.02.2018	1.598.133	2,67 %
Summe Staatsanleihen				1.598.133	2,67 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				58.979.589	98,44 %

	Anzahl der Kontrakt	Ablauf datum	Prämie	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente					
Verkaufte Option (0,00 %)					
Put Option on US 10-Year Note März 2018, Strike Price 122	1	23.02.2018	\$ 232	(125)	(0,00 %)
				(125)	(0,00 %)

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Futures (0,08 %)				
US Ultra Bond März 2018	11	1.830.136	14.083	0,02 %
US 10-Year Ultra März 2018	(23)	(3.081.967)	10.029	0,02 %
AUS 10-Year Bond Futures März 2018	(8)	(815.210)	7.043	0,01 %
US 10-Year Note März 2018	(10)	(1.245.876)	5.407	0,01 %
US 5-Year Note März 2018	(7)	(815.177)	2.028	0,00 %
US Lond Bond März 2018	5	763.905	1.095	0,00 %
AUS 3-Year Bond Futures März 2018	(1)	(87.063)	169	0,00 %
10-Year Mini JGB Futures März 2018	(3)	(401.864)	160	0,00 %
Euro-Schatz Futures März 2018	11	1.481.631	(2.576)	(0,00 %)
US 2-Year Note März 2018	7	1.501.437	(2.671)	(0,00 %)
Euro-Oat Futures März 2018	2	377.195	(4.515)	(0,01 %)
Euro Buxl 30 Year Bond Futures März 2018	2	401.355	(7.829)	(0,01 %)
CAN 10-Year Bond Futures März 2018	7	760.837	(7.845)	(0,01 %)

	Anzahl der Kontrakte	Nominal-betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt-nettovermögens
Euro-Btp Futures März 2018	2	335.167	(8.213)	(0,01 %)
Euro-Bobl Futures März 2018	10	1.589.163	(8.790)	(0,02 %)
Long Gilt Future März 2018	(15)	(2.518.482)	(21.171)	(0,04 %)
Euro-Bund Futures März 2018	12	2.352.319	(22.575)	(0,04 %)
			(46.171)	(0,08 %)

Währung	Kauf-betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs-datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt-nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte (0,56 %)							
EUR	491.000	USD	(582.193)	UBS	16.01.2018	7.872	0,01 %
AUD	200.000	USD	(153.398)	UBS	16.01.2018	3.037	0,01 %
GBP	200.000	USD	(268.584)	UBS	16.01.2018	2.084	0,00 %
GBP	124.000	USD	(166.909)	UBS	16.01.2018	906	0,00 %
EUR	12.000	USD	(14.277)	UBS	16.01.2018	144	0,00 %
AUD	3.000	USD	(2.318)	BNP Paribas	16.01.2018	29	0,00 %
USD	7.128	JPY	(800.000)	UBS	13.02.2018	12	0,00 %
USD	156.765	JPY	(17.700.000)	JP Morgan Chase Bank	13.02.2018	(675)	(0,00 %)
USD	228.578	EUR	(193.000)	UBS	16.01.2018	(3.362)	(0,00 %)
USD	329.173	GBP	(246.000)	JP Morgan Chase Bank	16.01.2018	(3.749)	(0,01 %)
USD	420.585	GBP	(315.000)	UBS	16.01.2018	(5.718)	(0,01 %)
USD	1.589.231	JPY	(180.000.000)	JP Morgan Chase Bank	13.02.2018	(11.854)	(0,02 %)
USD	4.580.013	GBP	(3.425.000)	JP Morgan Chase Bank	16.01.2018	(55.187)	(0,09 %)
USD	2.161.339	AUD	(2.860.000)	UBS	16.01.2018	(75.673)	(0,13 %)
USD	9.729.407	EUR	(8.256.000)	Barclays Bank Plc	16.01.2018	(192.334)	(0,32 %)
						(334.468)	(0,56 %)

Offene Devisenterminkontrakte zu Absicherungszwecken auf Ebene der Anteilsklasse 0,15 %

EUR	13.490.067	USD	(16.120.225)	BNP Paribas	03.01.2018	78.650	0,13 %
EUR	1.993.975	USD	(2.368.000)	BNP Paribas	03.01.2018	26.366	0,05 %
EUR	149.782	USD	(176.716)	UBS	03.01.2018	3.142	0,01 %
EUR	15.872.151	USD	(19.092.848)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	2.709	0,01 %
EUR	220.846	USD	(263.902)	BNP Paribas	03.01.2018	1.290	0,00 %
GBP	10.860.239	USD	(14.705.633)	UBS	02.02.2018	1.131	0,00 %
EUR	95.654	USD	(114.281)	BNP Paribas	03.01.2018	581	0,00 %
EUR	59.448	USD	(70.816)	BNP Paribas	03.01.2018	570	0,00 %
GBP	35.936	USD	(48.050)	UBS	03.01.2018	562	0,00 %
EUR	10.766	USD	(12.753)	BNP Paribas	03.01.2018	175	0,00 %
GBP	10.919	USD	(14.606)	BNP Paribas	03.01.2018	165	0,00 %
GBP	6.188	USD	(8.277)	BNP Paribas	03.01.2018	94	0,00 %
GBP	9.433	USD	(12.669)	BNP Paribas	03.01.2018	92	0,00 %
GBP	6.374	USD	(8.556)	JP Morgan Chase Bank	03.01.2018	66	0,00 %
EUR	3.099	USD	(3.658)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	64	0,00 %
GBP	5.797	USD	(7.778)	BNP Paribas	03.01.2018	63	0,00 %
GBP	10.106	USD	(13.639)	BNP Paribas	03.01.2018	32	0,00 %
EUR	144.918	USD	(174.322)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	27	0,00 %
GBP	2.031	USD	(2.722)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	25	0,00 %
GBP	1.200	USD	(1.601)	BNP Paribas	03.01.2018	22	0,00 %
EUR	599	USD	(706)	BNP Paribas	03.01.2018	13	0,00 %
GBP	1.512	USD	(2.033)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	12	0,00 %
GBP	498	USD	(667)	BNP Paribas	03.01.2018	7	0,00 %
GBP	20.532	USD	(27.799)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	5	0,00 %
USD	6.732	GBP	(4.974)	BNP Paribas	03.01.2018	4	0,00 %
GBP	1.403	USD	(1.895)	JP Morgan Chase Bank	03.01.2018	3	0,00 %
USD	14.705.633	GBP	(10.870.917)	UBS	03.01.2018	2	0,00 %
GBP	98	USD	(132)	JP Morgan Chase Bank	03.01.2018	1	0,00 %
USD	110.620	EUR	(92.122)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	—	0,00 %
GBP	20.403	USD	(27.600)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	—	0,00 %
GBP	7.646	USD	(10.354)	UBS	02.02.2018	—	0,00 %
USD	19.092.848	EUR	(15.900.107)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(3)	(0,00 %)
EUR	18.680	USD	(22.490)	UBS	02.02.2018	(17)	(0,00 %)
USD	8.484	EUR	(7.110)	BNP Paribas	03.01.2018	(54)	(0,00 %)
USD	17.080	GBP	(12.710)	BNP Paribas	03.01.2018	(113)	(0,00 %)
GBP	62.683	USD	(84.928)	BNP Paribas	03.01.2018	(134)	(0,00 %)

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
USD	29.725	EUR	(24.899)	BNP Paribas	03.01.2018	(174)	(0,00 %)
GBP	158.769	USD	(215.210)	BNP Paribas	03.01.2018	(435)	(0,00 %)
GBP	10.555.251	USD	(14.306.682)	BNP Paribas	03.01.2018	(28.069)	(0,05 %)
						86.874	0,15 %

Währung	Nominal- betrag	Ablauf datum	Kontrahent	Referenziert tungen	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Credit Default Swap-Kontrakte (0,02 %)						
USD	500.000	20.12.2022	Barclays Bank Plc	Buying default protection on Republic of South Africa Gover, 5,50 % 9.3.2020	13.033	0,02 %
USD	400.000	20.12.2022	BNP Paribas	Selling default protection on China Government International, 7,50 % 28.10.2027	9.355	0,02 %
USD	315.000	20.12.2022	Barclays Bank Plc	Buying default protection on Republic of South Africa Gover, 5,50 % 9.3.2020	8.211	0,01 %
USD	400.000	20.06.2024	Barclays Bank Plc	Selling default protection on Berkshire Hathaway, Inc., 2,75 % 15.3.2023	6.400	0,01 %
EUR	200.000	20.12.2022	JP Morgan Chase	Buying default protection on Barclays PLC, 4,38 % 11.9.2024	5.575	0,01 %
USD	400.000	20.12.2022	BNP Paribas	Selling default protection on Peruvian Government International, 8,75 % 21.11.2033	5.303	0,01 %
USD	250.000	20.06.2024	Barclays Bank Plc	Selling default protection on Metlife, Inc., 5,38 % 9.12.2024	4.208	0,01 %
USD	105.000	20.06.2022	JP Morgan Chase	Selling default protection on Southern Co., 1,85 % 1.7.2019	1.398	0,00 %
USD	15.000	20.06.2022	JP Morgan Chase	Buying default protection on Sempra Energy, 6,15 % 15.6.2018	(452)	(0,00 %)
USD	15.000	20.06.2022	JP Morgan Chase	Buying default protection on Dominion Energy, Inc., 6,40 % 15.6.2018	(455)	(0,00 %)
USD	15.000	20.06.2022	JP Morgan Chase	Buying default protection on Exelon Corp., 5,15 % 1.12.2020	(471)	(0,00 %)
USD	20.000	20.06.2022	JP Morgan Chase	Buying default protection on Sempra Energy, 6,15 % 15.6.2018	(603)	(0,00 %)
USD	20.000	20.06.2022	JP Morgan Chase	Buying default protection on Exelon Corp., 5,15 % 1.12.2020	(628)	(0,00 %)
USD	500.000	20.12.2022	BNP Paribas	Buying default protection on Philippine Government Internat, 10,63 % 16.3.2025	(9.669)	(0,02 %)
EUR	400.000	20.12.2022	JP Morgan Chase	Buying default protection on Barclays Bank PLC, 1,50 % 4.4.2017	(13.416)	(0,02 %)
EUR	150.000	20.12.2022	Barclays Bank Plc	Buying default protection on iTraxx Europe Crossover	(22.199)	(0,04 %)
USD	200.000	20.12.2022	Barclays Bank Plc	Buying default protection on Argentine Republic Government, 7,50 % 22.4.2026	(23.765)	(0,04 %)
					(18.175)	(0,03 %)
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Swap-Vermögenswerte					53.483	0,09 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Swap-Verbindlichkeiten					(71.658)	(0,12 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente					(312.065)	(0,52 %)

	Marktwert US-Dollars (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva	1.246.808	2,08 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	59.914.332	100,00 %
Analyse des Gesamtvermögens		
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	36.490.918	60,90 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	20.688.182	34,53 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	1.800.489	3,01 %
(d) Derivative Finanzinstrumente	(312.065)	(0,52 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva	1.246.808	2,08 %
Gesamtvermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	59.914.332	100,00 %

[^] Zinsvariable Anleihe (FRN). Der Effektivzins zum 31. Dezember 2017.

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017¹

	Kapital	Kosten US-Dollar (\$)		Kapital	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
Bundesobligation 0,25 % 16.10.2020	€ 2.050.000	2.467.363	Bundesobligation 0,25 % 16.10.2020	€ 2.050.000	2.490.751
US Treasury Bond 2,75 % 15.8.2047	\$ 2.100.000	2.056.191	US Treasury Note 2,25 % 15.8.2027	\$ 2.050.000	2.028.283
US Treasury Note 2,25 % 15.8.2027	\$ 2.050.000	2.041.799	US Treasury Bond 2,75 % 15.8.2047	\$ 1.800.000	1.782.361
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,75 % 29.10.2020	€ 1.600.000	2.015.448	Cooperative Rabobank UA 4,63 % 23.5.2029	£ 800.000	1.243.845
Japan Treasury Discount Bill 0,00 % 13.2.2018	¥ 180.000.000	1.579.128	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,50 % 4.9.2022	€ 875.000	1.129.789
Province of Ontario Canada 1,25 % 17.6.2019	\$ 1.500.000	1.486.680	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,25 % 15.8.2048	€ 711.000	847.701
Cooperative Rabobank UA 4,63 % 23.5.2029	£ 800.000	1.225.548	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 2,75 % 3.12.2029	€ 500.000	726.143
Europäischer Stabilitätsmechanismus 0,00 % 18.10.2022	€ 1.000.000	1.193.656	Dover Corp. 1,25 % 9.11.2026	€ 600.000	711.277
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,50 % 4.9.2022	€ 875.000	1.124.086	Anheuser-Busch InBev SA 1,75 % 7.3.2025	£ 500.000	657.897
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,00 % 15.12.2022	€ 900.000	1.074.947	Petroleos Mexicanos 5,50 % 21.1.2021	\$ 600.000	639.800
Mexico Government International Bond 4,00 % 2.10.2023	\$ 1.000.000	1.052.950	Allianz SE 2,24 % 7.7.2045	€ 500.000	613.344
Charter Communications Operating LLC.Charter Communications Operating Capital 4,46 % 23.7.2022	\$ 850.000	896.853	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC 4,60 % 2.11.2047	\$ 600.000	609.600
Morgan Stanley 2,50 % 21.4.2021	\$ 850.000	852.695	Nestle Finance International Ltd. 1,75 % 2.11.2037	€ 500.000	594.704
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,25 % 15.8.2048	€ 711.000	834.398	Esselunga SpA 1,88 % 25.10.2027	€ 500.000	591.797
Aroundtown SA 3,00 % 16.10.2029	£ 600.000	769.075	Esselunga SpA 0,88 % 25.10.2023	€ 500.000	588.698
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 2,75 % 3.12.2029	€ 500.000	718.684	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 3,54 % 8.11.2027	\$ 575.000	581.038
General Electric Co. 2,13 % 17.5.2037	€ 600.000	707.258	Tritax Big Box plc REIT 2,63 % 14.12.2026	£ 400.000	537.180
Dover Corp. 1,25 % 9.11.2026	€ 600.000	701.090	Life Technologies Corp. 5,00 % 15.1.2021	\$ 500.000	535.400
Brown-Forman Corp. 2,60 % 7.7.2028	£ 500.000	663.568	Goldman Sachs Group, Inc. 3,50 % 23.1.2025	\$ 525.000	532.949
UBS Group Funding Switzerland AG 2,65 % 1.2.2022	\$ 650.000	648.534	Aroundtown SA 3,00 % 16.10.2029	£ 400.000	525.287
			Allianz SE 3,38 % 18.9.2166	€ 400.000	522.172
			Verizon Communications, Inc. 4,13 % 16.3.2027	\$ 500.000	520.285
			Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 3,80 % 15.9.2022	\$ 500.000	518.350

¹ Der Fonds wurde am 14. September 2017 aufgelegt.

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Berichtszeitraums. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Berichtszeitraum ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017
Umlaufvermögen	
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	58.979.589
Derivative Finanzinstrumente	223.454
Barmittel und liquide Vermögenswerte	641.616
Forderungen:	
Zinsen und Dividenden	473.664
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	79.699
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	402.149
Barmittel aus Marge	133.994
Summe Umlaufvermögen	60.934.165
Kurzfristige Passiva	
Derivative Finanzinstrumente	535.519
Überziehungskredit	2.589
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	595
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:	
Erworbene Kapitalanlagen	464.648
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	273
Zahlbare Verwaltungsgebühren	16.209
Summe kurzfristige Passiva	1.019.833
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	59.914.332

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in USD (\$)	
Nettovermögen	13.287.599
Anzahl der umlaufenden Anteile	131.215
Nettoinventarwert je Anteil	101,27
Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in USD (\$)	
Nettovermögen	12.633.404
Anzahl der umlaufenden Anteile	124.736
Nettoinventarwert je Anteil	101,28
Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in EUR (€)	
Gegenwert in US (\$)	19.266.565
Nettovermögen	16.044.774
Anzahl der umlaufenden Anteile	159.427
Nettoinventarwert je Anteil	100,64
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in GBP (£)	
Gegenwert in US (\$)	14.726.764
Nettovermögen	10.886.538
Anzahl der umlaufenden Anteile	107.867
Nettoinventarwert je Anteil	100,93

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Berichtszeitraum bis zum 31. Dezember 2017 ¹
Anlageerträge/(-verluste)	
Zinserträge	441.587
Verschiedene Erträge	8.363
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	507.897
Summe Anlageerträge/(-verluste)	957.847
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühren	52.363
Transaktionsgebühren und Provisionen	1.236
Sonstige Aufwendungen	8.613
Summe Aufwendungen	62.212
Finanzierungskosten	
Zinsaufwand	47
Summe Finanzierungskosten	47
Nettoanlageerträge/(-verluste)	895.588
Ausländische Quellensteuer	(3.586)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	892.002

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer
gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Berichtszeitraum bis zum 31. Dezember 2017 ¹
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens	
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	892.002
Kapitalgeschäfte	
Zeichnungen	59.149.975
Rücknahmen	(127.645)
Summe Kapitalgeschäfte	59.022.330
Gesamtsteigerung/(-minderung) für den Zeitraum	59.914.332
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	
Zu Beginn des Berichtszeitraums	—
Ende des Berichtszeitraums	59.914.332

¹ Der Fonds wurde am 14. September 2017 aufgelegt.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Berichtszeitraums verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für den Berichtszeitraum beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Global Short-Term Bond Index Fund

Verwaltet durch The Vanguard Group, Inc., und unterverwaltet durch Vanguard Investments Australia Ltd.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds strebt eine Rendite an, die der Wertentwicklung des Bloomberg Barclays Global Aggregate Ex US MBS 1–5 Year Float Adjusted Bond Index entspricht, eines marktgewichteten Index für globale Staatsanleihen, regierungsnahe Anleihen sowie Unternehmensanleihen und verbriefte festverzinsliche Anlagen mit Laufzeiten von 1 bis 5 Jahren, ausgenommen hypothekenbesicherte US-Wertpapiere.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	3.138	9.616
Rendite auf Endfälligkeit	1,2 % ³	1,2 %
Durchschnittlicher Kupon	2,1 %	2,4 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	2,8 Jahre	2,9 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	Aa3	Aa3
Durchschnittliche Duration	2,8 Jahre	2,8 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,15 %	
Anlegeranteile	0,20 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %	
Thesaurierende Anteile	0,15 %	
Ausschüttende Anteile	0,15 %	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,10 %	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,10 %	
Kurzfristige Reserven	0,8 %	—

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
USA	37,9 %	36,3 %
Japan	10,3	10,5
Deutschland	6,9	7,4
Frankreich	6,8	6,8
Italien	4,7	4,7
Kanada	4,5	4,3
Supranationale Anleihen	3,3	3,4
Vereinigtes Königreich	3,3	4,0
Spanien	2,8	3,0
Australien	2,3	2,3
Niederlande	2,2	2,2
Korea	2,1	2,0
Schweden	1,7	1,7
Schweiz	1,3	1,0
Belgien	1,1	1,0
China	1,0	1,2
Sonstige	7,8	8,2

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

Treasury-Titel	56,4 %
Industriegüter	10,3
Finanzinstitute	9,9
Agency-Titel	9,1
Forderungsbesicherte Wertpapiere	5,3
Supranationale Anleihen	3,3
Lokale Behörde	3,2
Staatlich	1,2
Versorger	1,2
Commercial Mortgage-Backed Security	0,1

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	43,8 %
Aa	15,9
A	21,5
Baa	17,4
nicht eingestuft	1,4

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	98,7 %
Mehr als 5 Jahre	1,3 %

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit

	Kurz	Mittel	Lang
Kreditqualität			
Staats-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays Global Aggregate Ex US MBS 1–5 Year Float Adjusted Bond Index.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

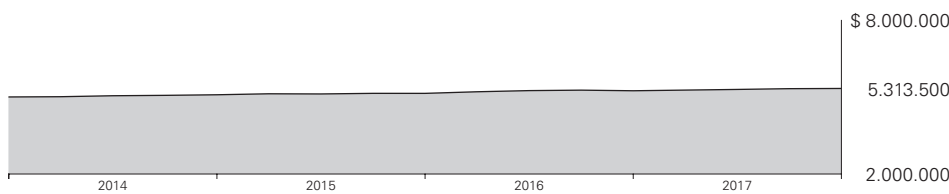
Global Short-Term Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Ex US MBS 1-5 Year Float Adjusted Bond Index USD Hedged

Abgesichert in US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 31. Januar 2014–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000

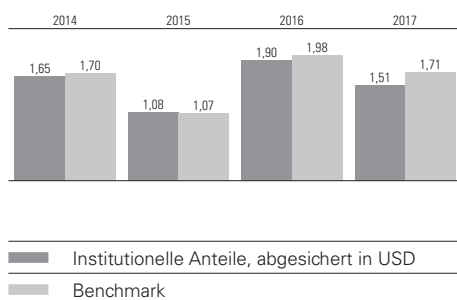


	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
— Institutionelle Anteile, abgesichert in USD	1,51 %	1,57 %	\$ 5.313.500
— Benchmark	1,71	1,65	5.330.778
<hr/>			
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von \$ 100.000
Anlegeranteile, abgesichert in USD	1,46 %	1,38 %	\$ 103.938
Benchmark	1,71	1,53	104.371
<hr/>			
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von \$ 200.000.000
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in USD	1,56 %	1,48 %	\$ 208.458.600
Benchmark	1,71	1,53	208.741.794

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,20 Prozentpunkte für institutionelle in USD abgesicherte Anteile, 0,25 Prozentpunkte für in USD abgesicherte Anlegeranteile und 0,15 Prozentpunkte für institutionelle in USD abgesicherte Plus-Anteile.²

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,20 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 31. Januar 2014–31. Dezember 2017



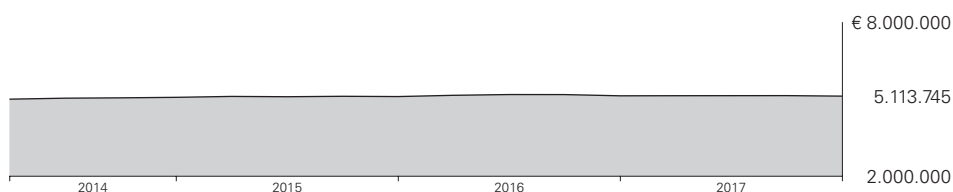
¹ Für institutionelle in USD abgesicherte Anteile, 31. Januar 2014; für in USD abgesicherte Anlegeranteile und institutionelle in USD abgesicherte Plus-Anteile, 10. März 2015.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Global Short-Term Bond Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Ex US MBS 1-5 Year Float Adjusted Bond Index Euro-Hedged

Abgesichert in Euro

Kumulative Wertentwicklung: 31. März 2014–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. € 5.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Anteile, abgesichert in Euro	-0,32 %	0,60 %	€ 5.113.745
Benchmark	-0,25	0,63	5.118.365

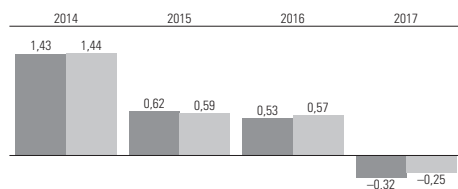
	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Anlegeranteile, abgesichert in Euro	-0,37 %	0,57 %	€ 102.139
Benchmark	-0,25	0,63	102.367

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in Euro	-0,27 %	0,65 %	€ 204.912.800
Benchmark	-0,25	0,63	204.734.593

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,07 Prozentpunkte für institutionelle in Euro abgesicherte Anteile, 0,12 Prozentpunkte für in Euro abgesicherte Anlegeranteile und 0,02 Prozentpunkte für institutionelle in Euro abgesicherte Plus-Anteile.²

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,20 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 31. März 2014–31. Dezember 2017



■	Institutionelle Anteile, abgesichert in Euro
■	Benchmark

1 31. März 2014.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

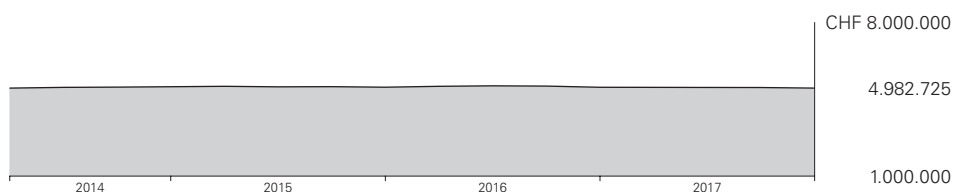
Global Short-Term Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Ex US MBS 1–5 Year Float Adjusted Bond Index CHF-Hedged

Abgesichert in Schweizer Franken

Kumulative Wertentwicklung: 31. März 2014–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. CHF 5.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von CHF 5.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
— Institutionelle Anteile, abgesichert in CHF	-0,90 %	-0,09 %	CHF 4.982.725
— Benchmark	-0,75	0,00	4.999.989

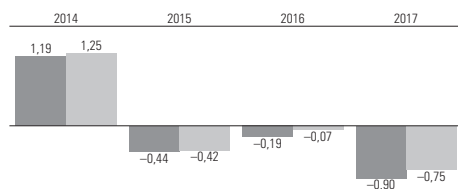
	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von CHF 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Anlegeranteile, abgesichert in CHF	-0,94 %	-0,13 %	CHF 99.523
Benchmark	-0,75	0,00	100.000

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von CHF 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in CHF	-0,85 %	-0,01 %	CHF 199.947.000
Benchmark	-0,75	0,00	199.999.565

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,15 Prozentpunkte für institutionelle in CHF abgesicherte Anteile, 0,19 Prozentpunkte für in CHF abgesicherte Anlegeranteile und 0,10 Prozentpunkte für institutionelle in CHF abgesicherte Plus-Anteile.²

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,20 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 31. März 2014–31. Dezember 2017



— Institutionelle Anteile, abgesichert in CHF
— Benchmark

1 31. März 2014.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

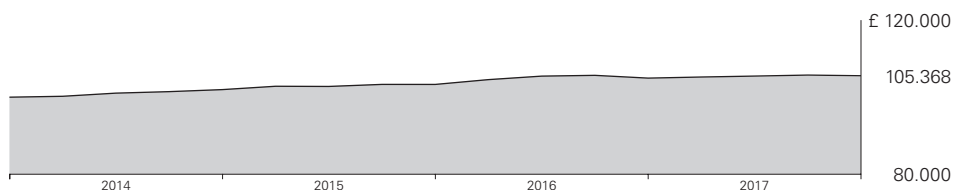
Global Short-Term Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Ex US MBS 1–5 Year Float Adjusted Bond Index CHF-Hedged

Abgesichert in GBP

Kumulative Wertentwicklung: 31. Januar 2014–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. £ 100.000

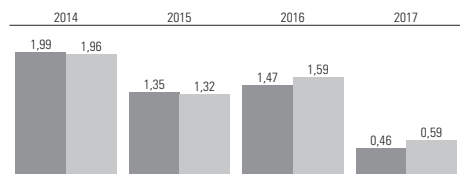


	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenden Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP	0,46 %	1,34 %	£ 105.368
Benchmark	0,59	1,39	105.564
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von £ 100.000
Ertragsanteile, abgesichert in GBP	0,46 %	1,35 %	£ 105.386
Benchmark	0,59	1,39	105.564
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	0,51 %	1,22 %	£ 208.257800
Benchmark	0,59	1,22	208.237508
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	0,51 %	1,24 %	£ 208.389.386
Benchmark	0,59	1,22	208.237508

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,13 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte Thesaurierungsanteile, 0,13 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte Ertragsanteile, 0,08 Prozentpunkte für institutionelle in GBP abgesicherte Plus-Thesaurierungsanteile und 0,08 Prozentpunkte für institutionelle in GBP abgesicherte Plus-Ertragsanteile.²

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,20 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 31. Januar 2014–31. Dezember 2017



Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP
Benchmark

1 Für in GBP abgesicherte Thesaurierungsanteile und in GBP abgesicherte Ertragsanteile, 31. Januar 2014; für institutionelle in GBP abgesicherte Plus-Thesaurierungsanteile und institutionelle in GBP abgesicherte Plus-Ertragsanteile, 2. September 2014.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

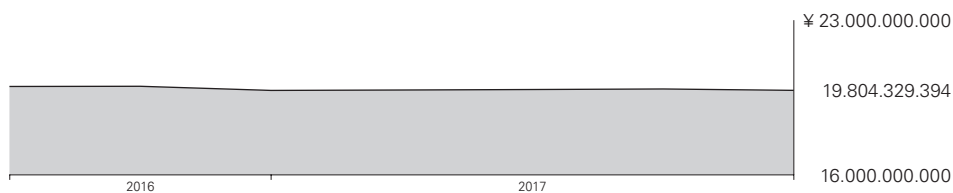
Global Short-Term Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Ex US MBS 1–5 Year Float Adjusted Bond Index JPY-Hedged

Abgesichert in japanischen Yen

Kumulative Wertentwicklung: 8. September 2016–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. ¥ 20.000.000.000

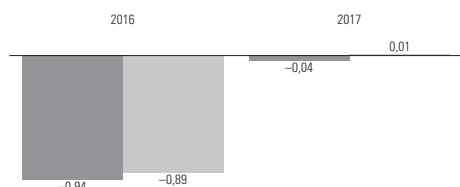


	Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von ¥ 20.000.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
■ Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in JPY	-0,04 %	-0,75 %	¥ 19.804.329.394
— Benchmark	0,01	-0,67	19.823.790.876

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,05 Prozentpunkte für institutionelle in JPY abgesicherte Plus-Anteile.²

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,20 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 8. September 2016–31. Dezember 2017



■ Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in JPY
— Benchmark

¹ 8. September 2016.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 98,27 % (2016: 98,85 %)					
Australien 2,27 % (2016: 2,06 %)					
Australia Government Bond	AUD 4.200.000	1,75 %	21.11.2020	3.249.634	0,24 %
Australia Government Bond	AUD 2.425.000	4,50 %	15.04.2020	1.999.673	0,14 %
Australia Government Bond	AUD 2.100.000	5,75 %	15.07.2022	1.884.722	0,14 %
Australia Government Bond	AUD 2.150.000	2,75 %	21.10.2019	1.704.247	0,12 %
Australia Government Bond	AUD 1.500.000	5,75 %	15.05.2021	1.308.148	0,09 %
New South Wales Treasury Corp.	AUD 1.000.000	6,00 %	01.03.2022	893.537	0,06 %
Western Australian Treasury Corp.	AUD 1.100.000	3,75 %	23.10.2018	872.833	0,06 %
Queensland Treasury Corp.	AUD 1.000.000	5,50 %	21.06.2021	863.329	0,06 %
Western Australian Treasury Corp.	AUD 1.000.000	2,50 %	22.07.2020	786.460	0,06 %
Queensland Treasury Corp.	AUD 900.000	6,25 %	21.02.2020	763.950	0,06 %
Westpac Banking Corp.	€ 600.000	0,25 %	17.01.2022	718.797	0,05 %
New South Wales Treasury Corp.	AUD 800.000	4,00 %	08.04.2021	659.080	0,05 %
Bank of Queensland Ltd.	€ 500.000	0,50 %	10.07.2022	606.368	0,04 %
National Australia Bank Ltd.	€ 500.000	0,25 %	28.03.2022	603.162	0,04 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 600.000	2,13 %	22.07.2020	595.656	0,04 %
Australia Government Bond	AUD 700.000	2,00 %	21.12.2021	542.147	0,04 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 500.000	2,25 %	10.01.2020	498.833	0,04 %
Macquarie Group Ltd.^	\$ 500.000	3,19 %	28.11.2023	496.496	0,04 %
Queensland Treasury Corp.	AUD 600.000	4,00 %	21.06.2019	482.943	0,03 %
Westpac Banking Corp.	AUD 500.000	7,25 %	11.02.2020	429.044	0,03 %
South Australian Government Financing Authority	AUD 500.000	5,00 %	20.05.2021	424.791	0,03 %
Australia Government Bond	AUD 500.000	5,25 %	15.03.2019	406.677	0,03 %
Commonwealth Bank of Australia	€ 300.000	1,13 %	22.12.2021	405.608	0,03 %
National Australia Bank Ltd.	€ 300.000	4,63 %	10.02.2020	393.614	0,03 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 375.000	2,25 %	13.03.2019	375.069	0,03 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.	\$ 325.000	2,88 %	24.02.2022	328.295	0,02 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 300.000	1,75 %	02.11.2018	299.301	0,02 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 300.000	2,05 %	15.03.2019	299.279	0,02 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 300.000	2,13 %	22.05.2020	297.758	0,02 %
Westpac Banking Corp.	\$ 300.000	2,10 %	13.05.2021	295.915	0,02 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 300.000	2,00 %	06.09.2021	293.677	0,02 %
Macquarie Bank Ltd.	\$ 275.000	2,60 %	24.06.2019	275.780	0,02 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 250.000	2,70 %	16.11.2020	251.310	0,02 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 250.000	2,25 %	13.06.2019	250.058	0,02 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 250.000	2,00 %	14.01.2019	249.434	0,02 %
Westpac Banking Corp.	€ 200.000	2,13 %	09.07.2019	249.035	0,02 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 250.000	2,05 %	23.09.2019	248.809	0,02 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 250.000	2,55 %	23.11.2021	248.486	0,02 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 250.000	2,13 %	19.08.2020	247.822	0,02 %
Scentre Group Trust 1	€ 200.000	1,50 %	16.07.2020	247.600	0,02 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 250.000	1,60 %	15.07.2019	247.552	0,02 %
National Australia Bank Ltd.	AUD 300.000	4,25 %	20.05.2019	240.866	0,02 %
Toyota Finance Australia Ltd.	AUD 300.000	4,25 %	15.05.2019	240.498	0,02 %
Suncorp-Metway Ltd.	\$ 225.000	2,38 %	09.11.2020	223.594	0,02 %
South Australian Government Financing Authority	AUD 250.000	4,75 %	06.08.2019	203.969	0,01 %
Westpac Banking Corp.	\$ 200.000	1,95 %	23.11.2018	200.028	0,01 %
Westpac Banking Corp.	\$ 200.000	2,10 %	25.02.2021	197.539	0,01 %
Scentre Group Trust 1/Scentre Group Trust 2	\$ 170.000	2,38 %	05.11.2019	169.597	0,01 %
New South Wales Treasury Corp.	AUD 200.000	3,50 %	20.03.2019	159.397	0,01 %
Macquarie Bank Ltd.	AUD 200.000	3,25 %	03.03.2020	158.526	0,01 %
Macquarie Group Ltd.	AUD 200.000	3,25 %	15.12.2022	155.324	0,01 %
WEA Finance LLC	\$ 150.000	3,15 %	05.04.2022	151.613	0,01 %
Macquarie Bank Ltd.	\$ 150.000	2,85 %	15.01.2021	150.586	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 150.000	2,75 %	10.03.2022	150.441	0,01 %
Macquarie Bank Ltd.	\$ 150.000	2,35 %	15.01.2019	150.025	0,01 %
Westpac Banking Corp.	\$ 150.000	2,50 %	28.06.2022	148.899	0,01 %
Telstra Corp., Ltd.	€ 100.000	4,25 %	23.03.2020	131.429	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	€ 100.000	5,50 %	06.08.2019	130.461	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	CAD 150.000	5,15 %	09.04.2020	127.044	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Westpac Banking Corp.	\$ 125.000	2,15 %	06.03.2020	124.395	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	€ 100.000	1,38 %	22.01.2019	122.268	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	€ 100.000	0,38 %	19.11.2019	121.528	0,01 %
Macquarie Bank Ltd.	€ 100.000	0,38 %	03.03.2021	121.352	0,01 %
Westpac Banking Corp.	\$ 100.000	4,88 %	19.11.2019	104.641	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 100.000	2,63 %	23.07.2020	100.507	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 100.000	2,25 %	10.03.2020	99.768	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 100.000	2,40 %	02.11.2020	99.757	0,01 %
Westpac Banking Corp.	\$ 100.000	2,00 %	21.05.2019	99.692	0,01 %
Westpac Banking Corp.	\$ 100.000	2,75 %	11.01.2023	99.650	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 100.000	2,05 %	18.09.2020	98.882	0,01 %
Western Australian Treasury Corp.	AUD 100.000	7,00 %	15.10.2019	84.868	0,01 %
Telstra Corp., Ltd.	AUD 100.000	4,50 %	13.11.2018	79.683	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 75.000	2,25 %	09.11.2020	74.550	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 75.000	2,63 %	09.11.2022	74.526	0,01 %
Westpac Banking Corp.	\$ 75.000	1,60 %	19.08.2019	74.174	0,01 %
Westpac Banking Corp.	\$ 75.000	2,00 %	19.08.2021	73.618	0,00 %
Macquarie Bank Ltd.	\$ 50.000	2,85 %	29.07.2020	50.260	0,00 %
National Australia Bank Ltd.	\$ 50.000	2,13 %	09.09.2019	49.885	0,00 %
Macquarie Bank Ltd.	\$ 50.000	2,40 %	21.01.2020	49.882	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 50.000	2,00 %	18.06.2019	49.819	0,00 %
Westpac Banking Corp.	\$ 50.000	2,00 %	03.03.2020	49.576	0,00 %
BHP Billiton Finance Ltd.	AUD 40.000	3,00 %	30.03.2020	31.559	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 25.000	2,30 %	06.09.2019	25.007	0,00 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 25.000	2,50 %	18.09.2022	24.731	0,00 %
QPH Finance Co. Pty Ltd.	AUD 10.000	5,75 %	29.07.2020	8.331	0,00 %
				31.377.674	2,27 %
Österreich 0,79 % (2016: 0,57 %)					
Republic of Austria Government Bond	€ 1.600.000	3,40 %	22.11.2022	2.251.271	0,16 %
Republic of Austria Government Bond	€ 1.300.000	3,50 %	15.09.2021	1.783.426	0,13 %
Republic of Austria Government Bond	€ 1.000.000	3,65 %	20.04.2022	1.399.749	0,10 %
Republic of Austria Government Bond	€ 900.000	3,90 %	15.07.2020	1.200.090	0,09 %
Republic of Austria Government Bond	€ 700.000	1,95 %	18.06.2019	870.761	0,06 %
UniCredit Bank Austria AG	€ 500.000	0,50 %	16.01.2020	608.929	0,04 %
Erste Group Bank AG	€ 300.000	4,00 %	20.01.2021	405.106	0,03 %
OeBB-Infrastruktur AG	€ 300.000	3,50 %	19.10.2020	398.431	0,03 %
OMV AG	€ 300.000	4,38 %	10.02.2020	393.432	0,03 %
Republic of Austria Government Bond	€ 300.000	0,25 %	18.10.2019	365.065	0,03 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	\$ 300.000	1,75 %	24.01.2020	297.781	0,02 %
Autobahnen- und Schnell- strassen-Finanzierungs AG	€ 200.000	4,38 %	08.07.2019	257.872	0,02 %
Republic of Austria Government Bond	€ 150.000	4,35 %	15.03.2019	190.681	0,01 %
Hypoe NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG	€ 100.000	0,50 %	11.09.2020	121.815	0,01 %
KA Finanz AG	€ 100.000	0,38 %	11.08.2020	121.756	0,01 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	\$ 100.000	1,13 %	26.04.2019	98.764	0,01 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	\$ 100.000	1,38 %	10.02.2020	98.376	0,01 %
				10.863.305	0,79 %
Belgien 1,18 % (2016: 1,01 %)					
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 2.800.000	4,00 %	28.03.2022	3.972.419	0,29 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 1.400.000	3,75 %	28.09.2020	1.875.069	0,13 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 1.160.000	4,00 %	28.03.2019	1.471.408	0,10 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 965.000	4,25 %	28.09.2021	1.357.532	0,10 %
KBC Bank NV	€ 800.000	1,00 %	25.02.2019	975.878	0,07 %
Dexia Credit Local SA	€ 500.000	0,88 %	07.09.2021	670.493	0,05 %
Dexia Credit Local SA	€ 500.000	1,38 %	18.09.2019	617.992	0,04 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 500.000	0,63 %	17.03.2020	608.579	0,04 %
Kingdom of Belgium Government Bond	€ 400.000	3,00 %	28.09.2019	509.841	0,04 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 400.000	3,75 %	15.01.2022	417.586	0,03 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 300.000	2,25 %	24.09.2020	381.512	0,03 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 300.000	0,88 %	17.03.2022	368.950	0,03 %
Belfius Bank SA	€ 300.000	0,75 %	12.09.2022	361.108	0,02 %
Dexia Credit Local SA	\$ 300.000	2,25 %	18.02.2020	299.261	0,02 %
Kingdom of Belgium Government International Bond	\$ 300.000	1,13 %	03.08.2019	295.488	0,02 %
Dexia Credit Local SA	€ 200.000	2,00 %	22.01.2021	255.605	0,02 %
Dexia Credit Local SA	\$ 250.000	2,38 %	20.09.2022	246.916	0,02 %
KBC Group NV	€ 200.000	1,00 %	26.04.2021	245.947	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Dexia Credit Local SA	\$ 250.000	1,88 %	15.09.2021	244.120	0,02 %
Dexia Credit Local SA	€ 200.000	0,25 %	19.03.2020	242.818	0,02 %
Dexia Credit Local SA	€ 200.000	0,20 %	16.03.2021	242.379	0,02 %
Dexia Credit Local SA	£ 100.000	2,00 %	17.06.2020	138.601	0,01 %
Argenta Spaarbank NV^	€ 100.000	3,88 %	24.05.2026	130.263	0,01 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 100.000	2,00 %	16.12.2019	125.002	0,01 %
Belfius Bank SA	€ 100.000	0,63 %	14.10.2021	122.979	0,01 %
Belfius Bank SA	€ 100.000	0,38 %	27.11.2019	121.677	0,01 %
				16.299.423	1,18 %
Bermuda 0,01 % (2016: 0,00 %)					
Allied World Assurance Co. Holdings Ltd.	\$ 50.000	5,50 %	15.11.2020	53.202	0,01 %
Enstar Group Ltd.	\$ 25.000	4,50 %	10.03.2022	25.500	0,00 %
				78.702	0,01 %
Brasilien 0,06 % (2016: 0,08 %)					
Braskem Finance Ltd.	\$ 200.000	5,75 %	15.04.2021	212.750	0,01 %
Vale Overseas Ltd.	\$ 150.000	4,38 %	11.01.2022	155.250	0,01 %
Vale Overseas Ltd.	\$ 125.000	4,63 %	15.09.2020	132.344	0,01 %
Vale Overseas Ltd.	\$ 100.000	5,88 %	10.06.2021	109.125	0,01 %
Gerdau Holdings, Inc.	\$ 100.000	7,00 %	20.01.2020	107.125	0,01 %
Gerdau Trade, Inc.	\$ 100.000	5,75 %	30.01.2021	106.375	0,01 %
				822.969	0,06 %
Kanada 4,48 % (2016: 4,36 %)					
Canadian Government Bond	CAD 4.750.000	0,75 %	01.09.2021	3.651.277	0,26 %
Canadian Government Bond	CAD 2.900.000	1,25 %	01.11.2019	2.296.369	0,17 %
Canadian Government Bond	CAD 2.900.000	1,00 %	01.09.2022	2.225.312	0,16 %
Canadian Government Bond	CAD 2.500.000	0,75 %	01.05.2019	1.972.704	0,14 %
Provinz Quebec (Kanada)	€ 1.200.000	5,00 %	29.04.2019	1.543.852	0,11 %
Canadian Government Bond	CAD 1.580.000	1,50 %	01.03.2020	1.255.211	0,09 %
Province Ontario Kanada	CAD 1.250.000	4,20 %	02.06.2020	1.050.970	0,08 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 1.200.000	2,40 %	15.12.2022	969.003	0,07 %
Canadian Government Bond	CAD 1.175.000	3,75 %	01.06.2019	965.301	0,07 %
Canadian Government Bond	CAD 1.220.000	0,50 %	01.03.2022	921.930	0,07 %
Province Ontario Kanada	CAD 1.000.000	3,15 %	02.06.2022	830.025	0,06 %
Canadian Government Bond	CAD 1.000.000	0,75 %	01.08.2019	786.751	0,06 %
Canadian Government Bond	CAD 925.000	2,75 %	01.06.2022	766.769	0,05 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 950.000	2,00 %	15.12.2019	761.418	0,05 %
Canadian Government Bond	CAD 896.000	1,75 %	01.09.2019	716.035	0,05 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 900.000	1,20 %	15.06.2020	707.171	0,05 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 900.000	1,50 %	15.12.2021	703.314	0,05 %
Canadian Government Bond	CAD 900.000	0,75 %	01.03.2021	696.181	0,05 %
Export Development Canada	£ 500.000	1,00 %	15.12.2020	680.686	0,05 %
Province Ontario Kanada	CAD 800.000	4,40 %	02.06.2019	662.073	0,05 %
Canadian Government Bond	CAD 750.000	3,25 %	01.06.2021	627.439	0,04 %
CDP Financial, Inc.	\$ 600.000	4,40 %	25.11.2019	624.202	0,04 %
Royal Bank of Canada	€ 500.000	0,50 %	16.12.2020	610.630	0,04 %
Bank of Montreal	€ 500.000	0,13 %	19.04.2021	603.243	0,04 %
Bank of Nova Scotia	€ 500.000	0,13 %	13.01.2022	600.904	0,04 %
Bank of Montreal	€ 500.000	0,20 %	26.01.2023	598.265	0,04 %
Bank of Montreal	\$ 600.000	1,75 %	15.06.2021	582.794	0,04 %
Canadian Government Bond	CAD 700.000	3,50 %	01.06.2020	581.967	0,04 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 715.000	1,25 %	15.12.2020	559.737	0,04 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 700.000	1,15 %	15.12.2021	539.642	0,04 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 600.000	4,25 %	01.12.2021	517.754	0,04 %
Province Ontario Kanada	\$ 450.000	4,40 %	14.04.2020	471.491	0,03 %
Toronto-Dominion Bank	CAD 600.000	1,68 %	08.06.2021	469.192	0,03 %
Canadian Government Bond	CAD 545.000	1,75 %	01.03.2019	435.935	0,03 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 500.000	4,50 %	01.12.2020	427.204	0,03 %
Province Ontario Kanada	\$ 425.000	2,00 %	30.01.2019	425.119	0,03 %
Province Ontario Kanada	CAD 500.000	4,00 %	02.06.2021	424.422	0,03 %
Bank of Montreal^	CAD 500.000	3,32 %	01.06.2026	405.547	0,03 %
Bank of Nova Scotia	CAD 500.000	2,09 %	09.09.2020	396.867	0,03 %
Export Development Canada	AUD 500.000	3,25 %	22.05.2018	393.168	0,03 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	CAD 500.000	2,04 %	21.03.2022	392.007	0,03 %
Export Development Canada	AUD 500.000	2,40 %	07.06.2021	390.034	0,03 %
Bank of Nova Scotia	€ 300.000	0,38 %	06.04.2022	360.020	0,03 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Canada Housing Trust No 1	CAD 440.000	1,95 %	15.06.2019	352.404	0,02 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 400.000	1,45 %	15.06.2020	316.198	0,02 %
HSBC Bank Canada	CAD 400.000	2,17 %	29.06.2022	313.149	0,02 %
Royal Bank of Canada	CAD 400.000	2,00 %	21.03.2022	312.973	0,02 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 400.000	1,25 %	15.06.2021	311.380	0,02 %
Toronto-Dominion Bank	\$ 300.000	2,50 %	14.12.2020	300.941	0,02 %
Toronto-Dominion Bank	\$ 300.000	2,50 %	18.01.2022	299.250	0,02 %
CPPIB Capital, Inc.	\$ 300.000	2,25 %	25.01.2022	298.098	0,02 %
Province Ontario Kanada	\$ 300.000	1,25 %	17.06.2019	296.350	0,02 %
Bank of Montreal	\$ 300.000	1,90 %	27.08.2021	293.603	0,02 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 350.000	4,50 %	01.12.2019	293.224	0,02 %
Province of Alberta Canada	CAD 350.000	2,55 %	15.12.2022	282.869	0,02 %
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust	\$ 280.000	3,13 %	20.03.2022	282.201	0,02 %
Province of Manitoba Canada	CAD 325.000	4,75 %	11.02.2020	274.676	0,02 %
Provinz Quebec (Kanada)	CAD 325.000	3,50 %	01.12.2022	274.461	0,02 %
Province Ontario Kanada	€ 200.000	4,00 %	03.12.2019	260.171	0,02 %
Canada Government International Bond	€ 200.000	3,50 %	13.01.2020	259.347	0,02 %
Bank of Nova Scotia	\$ 250.000	2,70 %	07.03.2022	249.557	0,02 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 300.000	3,35 %	15.12.2020	249.197	0,02 %
National Bank of Canada	\$ 250.000	2,15 %	12.06.2020	248.825	0,02 %
Ontario Teachers' Finance Trust	\$ 250.000	2,13 %	19.09.2022	245.256	0,02 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 300.000	2,65 %	15.03.2022	244.956	0,02 %
Bank of Montreal	\$ 250.000	2,50 %	11.01.2022	244.417	0,02 %
Royal Bank of Canada^	CAD 300.000	3,45 %	29.09.2026	244.262	0,02 %
Bank of Nova Scotia	€ 200.000	0,50 %	23.07.2020	244.127	0,02 %
Toronto-Dominion Bank	€ 200.000	0,38 %	12.01.2021	243.398	0,02 %
Caisse Centrale Desjardins	€ 200.000	0,38 %	25.11.2020	243.244	0,02 %
Bank of Montreal	CAD 300.000	2,84 %	04.06.2020	242.761	0,02 %
Toronto-Dominion Bank^	CAD 300.000	2,98 %	30.09.2025	241.755	0,02 %
Toronto-Dominion Bank	CAD 300.000	2,62 %	22.12.2021	241.190	0,02 %
Royal Bank of Canada	CAD 300.000	2,03 %	15.03.2021	236.657	0,02 %
Canada Government International Bond	\$ 240.000	2,00 %	15.11.2022	236.649	0,02 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 300.000	1,75 %	15.06.2022	235.855	0,02 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	CAD 300.000	1,90 %	26.04.2021	235.652	0,02 %
Canada Housing Trust No 1	CAD 275.000	3,80 %	15.06.2021	232.631	0,02 %
Royal Bank of Canada	CAD 300.000	1,58 %	13.09.2021	232.431	0,02 %
Bank of Montreal	CAD 300.000	1,61 %	28.10.2021	232.266	0,02 %
Export Development Canada	\$ 225.000	1,50 %	26.05.2021	219.764	0,02 %
Barrick North America Finance LLC	\$ 200.000	4,40 %	30.05.2021	211.567	0,01 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 200.000	5,70 %	15.10.2019	210.250	0,01 %
Canada Government International Bond	\$ 210.000	1,63 %	27.02.2019	209.527	0,01 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 250.000	4,10 %	18.12.2019	208.292	0,01 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 250.000	3,25 %	18.12.2021	208.183	0,01 %
Province Ontario Kanada	\$ 200.000	4,00 %	07.10.2019	206.310	0,01 %
Agrium, Inc.	\$ 200.000	3,15 %	01.10.2022	202.154	0,01 %
Provinz Britisch-Kolumbien	\$ 200.000	2,65 %	22.09.2021	202.088	0,01 %
Royal Bank of Canada	\$ 200.000	2,50 %	19.01.2021	200.321	0,01 %
Provinz Quebec (Kanada)	\$ 200.000	2,38 %	31.01.2022	199.370	0,01 %
Bank of Nova Scotia	\$ 200.000	2,05 %	05.06.2019	199.322	0,01 %
Royal Bank of Canada	\$ 200.000	2,13 %	02.03.2020	199.183	0,01 %
Export Development Canada	\$ 200.000	1,50 %	04.04.2019	198.735	0,01 %
Bank of Montreal	\$ 200.000	2,10 %	15.06.2020	198.585	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	\$ 200.000	2,25 %	15.03.2021	198.561	0,01 %
Royal Bank of Canada	\$ 200.000	2,10 %	14.10.2020	198.079	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	\$ 200.000	1,95 %	02.04.2020	198.018	0,01 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	\$ 200.000	2,35 %	27.07.2022	197.394	0,01 %
Bank of Nova Scotia	\$ 200.000	1,88 %	26.04.2021	195.615	0,01 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 175.000	3,00 %	15.08.2022	173.469	0,01 %
Rogers Communications, Inc.	CAD 200.000	5,34 %	22.03.2021	173.396	0,01 %
Bank of Nova Scotia^	CAD 200.000	3,37 %	08.12.2025	162.410	0,01 %
Bank of Montreal^	CAD 200.000	3,34 %	08.12.2025	162.335	0,01 %
Bank of Nova Scotia^	CAD 200.000	3,04 %	18.10.2024	161.751	0,01 %
Hydro-Quebec	CAD 150.000	9,63 %	15.07.2022	157.425	0,01 %
Canadian National Railway Co.	\$ 150.000	5,55 %	01.03.2019	155.649	0,01 %
Province of Alberta Canada	CAD 200.000	1,35 %	01.09.2021	155.440	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 150.000	3,80 %	01.10.2020	155.424	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Husky Energy, Inc.	\$ 150.000	3,95 %	15.04.2022	155.301	0,01 %
Provinz Neubraunschweig	CAD 200.000	1,55 %	04.05.2022	155.155	0,01 %
Alimentation Couche-Tard, Inc.	\$ 150.000	2,35 %	13.12.2019	149.783	0,01 %
Province of Alberta Canada	\$ 150.000	1,90 %	06.12.2019	149.117	0,01 %
Bank of Montreal	\$ 150.000	1,50 %	18.07.2019	148.567	0,01 %
Province of Alberta Canada	\$ 150.000	2,20 %	26.07.2022	147.848	0,01 %
Province of Alberta Canada	\$ 150.000	1,75 %	26.08.2020	147.819	0,01 %
Royal Bank of Canada	£ 100.000	1,13 %	22.12.2021	135.538	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	£ 100.000	1,00 %	13.12.2021	134.907	0,01 %
Agrium, Inc.	\$ 120.000	6,75 %	15.01.2019	125.266	0,01 %
Royal Bank of Canada	\$ 125.000	1,50 %	29.07.2019	123.649	0,01 %
Inter Pipeline Ltd.	CAD 150.000	3,45 %	20.07.2020	122.422	0,01 %
Bell Canada, Inc.	CAD 150.000	3,25 %	17.06.2020	122.397	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	€ 100.000	0,50 %	15.06.2020	122.102	0,01 %
Royal Bank of Canada	€ 100.000	0,75 %	19.06.2019	122.038	0,01 %
Loblaw Cos Ltd.	CAD 150.000	3,75 %	12.03.2019	122.009	0,01 %
Shaw Communications, Inc.	CAD 150.000	3,15 %	19.02.2021	121.760	0,01 %
Bank of Montreal	€ 100.000	0,38 %	05.08.2020	121.702	0,01 %
HSBC Bank Canada	CAD 150.000	2,91 %	29.09.2021	121.348	0,01 %
Royal Bank of Canada	€ 100.000	0,13 %	11.03.2021	120.685	0,01 %
Province Ontario Kanada	CAD 150.000	2,10 %	08.09.2019	120.327	0,01 %
Royal Bank of Canada	CAD 150.000	2,35 %	09.12.2019	120.145	0,01 %
Sun Life Financial, Inc.^	CAD 150.000	2,60 %	25.09.2025	119.865	0,01 %
Royal Bank of Canada	CAD 150.000	1,40 %	26.04.2019	118.921	0,01 %
Manufacturers Life Insurance Co.^	CAD 150.000	2,10 %	01.06.2025	118.836	0,01 %
Royal Bank of Canada	CAD 150.000	1,92 %	17.07.2020	118.685	0,01 %
CPPIB Capital, Inc.	CAD 150.000	1,10 %	10.06.2019	118.536	0,01 %
Province of Manitoba Canada	CAD 150.000	1,55 %	05.09.2021	117.406	0,01 %
Canadian Pacific Railway Co.	\$ 100.000	7,25 %	15.05.2019	106.516	0,01 %
Thomson Reuters Corp.	\$ 100.000	4,70 %	15.10.2019	103.912	0,01 %
Hydro-Quebec	CAD 100.000	10,50 %	15.10.2021	103.683	0,01 %
Thomson Reuters Corp.	\$ 100.000	3,95 %	30.09.2021	103.283	0,01 %
Ontario Electricity Financial Corp.	CAD 100.000	10,75 %	06.08.2021	103.204	0,01 %
Provinz Quebec (Kanada)	\$ 100.000	3,50 %	29.07.2020	103.159	0,01 %
Royal Bank of Canada	\$ 100.000	2,75 %	01.02.2022	100.944	0,01 %
Bank of Montreal	\$ 100.000	2,38 %	25.01.2019	100.147	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	\$ 100.000	2,25 %	05.11.2019	100.119	0,01 %
Bank of Nova Scotia	\$ 100.000	2,35 %	21.10.2020	99.759	0,01 %
Export Development Canada	\$ 100.000	1,75 %	19.08.2019	99.660	0,01 %
Province Ontario Kanada	\$ 100.000	1,63 %	18.01.2019	99.653	0,01 %
Bank of Nova Scotia	\$ 100.000	2,15 %	14.07.2020	99.562	0,01 %
Schlumberger Finance Canada Ltd.	\$ 100.000	2,20 %	20.11.2020	99.504	0,01 %
Export Development Canada	\$ 100.000	1,63 %	03.12.2019	99.292	0,01 %
Export Development Canada	\$ 100.000	1,25 %	04.02.2019	99.280	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 100.000	2,50 %	01.08.2022	99.166	0,01 %
Province Ontario Kanada	\$ 100.000	1,88 %	21.05.2020	99.159	0,01 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	\$ 100.000	2,10 %	05.10.2020	99.152	0,01 %
PSP Capital, Inc.	CAD 125.000	1,73 %	21.06.2022	97.653	0,01 %
Fortis, Inc.	\$ 100.000	2,10 %	04.10.2021	97.539	0,01 %
Export Development Canada	\$ 100.000	1,38 %	21.10.2021	96.813	0,01 %
TD Capital Trust IV^	CAD 100.000	6,63 %	30.06.2108	89.474	0,01 %
Fairfax Financial Holdings Ltd.	CAD 100.000	6,40 %	25.05.2021	88.374	0,01 %
Manulife Financial Capital Trust II^	CAD 100.000	7,41 %	31.12.2108	87.078	0,01 %
TELUS Corp.	CAD 100.000	5,05 %	23.07.2020	85.131	0,01 %
Municipal Finance Authority of British Columbia	CAD 100.000	4,15 %	01.06.2021	85.110	0,01 %
Capital Desjardins, Inc.	CAD 100.000	5,19 %	05.05.2020	84.805	0,01 %
CDP Financial, Inc.	CAD 100.000	4,60 %	15.07.2020	84.797	0,01 %
Rogers Communications, Inc.	CAD 100.000	4,70 %	29.09.2020	84.679	0,01 %
Municipal Finance Authority of British Columbia	CAD 100.000	4,45 %	01.06.2020	84.424	0,01 %
SNC-Lavalin Group Inc.	CAD 100.000	6,19 %	03.07.2019	84.151	0,01 %
Thomson Reuters Corp.	CAD 100.000	4,35 %	30.09.2020	83.883	0,01 %
TD Capital Trust III^	CAD 100.000	7,24 %	31.12.2166	83.817	0,01 %
Provinz Britisch-Kolumbien	CAD 100.000	3,70 %	18.12.2020	83.798	0,01 %
Teranet Holdings LP	CAD 100.000	4,81 %	16.12.2020	83.780	0,01 %
Enbridge Pipelines, Inc.	CAD 100.000	4,45 %	06.04.2020	83.653	0,01 %
TransAlta Corp.	CAD 100.000	5,00 %	25.11.2020	83.139	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Canada Housing Trust No 1	CAD 100.000	3,75 %	15.03.2020	83.133	0,01 %
Province of Alberta Canada	CAD 100.000	4,00 %	01.12.2019	83.029	0,01 %
Cameco Corp.	CAD 100.000	5,67 %	02.09.2019	82.682	0,01 %
Brookfield Infrastructure Finance ULC	CAD 100.000	3,54 %	30.10.2020	81.545	0,01 %
Suncor Energy, Inc.	CAD 100.000	3,10 %	26.11.2021	81.437	0,01 %
Veresen, Inc.	CAD 100.000	3,43 %	10.11.2021	81.407	0,01 %
Canadian Imperial Bank of Commerce^	CAD 100.000	3,42 %	26.01.2026	81.258	0,01 %
Bell Canada, Inc.	CAD 100.000	3,35 %	18.06.2019	81.171	0,01 %
Royal Bank of Canada^	CAD 100.000	3,31 %	20.01.2026	81.043	0,01 %
WestJet Airlines Ltd.	CAD 100.000	3,29 %	23.07.2019	80.816	0,01 %
Financement-Quebec	CAD 100.000	2,45 %	01.12.2019	80.689	0,01 %
Royal Bank of Canada^	CAD 100.000	3,04 %	17.07.2024	80.500	0,01 %
Canadian Natural Resources Ltd.	CAD 100.000	2,89 %	14.08.2020	80.480	0,01 %
HSBC Bank Canada	CAD 100.000	2,49 %	13.05.2019	80.214	0,01 %
National Bank of Canada	CAD 100.000	2,40 %	28.10.2019	80.198	0,01 %
VW Credit Canada, Inc.	CAD 100.000	2,50 %	01.10.2019	80.095	0,01 %
CI Financial Corp.	CAD 100.000	2,65 %	07.12.2020	79.960	0,01 %
HSBC Bank Canada	CAD 100.000	2,45 %	29.01.2021	79.757	0,01 %
Alimentation Couche-Tard, Inc.	\$ 80.000	2,70 %	26.07.2022	79.034	0,01 %
Hydro-Quebec	CAD 100.000	1,00 %	25.05.2019	79.022	0,01 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	CAD 100.000	2,30 %	11.07.2022	79.018	0,01 %
Caisse Centrale Desjardins	CAD 100.000	1,75 %	02.03.2020	78.995	0,01 %
Hydro One, Inc.	CAD 100.000	1,48 %	18.11.2019	78.979	0,01 %
Hydro One, Inc.	CAD 100.000	1,84 %	24.02.2021	78.804	0,01 %
Federation des Caisses Desjardins du Quebec	CAD 100.000	2,09 %	17.01.2022	78.607	0,00 %
Province of Newfoundland & Labrador Canada	CAD 100.000	1,95 %	02.06.2022	78.567	0,00 %
Province of Alberta Canada	CAD 100.000	1,25 %	01.06.2020	78.557	0,00 %
National Bank of Canada	CAD 100.000	1,81 %	26.07.2021	78.194	0,00 %
PSP Capital, Inc.	CAD 100.000	1,34 %	18.08.2021	77.674	0,00 %
Province Ontario Kanada	CAD 100.000	1,35 %	08.03.2022	77.199	0,00 %
Emera US Finance LP	\$ 75.000	2,70 %	15.06.2021	74.572	0,00 %
Province Ontario Kanada	\$ 75.000	2,25 %	18.05.2022	74.212	0,00 %
Provinz Neubraunschweig	CAD 75.000	4,50 %	02.06.2020	63.443	0,00 %
Province of Nova Scotia Canada	CAD 75.000	4,15 %	25.11.2019	62.414	0,00 %
Royal Bank of Canada^	CAD 75.000	2,99 %	06.12.2024	60.653	0,00 %
Bank of Nova Scotia	CAD 75.000	2,40 %	28.10.2019	60.176	0,00 %
WestJet Airlines Ltd.	\$ 50.000	3,50 %	16.06.2021	50.397	0,00 %
Royal Bank of Canada	\$ 50.000	2,35 %	30.10.2020	49.960	0,00 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 50.000	2,13 %	15.11.2019	49.847	0,00 %
Schlumberger Finance Canada Ltd.	\$ 50.000	2,65 %	20.11.2022	49.694	0,00 %
Enbridge, Inc.	\$ 50.000	2,90 %	15.07.2022	49.591	0,00 %
Royal Bank of Canada	\$ 50.000	1,88 %	05.02.2020	49.555	0,00 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	\$ 50.000	1,60 %	06.09.2019	49.458	0,00 %
Bank of Nova Scotia	\$ 50.000	1,85 %	14.04.2020	49.455	0,00 %
Hydro-Quebec	CAD 50.000	11,00 %	15.08.2020	49.043	0,00 %
407 International, Inc.	CAD 50.000	4,99 %	16.06.2020	42.571	0,00 %
Shaw Communications, Inc.	CAD 50.000	5,65 %	01.10.2019	42.174	0,00 %
Enbridge, Inc.	CAD 50.000	4,77 %	02.09.2019	41.457	0,00 %
Bank of Montreal^	CAD 50.000	3,12 %	19.09.2024	40.309	0,00 %
Caisse Centrale Desjardins	CAD 50.000	2,44 %	17.07.2019	40.115	0,00 %
Provinz Neubraunschweig	\$ 40.000	2,50 %	12.12.2022	39.867	0,00 %
CPPIB Capital, Inc.	CAD 50.000	1,00 %	15.01.2019	39.639	0,00 %
National Bank of Canada	CAD 50.000	1,74 %	03.03.2020	39.492	0,00 %
Saputo, Inc.	CAD 50.000	1,94 %	13.06.2022	38.685	0,00 %
Canadian Imperial Bank of Commerce^	CAD 40.000	3,00 %	28.10.2024	32.194	0,00 %
Emera US Finance LP	\$ 25.000	2,15 %	15.06.2019	24.864	0,00 %
Rogers Communications, Inc.	CAD 30.000	2,80 %	13.03.2019	24.154	0,00 %
Export Development Canada	CAD 25.000	1,80 %	01.09.2022	19.710	0,00 %
				61.868.084	4,48 %
Kaimaninseln 0,03 % (2016: 0,06 %)					
IPIC GMTN Ltd.	\$ 250.000	5,00 %	15.11.2020	266.645	0,02 %
ADCB Finance Cayman Ltd.	\$ 200.000	2,63 %	10.03.2020	198.498	0,01 %
				465.143	0,03 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
China 0,96 % (2016: 0,64 %)					
BOC Aviation Ltd.	\$ 900.000	2,38 %	15.09.2021	875.655	0,06 %
China Development Bank Corp.	€ 500.000	0,13 %	24.01.2020	597.743	0,04 %
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	\$ 550.000	3,38 %	24.01.2020	549.351	0,04 %
Huarong Finance II Co., Ltd.	\$ 525.000	4,50 %	16.01.2020	536.114	0,04 %
ICBCIL Finance Co., Ltd.	\$ 500.000	3,00 %	05.04.2020	498.750	0,04 %
Horsepower Finance Ltd.	\$ 500.000	2,35 %	13.03.2020	493.720	0,04 %
China Development Bank	\$ 500.000	1,63 %	22.06.2019	493.125	0,04 %
Export-Import Bank von China	€ 400.000	0,75 %	28.05.2023	475.277	0,03 %
China Overseas Finance Cayman II Ltd.	\$ 375.000	5,50 %	10.11.2020	399.893	0,03 %
Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd.	\$ 400.000	2,50 %	28.04.2020	397.458	0,03 %
China Development Bank	€ 300.000	0,50 %	01.06.2021	360.174	0,03 %
China Development Bank	€ 300.000	0,38 %	16.11.2021	357.610	0,03 %
Bank of China Hong Kong Ltd.	\$ 300.000	5,55 %	11.02.2020	315.431	0,02 %
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	\$ 300.000	3,23 %	13.11.2019	302.306	0,02 %
State Grid Overseas Investment 2014 Ltd.	\$ 300.000	2,75 %	07.05.2019	300.747	0,02 %
CNPC General Capital Ltd.	\$ 300.000	2,75 %	14.05.2019	300.387	0,02 %
Azure Orbit III International Finance Ltd.	\$ 300.000	2,63 %	21.03.2021	295.110	0,02 %
Baidu, Inc.	\$ 275.000	2,88 %	06.07.2022	272.019	0,02 %
Azure Nova International Finance Ltd.	\$ 250.000	3,50 %	21.03.2022	250.955	0,02 %
State Elite Global Ltd.	\$ 250.000	3,13 %	20.01.2020	250.643	0,02 %
Agricultural Bank of China Ltd.	\$ 250.000	2,75 %	21.05.2020	249.201	0,02 %
Huarong Finance II Co., Ltd.^	\$ 250.000	2,88 %	14.03.2166	243.295	0,02 %
Export-Import Bank von China	€ 200.000	0,63 %	02.12.2021	240.284	0,02 %
Alibaba Group Holding Ltd.	\$ 225.000	2,50 %	28.11.2019	225.283	0,02 %
China Great Wall International Holdings III Ltd.	\$ 230.000	2,63 %	27.10.2021	223.976	0,02 %
Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd.	\$ 200.000	3,90 %	17.05.2022	206.782	0,02 %
Sino-Ocean Land Treasure Finance II Ltd.	\$ 200.000	4,45 %	04.02.2020	203.250	0,02 %
Alibaba Group Holding Ltd.	\$ 200.000	3,13 %	28.11.2021	203.091	0,02 %
China Construction Bank Asia Corp., Ltd.^	\$ 200.000	4,25 %	20.08.2024	203.000	0,02 %
China Construction Bank Corp.^	\$ 200.000	3,88 %	13.05.2025	201.764	0,02 %
Tencent Holdings Ltd.	\$ 200.000	2,88 %	11.02.2020	201.302	0,02 %
Bank of China Ltd.	\$ 200.000	2,88 %	30.06.2020	200.482	0,01 %
ICBCIL Finance Co., Ltd.	\$ 200.000	3,25 %	17.03.2020	200.242	0,01 %
Bluestar Finance Holdings Ltd.	\$ 200.000	3,50 %	30.09.2021	199.984	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.	\$ 200.000	3,00 %	12.04.2022	199.798	0,01 %
China Cinda Finance 2015 I Ltd.	\$ 200.000	3,13 %	23.04.2020	199.468	0,01 %
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.	\$ 200.000	2,75 %	04.05.2022	198.019	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.	\$ 200.000	2,25 %	13.09.2020	197.524	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.	\$ 200.000	2,50 %	13.09.2022	195.607	0,01 %
Charming Light Investments Ltd.	\$ 200.000	2,38 %	30.08.2021	193.202	0,01 %
CNPC General Capital Ltd.	\$ 125.000	2,75 %	14.05.2019	125.173	0,01 %
China Construction Bank Asia Corp., Ltd.	€ 100.000	1,50 %	11.02.2020	122.606	0,01 %
CITIC Ltd.	\$ 100.000	6,63 %	15.04.2021	110.375	0,01 %
Sinochem Overseas Capital Co., Ltd.	\$ 100.000	4,50 %	12.11.2020	104.398	0,01 %
Tencent Holdings Ltd.	\$ 50.000	3,38 %	02.05.2019	50.572	0,00 %
Semiconductor Manufacturing International Corp.	\$ 50.000	4,13 %	07.10.2019	50.500	0,00 %
Sinochem Offshore Capital Co., Ltd.	\$ 50.000	3,25 %	29.04.2019	50.196	0,00 %
Export-Import Bank von China	\$ 50.000	2,50 %	31.07.2019	50.009	0,00 %
CNOOC Finance 2015 Australia Pty Ltd.	\$ 50.000	2,63 %	05.05.2020	49.815	0,00 %
				13.221.666	0,96 %
Kolumbien 0,05 % (2016: 0,06 %)					
Colombia Government International Bond	\$ 490.000	7,38 %	18.03.2019	519.013	0,03 %
Colombia Government International Bond	\$ 100.000	11,75 %	25.02.2020	119.342	0,01 %
Ecopetrol SA	\$ 100.000	7,63 %	23.07.2019	107.262	0,01 %
				745.617	0,05 %
Tschechische Republik 0,10 % (2016: 0,13 %)					
Czech Republic Government Bond	Kč 15.000.000	3,75 %	12.09.2020	760.231	0,06 %
Tschechische Republik Internationale	€ 200.000	4,13 %	18.03.2020	263.628	0,02 %
Czech Republic Government Bond	Kč 4.000.000	5,00 %	11.04.2019	198.881	0,01 %
Czech Republic Government Bond	Kč 2.000.000	1,50 %	29.10.2019	95.390	0,01 %
				1.318.130	0,10 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Dänemark 0,57 % (2016: 0,56 %)					
Denmark Government Bond	DKK(kr) 11.900.000	4,00 %	15.11.2019	2.084.308	0,15 %
Realkredit Danmark A/S	DKK(kr) 5.000.000	1,00 %	01.04.2022	837.509	0,06 %
Denmark Government Bond	DKK(kr) 4.000.000	3,00 %	15.11.2021	727.787	0,05 %
Danske Bank A/S	€ 530.000	0,13 %	14.02.2022	637.867	0,05 %
AP Moller – Maersk A/S	€ 400.000	1,75 %	18.03.2021	501.692	0,04 %
Kommunekredit	€ 300.000	0,25 %	09.10.2020	364.772	0,03 %
Danske Bank A/S	€ 300.000	0,50 %	06.05.2021	364.383	0,03 %
Nykredit Realkredit A/S	DKK(kr) 1.772.000	1,00 %	01.01.2022	296.393	0,02 %
Nykredit Realkredit A/S	€ 225.000	0,38 %	16.06.2020	271.676	0,02 %
Danske Bank A/S	€ 200.000	0,25 %	28.11.2022	237.605	0,02 %
Danske Bank A/S	\$ 200.000	2,70 %	02.03.2022	200.038	0,02 %
Danske Bank A/S	\$ 200.000	2,20 %	02.03.2020	199.038	0,01 %
Kommunekredit	\$ 200.000	1,75 %	10.01.2020	198.730	0,01 %
Kommunekredit	\$ 200.000	1,63 %	01.06.2021	195.730	0,01 %
Danske Bank A/S	\$ 200.000	2,00 %	08.09.2021	195.572	0,01 %
Danske Bank A/S	\$ 175.000	2,75 %	17.09.2020	175.875	0,01 %
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab	DKK(kr) 1.000.000	1,00 %	01.10.2021	164.763	0,01 %
Orsted A/S^	€ 100.000	3,00 %	06.11.2015	126.324	0,01 %
Denmark Government Bond	DKK(kr) 500.000	0,50 %	15.11.2027	80.781	0,01 %
				7.860.843	0,57 %
Finnland 0,57 % (2016: 0,53 %)					
Finland Government Bond	€ 1.150.000	3,38 %	15.04.2020	1.502.741	0,11 %
Nordea Mortgage Bank plc	€ 700.000	4,00 %	10.02.2021	947.846	0,07 %
Finland Government Bond	€ 570.000	4,38 %	04.07.2019	735.729	0,05 %
Finland Government International Bond	£ 400.000	1,63 %	15.12.2020	554.144	0,04 %
Finland Government Bond	€ 400.000	3,50 %	15.04.2021	540.960	0,04 %
Finland Government Bond	€ 300.000	0,38 %	15.09.2020	368.212	0,03 %
Municipality Finance plc	€ 300.000	0,10 %	15.10.2021	362.676	0,03 %
Finland Government International Bond	\$ 350.000	1,00 %	23.04.2019	345.674	0,02 %
SP-Mortgage Bank plc	€ 230.000	0,13 %	24.10.2022	274.908	0,02 %
Municipality Finance plc	£ 200.000	1,25 %	07.03.2019	272.164	0,02 %
Municipality Finance plc	£ 200.000	0,75 %	15.12.2020	269.838	0,02 %
Fortum OYJ	€ 200.000	6,00 %	20.03.2019	257.510	0,02 %
Municipality Finance plc	\$ 225.000	1,13 %	16.09.2019	221.352	0,02 %
Finnvera OYJ	\$ 200.000	1,88 %	05.10.2020	198.116	0,01 %
Municipality Finance plc	\$ 200.000	1,50 %	23.03.2020	197.025	0,01 %
Finland Government International Bond	\$ 200.000	1,50 %	21.09.2020	196.747	0,01 %
OP Mortgage Bank	€ 100.000	0,75 %	11.06.2019	122.002	0,01 %
Danske Kiinnitysluottopankki OYJ	€ 100.000	0,25 %	26.11.2020	121.432	0,01 %
OP Mortgage Bank	€ 100.000	0,25 %	23.11.2020	121.382	0,01 %
Nordea Mortgage Bank plc	€ 100.000	0,03 %	24.01.2022	120.020	0,01 %
Municipality Finance plc	\$ 100.000	1,38 %	21.09.2021	96.532	0,01 %
Finland Government International Bond	£ 50.000	1,50 %	19.12.2019	68.655	0,00 %
				7.895.665	0,57 %
Frankreich 6,74 % (2016: 6,67 %)					
French Republic Government Bond OAT	€ 7.850.000	0,00 %	25.05.2020	9.529.347	0,69 %
French Republic Government Bond OAT	€ 7.700.000	0,00 %	25.05.2022	9.301.082	0,67 %
French Republic Government Bond OAT	€ 3.300.000	3,50 %	25.04.2020	4.327.956	0,31 %
French Republic Government Bond OAT	€ 3.160.000	3,25 %	25.10.2021	4.306.675	0,31 %
French Republic Government Bond OAT	€ 3.400.000	0,00 %	25.02.2019	4.112.279	0,30 %
French Republic Government Bond OAT	€ 3.350.000	0,50 %	25.11.2019	4.100.438	0,30 %
French Republic Government Bond OAT	€ 2.800.000	3,75 %	25.10.2019	3.627.171	0,26 %
French Republic Government Bond OAT	€ 2.400.000	0,25 %	25.11.2020	2.933.282	0,21 %
French Republic Government Bond OAT	€ 2.000.000	2,25 %	25.10.2022	2.673.879	0,19 %
French Republic Government Bond OAT	€ 1.700.000	1,00 %	25.05.2019	2.086.625	0,15 %
French Republic Government Bond OAT	€ 1.700.000	0,00 %	25.05.2021	2.061.574	0,15 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 1.600.000	0,05 %	25.11.2020	1.937.544	0,14 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	€ 1.000.000	4,00 %	17.06.2022	1.415.444	0,10 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	€ 1.100.000	0,13 %	28.08.2020	1.334.570	0,10 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 1.000.000	1,50 %	16.04.2021	1.268.657	0,09 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 1.000.000	0,13 %	25.11.2022	1.208.114	0,09 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 900.000	0,13 %	18.02.2020	1.090.900	0,08 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 800.000	0,88 %	25.10.2022	1.000.488	0,07 %
Credit Agricole SA	¥ 100.000.000	0,44 %	09.06.2022	888.925	0,06 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Societe Generale SA	¥ 100.000.000	0,45 %	26.05.2022	888.498	0,06 %
BPCE SFH SA	€ 700.000	1,75 %	29.11.2019	874.298	0,06 %
Danone SA	€ 700.000	0,17 %	03.11.2020	843.744	0,06 %
BPCE SFH SA	€ 600.000	1,50 %	30.01.2020	747.823	0,05 %
CNP Assurances^	€ 500.000	6,00 %	14.09.2040	690.460	0,05 %
Electricite de France SA	€ 500.000	3,88 %	18.01.2022	686.288	0,05 %
Electricite de France SA	€ 500.000	2,25 %	27.04.2021	641.338	0,05 %
BNP Paribas SA^	€ 500.000	2,88 %	20.03.2026	641.293	0,05 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	€ 500.000	0,25 %	02.09.2021	607.987	0,04 %
Air Liquide Finance SA	€ 500.000	0,13 %	13.06.2020	602.304	0,04 %
Total Capital International SA	\$ 600.000	2,10 %	19.06.2019	600.144	0,04 %
Engie SA	€ 500.000	0,38 %	28.02.2023	598.359	0,04 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	\$ 600.000	2,00 %	22.03.2021	593.352	0,04 %
Bouygues SA	€ 400.000	4,50 %	09.02.2022	563.022	0,04 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 403.000	4,38 %	15.04.2021	555.712	0,04 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	€ 400.000	4,38 %	17.03.2021	550.341	0,04 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 400.000	3,50 %	05.11.2020	531.000	0,04 %
Arkema SA	€ 400.000	3,85 %	30.04.2020	522.365	0,04 %
Orange SA^	€ 400.000	4,25 %	07.02.2166	515.926	0,04 %
BNP Paribas SA	€ 400.000	2,50 %	23.08.2019	501.021	0,04 %
Credit Agricole SA	€ 400.000	0,88 %	19.01.2022	491.780	0,03 %
Societe Generale SA	€ 400.000	0,75 %	25.11.2020	489.868	0,03 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 300.000	0,88 %	08.06.2020	403.629	0,03 %
Orange SA	€ 300.000	3,00 %	15.06.2022	402.179	0,03 %
Electricite de France SA	\$ 400.000	2,35 %	13.10.2020	399.087	0,03 %
TOTAL SA^	€ 300.000	2,25 %	26.02.2166	376.022	0,03 %
Engie SA	€ 300.000	1,38 %	19.05.2020	371.994	0,03 %
Bpifrance Financement SA	€ 300.000	0,75 %	25.10.2021	371.494	0,03 %
Publicis Groupe SA	€ 300.000	1,13 %	16.12.2021	370.156	0,03 %
APRR SA	€ 300.000	1,13 %	15.01.2021	370.017	0,03 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 300.000	1,13 %	25.05.2019	368.065	0,03 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 300.000	1,13 %	11.03.2019	366.761	0,03 %
Dexia Credit Local SA	€ 300.000	0,25 %	02.06.2022	362.474	0,02 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	€ 300.000	0,00 %	26.05.2020	360.351	0,02 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	\$ 330.000	3,00 %	26.10.2020	334.402	0,02 %
UNEDIC A.S.SEO	€ 250.000	0,13 %	05.03.2020	302.833	0,02 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 200.000	4,25 %	26.01.2021	272.787	0,02 %
Orange SA	\$ 275.000	1,63 %	03.11.2019	271.591	0,02 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	£ 200.000	1,00 %	14.06.2022	269.277	0,02 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 200.000	3,75 %	25.10.2020	267.703	0,02 %
Autoroutes du Sud de la France SA	€ 200.000	4,13 %	13.04.2020	262.489	0,02 %
TDF Infrastructure SAS	€ 200.000	2,88 %	19.10.2022	261.677	0,02 %
CIF Euromortgage SA	€ 200.000	3,75 %	23.10.2019	257.769	0,02 %
Electricite de France SA^	€ 200.000	4,13 %	22.01.2166	256.371	0,02 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 200.000	4,38 %	25.04.2019	255.171	0,02 %
Credit Agricole SA	\$ 250.000	3,38 %	10.01.2022	253.479	0,02 %
Caisse des Depots et Consignations	€ 200.000	4,13 %	20.02.2019	252.750	0,02 %
Eutelsat SA	€ 200.000	5,00 %	14.01.2019	252.400	0,02 %
Mercialys SA	€ 200.000	4,13 %	26.03.2019	251.889	0,02 %
BPCE SA	\$ 250.000	2,75 %	02.12.2021	250.692	0,02 %
BPCE SA	\$ 250.000	3,00 %	22.05.2022	249.743	0,02 %
Capgemini SE	€ 200.000	1,75 %	01.07.2020	248.996	0,02 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 200.000	2,00 %	19.09.2019	248.838	0,02 %
RCI Banque SA	€ 200.000	1,38 %	17.11.2020	248.287	0,02 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	€ 200.000	1,38 %	25.10.2019	247.763	0,02 %
Bpifrance Financement SA	€ 200.000	1,00 %	25.10.2019	245.991	0,02 %
Societe Generale SA	€ 200.000	1,00 %	01.04.2022	245.196	0,02 %
RCI Banque SA	€ 200.000	1,13 %	30.09.2019	244.886	0,02 %
Cie de Financement Foncier SA	€ 200.000	0,38 %	29.10.2020	244.274	0,02 %
Vivendi SA	€ 200.000	0,75 %	26.05.2021	243.548	0,02 %
BPCE SA	€ 200.000	0,63 %	20.04.2020	243.484	0,02 %
Societe Generale SFH SA	€ 200.000	0,13 %	27.02.2020	242.522	0,02 %
RCI Banque SA	€ 200.000	0,75 %	12.01.2022	242.141	0,02 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 200.000	0,38 %	13.01.2022	240.896	0,02 %
Cie de Saint-Gobain	€ 200.000	0,00 %	27.03.2020	239.797	0,02 %
BNP Paribas SA	\$ 200.000	5,00 %	15.01.2021	214.549	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	\$ 200.000	1,50 %	28.01.2019	198.764	0,01 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	\$ 200.000	2,70 %	20.07.2022	198.519	0,01 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	\$ 200.000	2,20 %	20.07.2020	198.288	0,01 %
Agence Francaise de Developpement	\$ 200.000	1,63 %	21.01.2020	197.516	0,01 %
Danone SA	\$ 200.000	1,69 %	30.10.2019	197.027	0,01 %
Suez	€ 150.000	6,25 %	08.04.2019	194.483	0,01 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	\$ 145.000	1,75 %	24.09.2019	144.112	0,01 %
Engie SA^	£ 100.000	4,63 %	10.01.2167	139.739	0,01 %
AXA SA^	€ 100.000	5,25 %	16.04.2040	133.072	0,01 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 100.000	4,25 %	25.04.2020	132.975	0,01 %
Aeroports de Paris	€ 100.000	3,89 %	10.05.2020	131.084	0,01 %
Schneider Electric SE	€ 100.000	3,63 %	20.07.2020	130.984	0,01 %
Veolia Environnement SA	€ 100.000	6,75 %	24.04.2019	130.752	0,01 %
Orange SA	€ 100.000	3,88 %	09.04.2020	130.561	0,01 %
Credit Agricole SA	€ 100.000	5,88 %	11.06.2019	130.179	0,01 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 100.000	4,00 %	25.10.2019	129.819	0,01 %
Sanofi	€ 100.000	4,13 %	11.10.2019	129.306	0,01 %
Bouygues SA	€ 100.000	3,64 %	29.10.2019	128.100	0,01 %
RCI Banque SA	€ 100.000	2,25 %	29.03.2021	127.344	0,01 %
Electricite de France SA^	€ 100.000	4,25 %	29.01.2166	127.261	0,01 %
Total Capital SA	€ 100.000	4,88 %	28.01.2019	126.609	0,01 %
Sanofi	€ 100.000	1,88 %	04.09.2020	125.610	0,01 %
Eutelsat SA	€ 100.000	2,63 %	13.01.2020	125.472	0,01 %
APRR SA	€ 100.000	2,25 %	16.01.2020	125.429	0,01 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	€ 100.000	1,63 %	11.03.2020	125.236	0,01 %
Kering	€ 100.000	3,13 %	23.04.2019	125.051	0,01 %
Societe Generale SFH SA	€ 100.000	2,88 %	14.03.2019	124.786	0,01 %
HSBC France SA	€ 100.000	1,88 %	16.01.2020	124.737	0,01 %
Engie SA^	€ 100.000	3,00 %	02.06.2166	124.222	0,01 %
Infra Park SAS	€ 100.000	1,25 %	16.10.2020	123.244	0,01 %
BPCE SA	€ 100.000	1,38 %	22.05.2019	122.625	0,01 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	€ 100.000	0,38 %	21.10.2021	122.218	0,01 %
HSBC France SA	€ 100.000	0,63 %	03.12.2020	122.130	0,01 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	€ 100.000	1,13 %	06.02.2019	122.101	0,01 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	€ 100.000	1,00 %	25.02.2019	122.046	0,01 %
BPCE SA	€ 100.000	0,75 %	22.01.2020	122.038	0,01 %
BPCE SFH SA	€ 100.000	0,38 %	28.07.2020	122.010	0,01 %
Caisse Francaise de Financement Local	€ 100.000	0,38 %	16.09.2019	121.609	0,01 %
RCI Banque SA	€ 100.000	0,63 %	04.03.2020	121.344	0,01 %
PSA Banque France SA	€ 100.000	0,50 %	17.01.2020	121.006	0,01 %
Capgemini SE	€ 100.000	0,50 %	09.11.2021	120.999	0,01 %
Bpifrance Financement SA	€ 100.000	0,13 %	25.11.2020	120.960	0,01 %
Bpifrance Financement SA	€ 100.000	0,10 %	19.02.2021	120.896	0,01 %
RCI Banque SA	€ 100.000	0,75 %	26.09.2022	120.856	0,01 %
RCI Banque SA	€ 100.000	0,63 %	10.11.2021	120.827	0,01 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 100.000	0,25 %	14.06.2019	120.699	0,01 %
Sanofi	€ 100.000	0,00 %	05.04.2019	120.371	0,01 %
Sanofi	€ 100.000	0,00 %	13.01.2020	120.312	0,01 %
Orange SA	\$ 100.000	4,13 %	14.09.2021	105.794	0,01 %
Credit Agricole SA	\$ 100.000	2,75 %	10.06.2020	100.750	0,01 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	\$ 100.000	2,50 %	13.04.2021	99.765	0,01 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	\$ 100.000	2,00 %	12.04.2019	99.707	0,01 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	\$ 100.000	1,88 %	13.01.2020	99.394	0,01 %
AXA SA^	£ 50.000	6,77 %	16.10.2166	73.698	0,00 %
Autoroutes du Sud de la France SA	€ 50.000	7,38 %	20.03.2019	65.427	0,00 %
Orange SA	\$ 50.000	5,38 %	08.07.2019	52.196	0,00 %
BNP Paribas SA	\$ 50.000	2,38 %	21.05.2020	50.006	0,00 %
BPCE SA	\$ 50.000	2,25 %	27.01.2020	49.880	0,00 %
BPCE SA	\$ 30.000	2,50 %	15.07.2019	30.111	0,00 %
Total Capital International SA	AUD 12.000	4,25 %	26.11.2021	9.830	0,00 %
				92.930.179	6,74 %
Deutschland 6,85 % (2016: 6,94 %)					
Bundesobligation	€ 4.560.000	0,00 %	09.04.2021	5.557.536	0,40 %
Bundesobligation	€ 4.480.000	0,00 %	08.10.2021	5.456.028	0,39 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 2.700.000	2,00 %	04.01.2022	3.548.612	0,26 %
Bundesobligation	€ 2.750.000	0,00 %	07.10.2022	3.333.009	0,24 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 2.400.000	3,75 %	04.01.2019	3.010.759	0,22 %
Bundesobligation	€ 2.326.000	0,00 %	08.04.2022	2.827.499	0,20 %
Bundesschatzanweisungen	€ 2.000.000	0,00 %	15.03.2019	2.421.963	0,17 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 1.570.000	2,25 %	04.09.2021	2.069.909	0,15 %
Bundesobligation	€ 1.400.000	0,00 %	17.04.2020	1.703.963	0,12 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 1.200.000	3,25 %	04.07.2021	1.628.089	0,12 %
KFW	€ 1.200.000	0,00 %	30.06.2021	1.454.576	0,10 %
KFW	€ 1.100.000	0,38 %	22.07.2019	1.340.265	0,10 %
HSH Nordbank AG	€ 1.000.000	0,10 %	20.07.2020	1.203.962	0,09 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 1.000.000	0,00 %	05.12.2022	1.198.099	0,09 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 900.000	3,50 %	04.07.2019	1.149.746	0,08 %
KFW	\$ 1.155.000	1,88 %	15.12.2020	1.148.600	0,08 %
KFW	\$ 1.150.000	1,50 %	20.04.2020	1.134.366	0,08 %
KFW	€ 800.000	2,63 %	16.08.2019	1.010.506	0,07 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 800.000	1,00 %	15.02.2019	976.933	0,07 %
KFW	€ 800.000	0,13 %	27.10.2020	974.603	0,07 %
Land Rheinland-Pfalz	€ 800.000	0,00 %	23.03.2020	968.601	0,07 %
KFW	€ 800.000	0,00 %	28.04.2022	966.714	0,07 %
KFW	€ 800.000	0,00 %	15.12.2022	962.259	0,07 %
KFW	\$ 960.000	1,50 %	09.09.2019	951.722	0,07 %
Bundesobligation	€ 700.000	0,50 %	12.04.2019	853.372	0,06 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 700.000	0,38 %	30.10.2021	845.084	0,06 %
KFW	\$ 800.000	1,50 %	15.06.2021	780.065	0,06 %
Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale	€ 600.000	2,00 %	26.04.2019	743.018	0,05 %
Land Bremen	€ 600.000	0,50 %	30.07.2021	737.382	0,05 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 600.000	0,13 %	27.11.2020	726.291	0,05 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 600.000	0,00 %	26.02.2019	724.477	0,05 %
Landesbank Baden-Württemberg	€ 600.000	0,05 %	11.11.2021	723.313	0,05 %
Land Hessen	€ 600.000	0,00 %	15.09.2021	723.054	0,05 %
Land Nordrhein-Westfalen	€ 500.000	4,38 %	29.04.2022	714.673	0,05 %
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA	€ 500.000	8,50 %	31.10.2019	693.744	0,05 %
innogy Finance BV	€ 550.000	1,88 %	30.01.2020	685.646	0,05 %
KFW	€ 500.000	3,63 %	20.01.2020	651.429	0,05 %
Bund Laender Anleihe	€ 500.000	1,50 %	15.07.2020	628.804	0,05 %
KFW	€ 500.000	3,88 %	21.01.2019	628.619	0,05 %
Bundesobligation	€ 500.000	0,25 %	11.10.2019	610.013	0,04 %
KFW	\$ 600.000	2,75 %	08.09.2020	609.806	0,04 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 500.000	0,00 %	20.10.2020	605.439	0,04 %
Volkswagen International Finance NV	€ 500.000	0,50 %	30.03.2021	604.831	0,04 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 500.000	0,00 %	15.04.2019	604.206	0,04 %
Land Niedersachsen	€ 500.000	0,00 %	10.01.2022	602.393	0,04 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	€ 500.000	0,00 %	19.07.2021	599.073	0,04 %
E.ON International Finance BV	£ 400.000	6,00 %	30.10.2019	589.552	0,04 %
Land Niedersachsen	€ 400.000	3,50 %	21.10.2019	514.521	0,04 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	\$ 500.000	2,38 %	24.03.2021	502.500	0,04 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	€ 400.000	1,63 %	01.10.2019	498.563	0,04 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 500.000	2,15 %	27.05.2020	498.150	0,04 %
Land Nordrhein-Westfalen	\$ 500.000	1,88 %	17.06.2019	498.130	0,04 %
ATF Netherlands BV	€ 400.000	1,50 %	03.05.2022	496.586	0,04 %
KFW	€ 400.000	1,13 %	15.01.2020	496.287	0,04 %
Bundesobligation	€ 400.000	1,00 %	22.02.2019	489.739	0,03 %
Gemeinsame Deutsche Bundeslaender	€ 400.000	0,38 %	23.06.2020	488.726	0,03 %
Deutsche Bank AG	€ 400.000	1,00 %	18.03.2019	485.612	0,03 %
Volkswagen Leasing GmbH	€ 400.000	0,25 %	05.10.2020	481.180	0,03 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 370.000	3,25 %	04.01.2020	479.045	0,03 %
innogy Finance BV	£ 300.000	6,50 %	20.04.2021	473.412	0,03 %
Deutsche Bank AG	\$ 450.000	4,25 %	14.10.2021	466.442	0,03 %
KFW	AUD 500.000	6,00 %	20.08.2020	427.154	0,03 %
KFW	€ 300.000	1,38 %	01.02.2021	412.909	0,03 %
Bundesland Berlin Deutschland	€ 300.000	3,13 %	17.08.2021	403.141	0,03 %
BMW International Investment BV	£ 300.000	1,00 %	17.11.2021	402.984	0,03 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 300.000	2,50 %	04.01.2021	392.980	0,03 %
Land Hessen	€ 300.000	2,75 %	22.09.2020	390.317	0,03 %
KFW	\$ 375.000	2,00 %	04.10.2022	369.123	0,03 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 300.000	0,13 %	16.04.2020	364.255	0,03 %
Commerzbank AG	€ 300.000	0,25 %	26.01.2022	363.865	0,03 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
UniCredit Bank AG	€ 300.000	0,13 %	09.04.2021	363.257	0,03 %
Land Niedersachsen	€ 300.000	0,00 %	01.03.2021	362.734	0,03 %
E.ON SE	€ 300.000	0,38 %	23.08.2021	362.610	0,03 %
BMW Finance NV	€ 300.000	0,13 %	15.04.2020	361.501	0,03 %
Allianz Finance II BV	€ 300.000	0,00 %	21.04.2020	361.320	0,03 %
BMW Finance NV	€ 300.000	0,13 %	12.01.2021	360.877	0,03 %
Santander Consumer Bank AG	€ 300.000	0,75 %	17.10.2022	360.469	0,03 %
LANXESS AG	€ 300.000	0,25 %	07.10.2021	360.367	0,03 %
KFW	\$ 350.000	2,13 %	07.03.2022	347.504	0,02 %
NRW Bank	\$ 350.000	1,25 %	29.07.2019	345.194	0,02 %
KFW	\$ 350.000	1,00 %	15.07.2019	344.360	0,02 %
FMS Wertmanagement AoeR	\$ 320.000	2,00 %	01.08.2022	315.236	0,02 %
FMS Wertmanagement AoeR	\$ 300.000	1,75 %	24.01.2020	298.176	0,02 %
KFW	\$ 300.000	2,13 %	15.06.2022	297.480	0,02 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 300.000	1,50 %	05.07.2019	296.496	0,02 %
Commerzbank AG	€ 200.000	7,75 %	16.03.2021	291.935	0,02 %
Allianz Finance II BV^	€ 200.000	5,75 %	08.07.2041	281.514	0,02 %
KFW	£ 200.000	1,13 %	23.12.2019	273.347	0,02 %
E.ON International Finance BV	€ 200.000	5,75 %	07.05.2020	273.062	0,02 %
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	£ 200.000	1,13 %	17.05.2021	272.593	0,02 %
Volkswagen Financial Services NV	£ 200.000	1,50 %	12.04.2021	271.719	0,02 %
Daimler AG	£ 200.000	1,00 %	20.12.2019	270.533	0,02 %
Commerzbank AG	€ 200.000	6,38 %	22.03.2019	258.093	0,02 %
Volkswagen International Finance NV^	€ 200.000	3,75 %	24.03.2166	257.211	0,02 %
KFW	\$ 255.000	1,75 %	15.09.2021	250.273	0,02 %
KFW	\$ 250.000	1,88 %	30.06.2020	248.465	0,02 %
FMS Wertmanagement AoeR	€ 200.000	1,88 %	09.05.2019	247.820	0,02 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 200.000	1,13 %	27.04.2020	245.172	0,02 %
Deutsche Bank SA Espanola	€ 200.000	0,63 %	15.12.2021	244.764	0,02 %
Fresenius Finance Ireland plc	€ 200.000	0,88 %	31.01.2022	244.100	0,02 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 200.000	1,25 %	04.02.2019	243.368	0,02 %
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	€ 200.000	0,25 %	25.11.2019	243.223	0,02 %
Commerzbank AG	€ 200.000	0,25 %	23.07.2020	243.087	0,02 %
BMW Finance NV	€ 200.000	0,50 %	21.01.2020	243.058	0,02 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 250.000	1,70 %	15.09.2021	242.844	0,02 %
NRW Bank	€ 200.000	0,13 %	18.01.2021	242.600	0,02 %
Deutsche Post AG	€ 200.000	0,38 %	01.04.2021	242.254	0,02 %
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	€ 200.000	0,13 %	29.07.2019	242.044	0,02 %
Linde Finance BV	€ 200.000	0,25 %	18.01.2022	241.741	0,02 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg	€ 200.000	0,10 %	21.01.2019	241.402	0,02 %
Daimler International Finance BV	€ 200.000	0,20 %	13.09.2021	240.083	0,02 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 200.000	0,05 %	05.09.2022	239.466	0,02 %
Continental AG	€ 172.000	0,00 %	05.02.2020	206.781	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 200.000	2,85 %	06.01.2022	200.964	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 200.000	2,70 %	03.08.2020	200.948	0,01 %
Deutsche Bank AG	\$ 200.000	3,13 %	13.01.2021	200.518	0,01 %
KFW	\$ 200.000	1,75 %	31.03.2020	198.509	0,01 %
FMS Wertmanagement AoeR	\$ 200.000	1,00 %	16.08.2019	196.787	0,01 %
Land Niedersachsen	€ 150.000	1,25 %	10.01.2020	186.213	0,01 %
Vonovia Finance BV	€ 150.000	0,88 %	30.03.2020	183.138	0,01 %
KFW	€ 150.000	0,13 %	01.06.2020	182.535	0,01 %
Evonik Finance BV	€ 130.000	0,00 %	08.03.2021	155.244	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 150.000	2,30 %	06.01.2020	149.652	0,01 %
BMW US Capital LLC	\$ 150.000	2,15 %	06.04.2020	149.443	0,01 %
NRW Bank	\$ 150.000	2,00 %	23.09.2019	149.429	0,01 %
Deutsche Bank AG	\$ 150.000	3,30 %	16.11.2022	149.297	0,01 %
Deutsche Bank AG	\$ 150.000	2,70 %	13.07.2020	149.277	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	\$ 150.000	2,23 %	17.01.2020	149.276	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	\$ 150.000	1,95 %	19.09.2021	145.922	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	£ 100.000	1,38 %	15.12.2020	137.710	0,01 %
FMS Wertmanagement AoeR	£ 100.000	1,13 %	13.12.2019	136.480	0,01 %
FMS Wertmanagement AoeR	£ 100.000	1,25 %	08.03.2019	136.337	0,01 %
Deutsche Bank AG	£ 100.000	1,88 %	28.02.2020	136.232	0,01 %
EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG^	€ 100.000	3,63 %	02.04.2076	129.227	0,01 %
innogy Finance BV	€ 100.000	6,63 %	31.01.2019	128.827	0,01 %
Daimler AG	€ 100.000	2,00 %	07.04.2020	125.398	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 100.000	2,13 %	03.06.2019	124.302	0,01 %
Deutsche Bank AG	€ 100.000	1,50 %	20.01.2022	124.004	0,01 %
BMW Finance NV	€ 100.000	1,63 %	17.07.2019	123.389	0,01 %
Linde Finance BV	€ 100.000	1,75 %	11.06.2019	123.374	0,01 %
BMW Finance NV	€ 100.000	0,88 %	17.11.2020	122.964	0,01 %
KFW	€ 100.000	0,88 %	18.03.2019	122.214	0,01 %
Deutsche Bank SA Espanola	€ 100.000	0,63 %	25.11.2020	122.204	0,01 %
Volkswagen Leasing GmbH	€ 100.000	0,75 %	11.08.2020	121.996	0,01 %
Bundesland Berlin Deutschland	€ 100.000	0,25 %	15.07.2020	121.861	0,01 %
Land Thuringen	€ 100.000	0,25 %	09.12.2019	121.619	0,01 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg	€ 100.000	0,25 %	21.07.2020	121.584	0,01 %
Muenchener Hypothekenbank eG	€ 100.000	0,25 %	14.10.2020	121.579	0,01 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	€ 100.000	0,25 %	20.11.2019	121.472	0,01 %
HSH Nordbank AG	€ 100.000	0,63 %	17.07.2019	121.443	0,01 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 100.000	0,25 %	30.07.2020	121.411	0,01 %
DVB Bank SE	€ 100.000	1,25 %	22.04.2020	121.234	0,01 %
Land Niedersachsen	€ 100.000	0,13 %	12.08.2019	121.204	0,01 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg	€ 100.000	0,05 %	13.01.2020	120.976	0,01 %
Continental Rubber of America Corp.	€ 100.000	0,50 %	19.02.2019	120.934	0,01 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg	€ 100.000	0,38 %	29.01.2019	120.743	0,01 %
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	€ 100.000	0,03 %	31.01.2019	120.593	0,01 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 100.000	0,05 %	09.08.2021	120.510	0,01 %
DVB Bank SE	€ 100.000	1,00 %	29.07.2019	120.487	0,01 %
Landesbank Hessen-Thuringen Girozentrale	€ 100.000	0,00 %	12.01.2022	120.220	0,01 %
HSH Nordbank AG	€ 100.000	0,13 %	24.02.2021	119.987	0,01 %
BMW US Capital LLC	£ 80.000	2,00 %	20.11.2019	110.222	0,01 %
Fresenius Medical Care US Finance, Inc.	\$ 100.000	5,75 %	15.02.2021	108.125	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	\$ 100.000	6,00 %	08.07.2019	105.515	0,01 %
KFW	\$ 100.000	4,00 %	27.01.2020	103.886	0,01 %
Fresenius Medical Care US Finance II, Inc.	\$ 100.000	4,13 %	15.10.2020	103.000	0,01 %
Deutsche Bank AG	\$ 100.000	3,38 %	12.05.2021	100.885	0,01 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 100.000	2,70 %	16.03.2022	100.653	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 100.000	2,45 %	18.05.2020	99.909	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	\$ 100.000	1,75 %	15.04.2019	99.788	0,01 %
FMS Wertmanagement AoeR	\$ 100.000	1,75 %	17.03.2020	99.285	0,01 %
BMW US Capital LLC	\$ 100.000	1,50 %	11.04.2019	99.271	0,01 %
KFW	\$ 100.000	2,00 %	30.11.2021	98.904	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	\$ 100.000	2,00 %	06.12.2021	98.899	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	\$ 100.000	1,38 %	23.10.2019	98.788	0,01 %
BMW US Capital LLC	\$ 100.000	2,00 %	11.04.2021	98.522	0,01 %
KFW	AUD 100.000	6,25 %	04.12.2019	84.092	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	AUD 100.000	4,00 %	17.07.2019	80.454	0,01 %
KFW	AUD 100.000	4,00 %	16.01.2019	79.764	0,01 %
KFW	CAD 100.000	1,38 %	28.01.2020	78.886	0,01 %
Daimler Canada Finance, Inc.	CAD 100.000	1,91 %	08.07.2021	78.194	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	NZ(\$) 100.000	4,00 %	30.01.2020	73.356	0,00 %
KFW	NOK(kr) 500.000	5,00 %	22.05.2019	64.560	0,00 %
Land Niedersachsen	€ 50.000	0,40 %	10.07.2020	61.132	0,00 %
Berlin Hyp AG	€ 50.000	0,63 %	24.06.2019	60.937	0,00 %
Berlin Hyp AG	€ 50.000	0,13 %	22.10.2020	60.581	0,00 %
BMW US Capital LLC	\$ 50.000	2,70 %	06.04.2022	50.029	0,00 %
FMS Wertmanagement AoeR	\$ 50.000	1,63 %	20.11.2018	49.879	0,00 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 50.000	2,20 %	30.10.2021	49.164	0,00 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	CAD 50.000	1,88 %	21.11.2019	39.844	0,00 %
Deutsche Hypothekenbank AG	€ 25.000	0,63 %	29.07.2019	30.483	0,00 %
				94.444.991	6,85 %
Hongkong 0,08 % (2016: 0,05 %)					
CK Hutchison International 17 II Ltd.	\$ 400.000	2,25 %	29.09.2020	395.074	0,03 %
Hutchison Whampoa Finance 14 Ltd.	€ 300.000	1,38 %	31.10.2021	373.061	0,03 %
CK Hutchison International 16 Ltd.	\$ 200.000	1,88 %	03.10.2021	193.353	0,01 %
Hutchison Whampoa International 09/19 Ltd.	\$ 100.000	5,75 %	11.09.2019	105.254	0,01 %
				1.066.742	0,08 %
Ungarn 0,25 % (2016: 0,09 %)					
Hungary Government Bond	HUF 230.000.000	1,00 %	23.09.2020	900.808	0,07 %
Hungary Government Bond	HUF 133.000.000	7,00 %	24.06.2022	649.421	0,05 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Hungary Government International Bond	\$ 550.000	6,38 %	29.03.2021	611.187	0,04 %
Hungary Government Bond	HUF 110.000.000	2,50 %	27.10.2021	450.943	0,03 %
Hungary Government International Bond	€ 300.000	6,00 %	11.01.2019	382.919	0,03 %
Hungary Government International Bond	\$ 250.000	6,25 %	29.01.2020	267.820	0,02 %
Hungary Government Bond	HUF 50.000.000	1,75 %	26.10.2022	199.167	0,01 %
				3.462.265	0,25 %
Indien 0,05 % (2016: 0,09 %)					
ICICI Bank Ltd.	\$ 300.000	3,25 %	09.09.2022	297.786	0,02 %
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	\$ 200.000	3,50 %	29.07.2020	201.988	0,02 %
Export-Import Bank of India	\$ 200.000	2,75 %	01.04.2020	199.760	0,01 %
				699.534	0,05 %
Indonesien 0,13 % (2016: 0,14 %)					
Indonesia Government International Bond	\$ 450.000	3,75 %	25.04.2022	462.937	0,03 %
Indonesia Government International Bond	\$ 400.000	5,88 %	13.03.2020	429.504	0,03 %
Indonesia Government International Bond	\$ 300.000	4,88 %	05.05.2021	319.875	0,02 %
Pertamina Persero PT	\$ 200.000	5,25 %	23.05.2021	214.250	0,02 %
Indonesia Government International Bond	€ 100.000	2,88 %	08.07.2021	130.568	0,01 %
Majapahit Holding BV	\$ 100.000	7,75 %	20.01.2020	109.499	0,01 %
Majapahit Holding BV	\$ 100.000	8,00 %	07.08.2019	108.253	0,01 %
				1.774.886	0,13 %
Irland 0,37 % (2016: 0,42 %)					
Ireland Government Bond	€ 1.200.000	5,00 %	18.10.2020	1.661.663	0,12 %
Ireland Government Bond	€ 870.000	0,00 %	18.10.2022	1.042.564	0,08 %
SMBC Aviation Capital Finance DAC	\$ 350.000	2,65 %	15.07.2021	343.905	0,02 %
Ireland Government Bond	€ 250.000	4,50 %	18.04.2020	334.841	0,02 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	\$ 300.000	4,63 %	30.10.2020	314.625	0,02 %
AIB Mortgage Bank	€ 200.000	0,63 %	27.07.2020	245.182	0,02 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	\$ 225.000	4,63 %	01.07.2022	238.500	0,02 %
SMBC Aviation Capital Finance DAC	\$ 200.000	3,00 %	15.07.2022	198.398	0,01 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	\$ 150.000	4,50 %	15.05.2021	157.500	0,01 %
Ireland Government Bond	€ 100.000	5,90 %	18.10.2019	133.821	0,01 %
CRH Finance BV	€ 100.000	5,00 %	25.01.2019	126.432	0,01 %
Bank of Ireland Mortgage Bank	€ 100.000	1,75 %	19.03.2019	123.118	0,01 %
Bank of Ireland Mortgage Bank	€ 100.000	0,63 %	19.02.2021	122.711	0,01 %
Johnson Controls International plc	\$ 100.000	5,00 %	30.03.2020	105.416	0,01 %
				5.148.676	0,37 %
Israel 0,31 % (2016: 0,25 %)					
Israel Government Bond-Fixed	ILS 3.000.000	1,00 %	30.04.2021	887.301	0,06 %
Israel Government Bond-Fixed	ILS 1.800.000	5,50 %	31.01.2022	648.522	0,05 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	€ 500.000	0,38 %	25.07.2020	570.366	0,04 %
Israel Government Bond-Fixed	ILS 1.700.000	5,00 %	31.01.2020	560.978	0,04 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	\$ 440.000	2,20 %	21.07.2021	403.131	0,03 %
Israel Government International Bond	€ 300.000	4,63 %	18.03.2020	397.366	0,03 %
Israel Government International Bond	\$ 235.000	5,13 %	26.03.2019	243.341	0,02 %
Israel Electric Corp., Ltd.	\$ 200.000	7,25 %	15.01.2019	208.496	0,01 %
Israel Government Bond-Fixed	ILS 500.000	2,25 %	31.05.2019	150.246	0,01 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	\$ 150.000	1,70 %	19.07.2019	145.573	0,01 %
Teva Pharmaceutical Finance IV BV	\$ 125.000	3,65 %	10.11.2021	118.916	0,01 %
				4.334.236	0,31 %
Italien 4,69 % (2016: 4,06 %)					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 4.050.000	1,50 %	01.08.2019	4.992.758	0,36 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 3.500.000	1,35 %	15.04.2022	4.329.472	0,31 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 3.200.000	0,10 %	15.04.2019	3.860.109	0,28 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 3.000.000	2,15 %	15.12.2021	3.834.434	0,28 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.900.000	1,05 %	01.12.2019	3.556.981	0,26 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.500.000	4,75 %	01.09.2021	3.478.117	0,25 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.700.000	0,05 %	15.10.2019	3.252.347	0,23 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.100.000	0,70 %	01.05.2020	2.561.114	0,18 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 2.000.000	1,20 %	01.04.2022	2.459.373	0,18 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.900.000	0,35 %	15.06.2020	2.297.169	0,17 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.500.000	5,50 %	01.11.2022	2.203.779	0,16 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.621.000	4,25 %	01.03.2020	2.126.894	0,15 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.650.000	4,50 %	01.03.2019	2.090.711	0,15 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.500.000	3,75 %	01.08.2021	2.017.236	0,15 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.564.000	0,45 %	01.06.2021	1.887.655	0,14 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.200.000	3,75 %	01.03.2021	1.598.881	0,11 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.240.000	0,65 %	01.11.2020	1.510.234	0,11 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.150.000	4,25 %	01.02.2019	1.448.287	0,10 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 980.000	5,00 %	01.03.2022	1.391.112	0,10 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.000.000	3,75 %	01.05.2021	1.336.795	0,10 %
UniCredit SpA	€ 1.000.000	2,63 %	31.10.2020	1.291.508	0,09 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 1.000.000	1,45 %	15.09.2022	1.239.125	0,09 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 800.000	4,00 %	01.09.2020	1.060.166	0,08 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 800.000	4,50 %	01.02.2020	1.051.228	0,08 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 600.000	4,25 %	01.09.2019	773.441	0,06 %
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	€ 600.000	0,35 %	01.11.2021	718.666	0,05 %
Enel Finance International NV	\$ 500.000	2,88 %	25.05.2022	496.933	0,04 %
Snam SpA	€ 400.000	0,00 %	25.10.2020	479.346	0,03 %
Unione di Banche Italiane SpA	€ 400.000	0,75 %	17.10.2022	478.272	0,03 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 300.000	5,00 %	27.01.2021	415.753	0,03 %
FCA Bank SpA	€ 300.000	1,00 %	15.11.2021	367.852	0,03 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 300.000	0,88 %	27.06.2022	364.384	0,03 %
Mediobanca SpA	€ 300.000	0,63 %	27.09.2022	357.002	0,02 %
FCA Bank SpA	£ 200.000	1,63 %	29.09.2021	270.157	0,02 %
Autostrade per l'Italia SpA	€ 200.000	2,88 %	26.02.2021	260.540	0,02 %
UniCredit SpA	€ 200.000	3,63 %	24.01.2019	249.364	0,02 %
Banca Popolare di Milano Scarl	€ 200.000	0,88 %	14.09.2022	243.734	0,02 %
BPER Banca	€ 200.000	0,50 %	22.07.2020	243.269	0,02 %
Mediobanca SpA	€ 200.000	0,75 %	17.02.2020	243.201	0,02 %
FCA Bank SpA	€ 200.000	0,25 %	12.10.2020	240.193	0,02 %
Intesa Sanpaolo SpA	\$ 230.000	3,88 %	15.01.2019	233.481	0,02 %
Assicurazioni Generali SpA^	€ 100.000	10,13 %	10.07.2042	165.725	0,01 %
ENI SpA	€ 100.000	4,25 %	03.02.2020	130.609	0,01 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	€ 100.000	4,88 %	03.10.2019	130.456	0,01 %
UniCredit SpA	€ 100.000	2,75 %	31.01.2020	127.412	0,01 %
FCA Bank SpA	€ 100.000	2,63 %	17.04.2019	124.128	0,01 %
Unione di Banche Italiane SpA	€ 100.000	2,88 %	18.02.2019	123.880	0,01 %
UniCredit SpA	€ 100.000	1,88 %	31.01.2019	122.842	0,01 %
UniCredit SpA	€ 100.000	1,50 %	19.06.2019	122.704	0,01 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 100.000	1,13 %	14.01.2020	122.577	0,01 %
Intesa Sanpaolo SpA	\$ 100.000	6,50 %	24.02.2021	110.147	0,01 %
Enel SpA	£ 50.000	6,25 %	20.06.2019	72.653	0,00 %
				64.664.206	4,69 %
Japan 10,54 % (2016: 11,91 %)					
Japanische Staatsanleihe	¥ 1.100.000.000	0,10 %	20.12.2022	9.860.160	0,72 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 992.000.000	0,10 %	20.06.2022	8.886.612	0,64 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 890.000.000	0,10 %	20.06.2021	7.958.409	0,58 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 850.000.000	0,10 %	20.03.2021	7.598.162	0,55 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 740.000.000	0,10 %	20.09.2020	6.607.579	0,48 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 720.000.000	0,10 %	20.09.2022	6.453.539	0,47 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 698.000.000	0,10 %	20.03.2022	6.250.338	0,45 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 655.000.000	0,10 %	20.06.2020	5.845.868	0,42 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 610.000.000	0,10 %	15.05.2019	5.432.655	0,39 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 600.000.000	0,10 %	20.09.2021	5.367.510	0,39 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 580.000.000	0,10 %	20.03.2020	5.174.074	0,38 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 550.000.000	0,10 %	15.10.2019	4.903.276	0,36 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 375.000.000	0,10 %	15.07.2019	3.341.212	0,24 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 355.000.000	0,20 %	20.06.2019	3.166.512	0,23 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 350.000.000	0,10 %	15.04.2019	3.116.476	0,23 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 345.000.000	0,10 %	20.06.2019	3.072.843	0,22 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 275.000.000	0,10 %	20.12.2020	2.457.057	0,18 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 275.000.000	0,10 %	20.09.2019	2.450.686	0,18 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 250.000.000	0,10 %	20.12.2019	2.229.028	0,16 %
Deposit Insurance Corp. of Japan	¥ 200.000.000	0,10 %	19.10.2021	1.780.657	0,13 %
Shoko Chukin Bank Ltd.	¥ 200.000.000	0,17 %	25.01.2019	1.776.945	0,13 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$ 1.175.000	2,95 %	01.03.2021	1.185.430	0,09 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 120.000.000	1,10 %	20.09.2021	1.113.289	0,08 %
Shinkin Central Bank	¥ 120.000.000	0,06 %	27.04.2021	1.063.933	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 119.400.000	0,10 %	15.06.2019	1.063.640	0,08 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Major Joint Local Government Bond	¥ 100.000.000	1,07 %	24.12.2021	923.816	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 100.000.000	1,20 %	20.12.2020	922.468	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 100.000.000	0,80 %	25.10.2022	919.292	0,07 %
Tokyo Metropolitan Government	¥ 100.000.000	0,77 %	20.09.2022	917.837	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 100.000.000	1,40 %	20.03.2020	917.577	0,07 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 100.000.000	1,30 %	20.01.2020	911.119	0,07 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 100.000.000	1,00 %	14.08.2020	910.573	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 100.000.000	1,55 %	25.09.2018	897.466	0,07 %
Development Bank of Japan, Inc.	¥ 100.000.000	0,16 %	18.12.2020	890.351	0,06 %
Mizuho Bank Ltd.	¥ 100.000.000	0,29 %	25.01.2019	890.091	0,06 %
Deposit Insurance Corp. of Japan	¥ 100.000.000	0,10 %	17.01.2020	889.224	0,06 %
Panasonic Corp.	¥ 100.000.000	0,19 %	17.09.2021	887.570	0,06 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 100.000.000	0,01 %	20.06.2019	887.364	0,06 %
West Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 100.000.000	0,09 %	20.09.2022	886.998	0,06 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 100.000.000	0,01 %	20.06.2019	886.779	0,06 %
Nissan Motor Co., Ltd.	¥ 100.000.000	0,15 %	19.03.2021	886.729	0,06 %
Shoko Chukin Bank Ltd.	¥ 100.000.000	0,07 %	27.08.2020	886.462	0,06 %
Central Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 100.000.000	0,07 %	18.03.2022	885.594	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 90.000.000	1,00 %	20.09.2020	823.126	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 90.000.000	1,40 %	20.09.2019	819.867	0,06 %
Asahi Group Holdings Ltd	€ 657.000	0,32 %	19.09.2021	787.532	0,06 %
Metropolitan Expressway Co., Ltd.	¥ 80.000.000	0,21 %	18.09.2020	712.445	0,05 %
Japan Expressway Holding and Debt Repayment Agency	¥ 70.000.000	1,30 %	30.09.2019	635.443	0,05 %
Toyota Motor Credit Corp.	€ 500.000	1,00 %	10.09.2021	618.016	0,05 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 60.000.000	0,25 %	29.10.2018	533.724	0,04 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	\$ 500.000	1,97 %	11.01.2019	498.858	0,04 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 500.000	1,75 %	28.05.2020	491.889	0,04 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 52.000.000	1,40 %	12.07.2019	471.382	0,03 %
Tokyo Metropolitan Government	¥ 50.000.000	1,38 %	20.12.2019	455.684	0,03 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 50.000.000	1,54 %	23.08.2019	454.839	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 50.000.000	1,50 %	20.06.2019	454.430	0,03 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 50.000.000	1,57 %	24.05.2019	453.336	0,03 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 50.000.000	1,50 %	31.05.2019	453.163	0,03 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	¥ 50.000.000	1,71 %	20.03.2019	452.724	0,03 %
Japan Expressway Holding and Debt Repayment Agency	¥ 50.000.000	1,30 %	27.02.2019	450.427	0,03 %
Shinkin Central Bank	¥ 50.000.000	0,25 %	26.06.2020	445.973	0,03 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 40.000.000	1,44 %	24.04.2020	366.572	0,03 %
Japan Finance Organization for Municipalities	¥ 40.000.000	1,90 %	22.06.2018	358.077	0,03 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 325.000	2,13 %	07.02.2019	324.620	0,02 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 310.000	1,50 %	21.07.2021	299.175	0,02 %
Japan International Cooperation Agency	\$ 300.000	1,88 %	13.11.2019	296.961	0,02 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 300.000	2,00 %	04.11.2021	293.737	0,02 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 275.000	2,80 %	13.07.2022	277.778	0,02 %
Japan Expressway Holding and Debt Repayment Agency	¥ 30.000.000	1,60 %	29.08.2018	269.107	0,02 %
Major Joint Local Government Bond	¥ 30.000.000	1,74 %	25.05.2018	268.069	0,02 %
Central Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 30.000.000	0,26 %	02.06.2020	267.371	0,02 %
Norinchukin Bank	¥ 30.000.000	0,24 %	27.11.2019	267.292	0,02 %
Norinchukin Bank	¥ 30.000.000	0,30 %	27.02.2019	267.133	0,02 %
Development Bank of Japan, Inc.	¥ 30.000.000	0,24 %	21.01.2019	266.985	0,02 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	\$ 250.000	2,45 %	16.01.2020	250.000	0,02 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 250.000	2,55 %	08.03.2021	249.297	0,02 %
Mizuho Financial Group, Inc.	\$ 250.000	2,63 %	12.04.2021	248.807	0,02 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 250.000	1,95 %	17.04.2020	248.338	0,02 %
American Honda Finance Corp.	\$ 250.000	1,70 %	09.09.2021	242.896	0,02 %
Dai-ichi Life Insurance Co., Ltd.^	\$ 200.000	7,25 %	25.07.2016	224.750	0,02 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 220.000	2,38 %	16.11.2022	217.203	0,02 %
American Honda Finance Corp.	\$ 200.000	2,45 %	24.09.2020	200.474	0,01 %
Japan Finance Organization for Municipalities	\$ 200.000	2,13 %	06.03.2019	199.288	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 200.000	1,70 %	09.01.2019	199.212	0,01 %
Japan Finance Organization for Municipalities	\$ 200.000	2,63 %	20.04.2022	199.112	0,01 %
Central Nippon Expressway Co., Ltd.	\$ 200.000	2,17 %	05.08.2019	198.744	0,01 %
Tokyo Metropolitan Government	\$ 200.000	2,50 %	08.06.2022	198.052	0,01 %
Tokyo Metropolitan Government	\$ 200.000	2,00 %	17.05.2021	195.002	0,01 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 20.000.000	0,18 %	19.03.2020	177.903	0,01 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	¥ 20.000.000	0,06 %	18.06.2021	177.297	0,01 %
Metropolitan Expressway Co., Ltd.	¥ 20.000.000	0,03 %	17.09.2021	177.054	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Nomura Holdings, Inc.	\$ 170.000	2,75 %	19.03.2019	170.778	0,01 %
Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.	\$ 150.000	2,65 %	19.10.2020	150.202	0,01 %
ORIX Corp.	\$ 150.000	2,90 %	18.07.2022	149.085	0,01 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 150.000	2,44 %	19.10.2021	148.158	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	£ 100.000	2,63 %	15.12.2020	141.459	0,01 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$ 125.000	2,67 %	25.07.2022	123.464	0,01 %
Development Bank of Japan, Inc.	€ 100.000	0,38 %	21.10.2019	120.530	0,01 %
Toyota Credit Canada, Inc.	CAD 150.000	2,20 %	25.02.2021	119.182	0,01 %
Daiwa Securities Group, Inc.	\$ 100.000	3,13 %	19.04.2022	100.414	0,01 %
Mizuho Bank Ltd.	\$ 100.000	2,65 %	25.09.2019	100.397	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 100.000	2,60 %	11.01.2022	100.334	0,01 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	\$ 100.000	2,45 %	10.01.2019	100.217	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 100.000	2,15 %	12.03.2020	99.809	0,01 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 100.000	2,25 %	13.01.2020	99.805	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 100.000	1,70 %	19.02.2019	99.640	0,01 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	\$ 100.000	2,09 %	18.10.2019	99.526	0,01 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 100.000	2,78 %	12.07.2022	99.281	0,01 %
Japan Finance Organization for Municipalities	\$ 100.000	2,13 %	13.04.2021	97.894	0,01 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 100.000	2,06 %	14.07.2021	97.638	0,01 %
American Honda Finance Corp.	\$ 100.000	1,65 %	12.07.2021	97.472	0,01 %
Tokyo Metropolitan Government	€ 10.000.000	1,58 %	20.06.2019	90.789	0,01 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	€ 10.000.000	0,31 %	20.06.2019	89.106	0,01 %
Kyushu Electric Power Co., Inc.	€ 10.000.000	0,82 %	25.04.2018	88.969	0,01 %
Shoko Chukin Bank Ltd.	€ 10.000.000	0,25 %	27.03.2019	88.934	0,01 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	AUD 100.000	3,66 %	29.03.2022	79.078	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 75.000	3,30 %	12.01.2022	77.219	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 75.000	2,13 %	18.07.2019	75.024	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 75.000	1,40 %	20.05.2019	74.265	0,01 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 50.000	2,93 %	09.03.2021	50.392	0,00 %
Suntory Holdings Ltd.	\$ 50.000	2,55 %	29.09.2019	50.056	0,00 %
American Honda Finance Corp.	\$ 50.000	2,60 %	16.11.2022	50.040	0,00 %
American Honda Finance Corp.	\$ 50.000	2,00 %	13.11.2019	49.834	0,00 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	\$ 50.000	1,75 %	29.05.2019	49.633	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 50.000	2,65 %	13.07.2022	49.615	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 50.000	2,15 %	28.09.2020	49.567	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 50.000	2,60 %	28.09.2022	49.400	0,00 %
American Honda Finance Corp.	\$ 50.000	1,20 %	12.07.2019	49.281	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 50.000	1,90 %	08.04.2021	49.185	0,00 %
Development Bank of Japan, Inc.	\$ 50.000	1,63 %	01.09.2021	48.011	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 40.000	1,90 %	14.09.2021	38.891	0,00 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	\$ 25.000	3,20 %	18.07.2022	25.259	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 25.000	2,10 %	17.01.2019	25.017	0,00 %
				145.405.214	10,54 %
Jersey 0,01 % (2016: 0,00 %)					
Aptiv plc	\$ 150.000	3,15 %	19.11.2020	152.150	0,01 %
				152.150	0,01 %
Kasachstan 0,04 % (2016: 0,06 %)					
KazMunayGas National Co. JSC	\$ 250.000	7,00 %	05.05.2020	270.625	0,02 %
KazMunayGas National Co. JSC	\$ 200.000	6,38 %	09.04.2021	218.000	0,02 %
				488.625	0,04 %
Kuwait 0,02 % (2016: 0,00 %)					
Kuwait International Government Bond	\$ 250.000	2,75 %	20.03.2022	249.390	0,02 %
				249.390	0,02 %
Litauen 0,02 % (2016: 0,05 %)					
Lithuania Government International Bond	\$ 300.000	6,13 %	09.03.2021	333.345	0,02 %
				333.345	0,02 %
Malaysia 0,41 % (2016: 0,38 %)					
Malaysia Government Bond	RM 4.000.000	3,66 %	15.10.2020	997.172	0,07 %
Malaysia Government Bond	RM 3.500.000	3,80 %	30.09.2022	866.811	0,06 %
Petronas Global Sukuk Ltd.	\$ 700.000	2,71 %	18.03.2020	700.819	0,05 %
Malaysia Government Bond	RM 2.600.000	3,62 %	30.11.2021	645.559	0,05 %
Malaysia Government Bond	RM 2.100.000	3,65 %	31.10.2019	523.835	0,04 %
Malaysia Government Bond	RM 2.000.000	4,16 %	15.07.2021	507.049	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Malaysia Government Bond	RM 1.800.000	3,76 %	15.03.2019	448.369	0,03 %
Malaysia Government Bond	RM 1.000.000	3,89 %	31.07.2020	250.816	0,02 %
Malaysia Government Bond	RM 900.000	4,38 %	29.11.2019	227.543	0,02 %
Wakala Global Sukuk Bhd	\$ 200.000	4,65 %	06.07.2021	213.950	0,01 %
Malaysia Government Bond	RM 600.000	3,49 %	31.03.2020	149.227	0,01 %
Petronas Capital Ltd.	\$ 100.000	5,25 %	12.08.2019	104.259	0,01 %
				5.635.409	0,41 %
Mexiko 0,49 % (2016: 0,51 %)					
Mexican Bonos	MXN 27.500.000	6,50 %	10.06.2021	1.357.536	0,10 %
Mexican Bonos	MXN 21.000.000	8,00 %	11.06.2020	1.082.012	0,08 %
Mexican Bonos	MXN 15.000.000	6,50 %	09.06.2022	733.850	0,05 %
Mexican Bonos	MXN 15.000.000	5,00 %	11.12.2019	729.749	0,05 %
Mexico Government International Bond	€ 300.000	2,38 %	09.04.2021	384.923	0,03 %
Mexico Government International Bond	\$ 350.000	3,63 %	15.03.2022	362.979	0,03 %
America Movil SAB de CV	\$ 275.000	3,13 %	16.07.2022	277.906	0,02 %
Petroleos Mexicanos	\$ 250.000	5,50 %	21.01.2021	266.468	0,02 %
Petroleos Mexicanos	€ 200.000	2,50 %	21.08.2021	252.026	0,02 %
Grupo Bimbo SAB de CV	\$ 200.000	4,88 %	30.06.2020	211.634	0,01 %
Comision Federal de Electricidad	\$ 200.000	4,88 %	26.05.2021	211.500	0,01 %
Petroleos Mexicanos	\$ 200.000	5,50 %	04.02.2019	206.387	0,01 %
America Movil SAB de CV	\$ 150.000	5,00 %	30.03.2020	157.735	0,01 %
Petroleos Mexicanos	\$ 125.000	6,00 %	05.03.2020	132.919	0,01 %
Petroleos Mexicanos	€ 100.000	3,75 %	15.03.2019	125.038	0,01 %
Petroleos Mexicanos	\$ 100.000	5,38 %	13.03.2022	106.308	0,01 %
America Movil SAB de CV	\$ 100.000	5,00 %	16.10.2019	104.672	0,01 %
Mexico Government International Bond	\$ 75.000	3,50 %	21.01.2021	77.580	0,01 %
				6.781.222	0,49 %
Niederlande 2,20 % (2016: 2,24 %)					
Netherlands Government Bond	€ 2.200.000	0,00 %	15.01.2022	2.670.053	0,19 %
Netherlands Government Bond	€ 1.700.000	0,25 %	15.01.2020	2.076.851	0,15 %
Netherlands Government Bond	€ 1.600.000	4,00 %	15.07.2019	2.059.061	0,15 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 1.400.000	3,00 %	25.10.2021	1.881.148	0,14 %
Netherlands Government Bond	€ 950.000	3,50 %	15.07.2020	1.257.882	0,09 %
ING Bank NV	€ 800.000	2,00 %	28.08.2020	1.017.707	0,07 %
Netherlands Government Bond	€ 700.000	3,25 %	15.07.2021	949.651	0,07 %
ING Groep NV	€ 700.000	0,75 %	09.03.2022	851.698	0,06 %
Nederlandse Financierings Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV	€ 700.000	0,13 %	04.11.2020	850.116	0,06 %
Netherlands Government Bond	€ 600.000	1,25 %	15.01.2019	734.829	0,05 %
ABN AMRO Bank NV	€ 500.000	6,38 %	27.04.2021	714.859	0,05 %
ING Bank NV	€ 500.000	3,38 %	10.01.2022	682.086	0,05 %
Netherlands Government Bond	€ 500.000	2,25 %	15.07.2022	667.751	0,05 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	€ 500.000	0,05 %	10.02.2021	605.991	0,04 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 400.000	3,75 %	09.11.2020	528.014	0,04 %
ABN AMRO Bank NV	£ 300.000	1,38 %	07.06.2022	407.328	0,03 %
ABN AMRO Bank NV^	€ 300.000	2,88 %	30.06.2025	381.275	0,03 %
Aegon Bank NV	€ 300.000	0,25 %	01.12.2020	364.348	0,03 %
NIBC Bank NV	€ 290.000	0,25 %	22.04.2022	349.930	0,03 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	\$ 350.000	2,38 %	01.02.2022	349.595	0,03 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 250.000	1,00 %	19.03.2019	305.565	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 300.000	2,75 %	10.01.2022	302.338	0,02 %
ABN AMRO Bank NV	\$ 300.000	2,10 %	18.01.2019	299.682	0,02 %
ING Bank NV	\$ 300.000	2,00 %	26.11.2018	299.645	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	\$ 300.000	1,75 %	24.03.2020	297.410	0,02 %
ING Bank NV	€ 200.000	4,50 %	21.02.2022	281.520	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	£ 200.000	2,25 %	23.03.2022	281.033	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 200.000	4,38 %	07.06.2021	275.280	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 200.000	4,13 %	12.01.2021	269.488	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	\$ 270.000	1,50 %	15.02.2019	268.447	0,02 %
ING Bank NV^	€ 200.000	3,63 %	25.02.2026	262.422	0,02 %
ABN AMRO Bank NV	€ 200.000	4,75 %	11.01.2019	252.308	0,02 %
ING Bank NV	\$ 250.000	2,50 %	01.10.2019	250.365	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 250.000	2,25 %	14.01.2020	249.708	0,02 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	\$ 250.000	1,50 %	23.01.2019	248.772	0,02 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	€ 200.000	1,63 %	23.08.2019	248.317	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeitsdatum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Bank Nederlandse Gemeenten NV	\$ 250.000	1,63 %	25.11.2019	247.561	0,02 %
NIBC Bank NV	€ 200.000	1,50 %	31.01.2022	247.019	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 200.000	1,75 %	22.01.2019	245.143	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	\$ 220.000	1,75 %	30.10.2019	218.654	0,02 %
Shell International Finance BV	\$ 200.000	4,38 %	25.03.2020	209.317	0,02 %
ING Groep NV	\$ 200.000	3,15 %	29.03.2022	201.779	0,02 %
ING Bank NV	\$ 200.000	2,70 %	17.08.2020	201.011	0,02 %
ING Bank NV	\$ 200.000	2,75 %	22.03.2021	201.011	0,01 %
ING Bank NV	\$ 200.000	2,30 %	22.03.2019	200.037	0,01 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	\$ 200.000	1,75 %	05.09.2019	198.779	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	AUD 250.000	7,25 %	20.04.2018	198.646	0,01 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	\$ 200.000	2,13 %	15.11.2021	198.309	0,01 %
ABN AMRO Bank NV	\$ 200.000	1,80 %	20.09.2019	198.242	0,01 %
Shell International Finance BV	\$ 200.000	1,38 %	10.05.2019	198.067	0,01 %
Shell International Finance BV	\$ 200.000	1,38 %	12.09.2019	197.558	0,01 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	\$ 200.000	1,25 %	09.09.2019	197.028	0,01 %
Shell International Finance BV	\$ 200.000	1,88 %	10.05.2021	196.832	0,01 %
Shell International Finance BV	\$ 200.000	1,75 %	12.09.2021	195.092	0,01 %
LeasePlan Corp.NV	€ 162.000	0,75 %	03.10.2022	194.671	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 150.000	1,88 %	06.06.2019	186.167	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	€ 150.000	0,38 %	14.10.2019	182.858	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	£ 100.000	1,13 %	24.05.2021	136.313	0,01 %
Unilever plc	£ 100.000	1,13 %	03.02.2022	135.211	0,01 %
ING Bank NV	€ 100.000	4,00 %	17.01.2020	130.713	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 100.000	4,13 %	14.01.2020	130.270	0,01 %
NN Group NV	€ 108.000	0,25 %	01.06.2020	130.223	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 100.000	5,88 %	20.05.2019	129.736	0,01 %
Shell International Finance BV ¹	\$ 125.000	2,13 %	11.05.2020	124.731	0,01 %
ABN AMRO Bank NV	€ 100.000	1,88 %	31.07.2019	124.368	0,01 %
Koninklijke DSM NV	€ 100.000	1,75 %	13.11.2019	123.909	0,01 %
ING Bank NV	€ 100.000	0,75 %	24.11.2020	122.436	0,01 %
LeasePlan Corp.NV	€ 100.000	1,00 %	08.04.2020	122.402	0,01 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	€ 100.000	1,13 %	28.01.2019	122.156	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 100.000	0,13 %	11.10.2021	120.103	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	CHF 100.000	2,00 %	06.02.2019	105.326	0,01 %
Koninklijke Philips NV	\$ 100.000	3,75 %	15.03.2022	104.000	0,01 %
ABN AMRO Bank NV	\$ 100.000	2,45 %	04.06.2020	100.001	0,01 %
Unilever Capital Corp.	\$ 100.000	2,10 %	30.07.2020	99.654	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA [^]	\$ 75.000	11,00 %	31.12.2166	83.812	0,01 %
Rabobank Capital Funding Trust IV [^]	£ 50.000	5,56 %	31.12.2166	72.277	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	£ 25.000	1,38 %	09.12.2019	34.244	0,00 %
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 20.000	2,25 %	14.01.2019	20.030	0,00 %
				30.378.169	2,20 %
Neuseeland 0,33 % (2016: 0,37 %)					
New Zealand Government Bond	NZ(\$) 1.000.000	6,00 %	15.05.2021	802.188	0,06 %
New Zealand Government Bond	NZ(\$) 900.000	5,00 %	15.03.2019	664.116	0,05 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	€ 400.000	0,63 %	01.06.2021	487.018	0,04 %
New Zealand Government Bond	NZ(\$) 650.000	3,00 %	15.04.2020	473.567	0,03 %
ASB Finance Ltd.	£ 300.000	1,00 %	07.09.2020	404.141	0,03 %
BNZ International Funding Ltd.	\$ 250.000	2,40 %	21.02.2020	249.692	0,02 %
BNZ International Funding Ltd.	\$ 250.000	2,65 %	03.11.2022	246.587	0,02 %
Westpac Securities NZ Ltd.	€ 200.000	0,13 %	16.06.2021	240.613	0,02 %
BNZ International Funding Ltd.	€ 200.000	0,13 %	17.06.2021	240.381	0,02 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	\$ 200.000	2,88 %	25.01.2022	200.076	0,01 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	CHF 150.000	1,00 %	10.03.2020	158.004	0,01 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	\$ 150.000	2,13 %	28.07.2021	146.659	0,01 %
Westpac Securities NZ Ltd.	€ 100.000	0,88 %	24.06.2019	122.138	0,01 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	\$ 50.000	2,85 %	06.08.2020	50.450	0,00 %
				4.485.630	0,33 %
Norwegen 0,74 % (2016: 0,69 %)					
Norway Government Bond	NOK(kr) 11.600.000	4,50 %	22.05.2019	1.497.140	0,11 %
Statoil A.S.A	€ 1.000.000	5,63 %	11.03.2021	1.411.090	0,10 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	€ 900.000	1,50 %	20.01.2020	1.119.617	0,08 %
Norway Government Bond	NOK(kr) 6.000.000	3,75 %	25.05.2021	803.169	0,06 %
SpareBank 1 SR-Bank A.S.A	€ 475.000	0,38 %	10.02.2022	567.791	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
DNB Boligkreditt A.S.	€ 400.000	0,05 %	11.01.2022	480.236	0,03 %
Sparebanken Soer Boligkreditt A.S.	€ 300.000	0,25 %	22.03.2021	363.230	0,03 %
DNB Boligkreditt A.S.	\$ 300.000	2,50 %	28.03.2022	298.146	0,02 %
Kommunalbanken A.S.	\$ 300.000	1,63 %	10.02.2021	294.456	0,02 %
DNB Boligkreditt A.S.	€ 200.000	3,88 %	16.06.2021	272.595	0,02 %
DNB Bank A.S.A.	€ 200.000	3,88 %	29.06.2020	263.351	0,02 %
Santander Consumer Bank A.S.	€ 200.000	1,00 %	25.02.2019	242.984	0,02 %
Santander Consumer Bank A.S.	€ 200.000	0,38 %	17.02.2020	241.487	0,02 %
SpareBank 1 SMN	€ 200.000	0,50 %	09.03.2022	240.335	0,02 %
Statoil A.S.A	\$ 225.000	2,25 %	08.11.2019	225.064	0,02 %
Kommunalbanken A.S.	\$ 200.000	2,25 %	25.01.2022	199.039	0,01 %
DNB Bank A.S.A	\$ 200.000	2,13 %	02.10.2020	198.286	0,01 %
Kommunalbanken A.S.	£ 100.000	0,88 %	08.12.2020	135.546	0,01 %
Statkraft A.S.	€ 100.000	6,63 %	02.04.2019	130.019	0,01 %
Statoil A.S.A	€ 100.000	2,00 %	10.09.2020	126.461	0,01 %
SpareBank 1 SMN	€ 100.000	1,50 %	20.05.2019	122.648	0,01 %
DNB Bank A.S.A [^]	€ 100.000	1,25 %	01.03.2027	122.048	0,01 %
SpareBank 1 SMN	€ 100.000	0,75 %	08.06.2021	121.910	0,01 %
DNB Boligkreditt A.S.	€ 100.000	0,38 %	20.10.2020	121.845	0,01 %
DNB Boligkreditt A.S.	€ 100.000	0,38 %	07.10.2019	121.542	0,01 %
Sparebanken Vest Boligkreditt A.S.	€ 100.000	0,13 %	02.03.2021	120.728	0,01 %
Statoil A.S.A	\$ 100.000	2,90 %	08.11.2020	101.397	0,01 %
Kommunalbanken A.S.	\$ 100.000	1,75 %	28.05.2019	99.637	0,01 %
DNB Boligkreditt A.S.	NOK(kr) 500.000	5,00 %	25.05.2021	68.331	0,00 %
DNB Boligkreditt A.S.	\$ 50.000	2,00 %	28.05.2020	49.571	0,00 %
Kommunalbanken A.S.	\$ 50.000	1,50 %	22.10.2019	49.451	0,00 %
				10.209.150	0,74 %
Oman 0,02 % (2016: 0,00 %)					
Oman Government International Bond	\$ 250.000	3,88 %	08.03.2022	251.562	0,02 %
				251.562	0,02 %
Panama 0,08 % (2016: 0,07 %)					
Panama Government International Bond	\$ 500.000	5,20 %	30.01.2020	526.875	0,04 %
Global Bank Corp.	\$ 500.000	4,50 %	20.10.2021	510.030	0,04 %
				1.036.905	0,08 %
Peru 0,00 % (2016: 0,00 %)					
Corp. Financiera de Desarrollo SA	\$ 50.000	3,25 %	15.07.2019	50.250	0,00 %
				50.250	0,00 %
Philippinen 0,02 % (2016: 0,03 %)					
Philippine Government International Bond	\$ 100.000	6,50 %	20.01.2020	108.875	0,01 %
Philippine Government International Bond	\$ 100.000	4,00 %	15.01.2021	104.896	0,01 %
				213.771	0,02 %
Polen 0,60 % (2016: 0,62 %)					
Republic of Poland Government Bond	zł 6.000.000	2,25 %	25.04.2022	1.710.142	0,12 %
Republic of Poland Government International Bond	CHF 1.000.000	3,25 %	15.05.2019	1.077.476	0,08 %
Republic of Poland Government Bond	zł 3.250.000	1,50 %	25.04.2020	926.701	0,07 %
Republic of Poland Government Bond	zł 2.600.000	5,25 %	25.10.2020	814.165	0,06 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 550.000	1,63 %	15.01.2019	672.692	0,05 %
Republic of Poland Government Bond	zł 2.000.000	2,50 %	25.01.2023	570.623	0,04 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 400.000	4,20 %	15.04.2020	526.776	0,04 %
Republic of Poland Government International Bond	\$ 400.000	5,13 %	21.04.2021	433.000	0,03 %
Republic of Poland Government Bond	zł 1.500.000	2,00 %	25.04.2021	428.399	0,03 %
Republic of Poland Government Bond	zł 1.300.000	3,25 %	25.07.2019	383.296	0,03 %
Republic of Poland Government International Bond	€ 300.000	0,50 %	20.12.2021	366.544	0,03 %
Republic of Poland Government Bond	zł 600.000	5,50 %	25.10.2019	184.068	0,01 %
Republic of Poland Government International Bond	\$ 150.000	6,38 %	15.07.2019	159.031	0,01 %
				8.252.913	0,60 %
Portugal 0,32 % (2016: 0,05 %)					
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT	€ 2.000.000	2,20 %	17.10.2022	2.597.758	0,19 %
EDP Finance BV	€ 300.000	4,88 %	14.09.2020	406.296	0,03 %
Banco Comercial Portugues SA	€ 300.000	0,75 %	31.05.2022	364.390	0,02 %
EDP Finance BV	€ 200.000	4,13 %	20.01.2021	268.865	0,02 %
Caixa Economica Montepio Geral	€ 200.000	0,88 %	17.10.2022	241.316	0,02 %
EDP Finance BV	€ 100.000	4,13 %	29.06.2020	132.227	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
EDP Finance BV	€ 100.000	2,63 %	15.04.2019	124.150	0,01 %
Banco Santander Totta SA	€ 100.000	1,63 %	11.06.2019	123.112	0,01 %
Banco Santander Totta SA	€ 100.000	0,88 %	27.10.2020	122.816	0,01 %
				4.380.930	0,32 %
Katar 0,10 % (2016: 0,11 %)					
Qatar Government International Bond	\$ 400.000	2,38 %	02.06.2021	392.436	0,03 %
Qatar Government International Bond	\$ 200.000	6,55 %	09.04.2019	210.260	0,02 %
Ooredoo International Finance Ltd.	\$ 200.000	4,75 %	16.02.2021	210.072	0,02 %
Qatari Diar Finance Co.	\$ 200.000	5,00 %	21.07.2020	209.500	0,01 %
CBQ Finance Ltd.	\$ 200.000	3,25 %	13.06.2021	197.000	0,01 %
QNB Finance Ltd.	\$ 200.000	2,13 %	07.09.2021	190.508	0,01 %
				1.409.776	0,10 %
Rumänien 0,02 % (2016: 0,02 %)					
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	€ 200.000	4,88 %	07.11.2019	262.435	0,02 %
				262.435	0,02 %
Russische Föderation 0,15 % (2016: 0,09 %)					
Russian Federal Bond-OFZ	py 40.000.000	7,50 %	27.02.2019	702.156	0,05 %
Russian Federal Bond-OFZ	py 38.000.000	7,60 %	14.04.2021	689.081	0,05 %
Lukoil International Finance BV	\$ 200.000	6,13 %	09.11.2020	215.750	0,02 %
MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC	\$ 200.000	5,55 %	28.10.2020	212.750	0,01 %
Russian Federal Bond-OFZ	py 10.000.000	7,60 %	20.07.2022	178.735	0,01 %
Russian Federal Bond-OFZ	py 7.500.000	6,80 %	11.12.2019	130.416	0,01 %
				2.128.888	0,15 %
Saudi-Arabien 0,05 % (2016: 0,05 %)					
Saudi Government International Bond	\$ 750.000	2,38 %	26.10.2021	731.499	0,05 %
				731.499	0,05 %
Singapur 0,22 % (2016: 0,23 %)					
Singapore Government Bond	SG(\$) 1.000.000	3,25 %	01.09.2020	778.734	0,06 %
Singapore Government Bond	SG(\$) 750.000	2,25 %	01.06.2021	571.592	0,04 %
Singapore Government Bond	SG(\$) 750.000	1,75 %	01.04.2022	562.809	0,04 %
Singapore Government Bond	SG(\$) 650.000	2,00 %	01.07.2020	490.272	0,04 %
Singapore Government Bond	SG(\$) 500.000	1,63 %	01.10.2019	373.990	0,03 %
United Overseas Bank Ltd.^	\$ 200.000	3,50 %	16.09.2026	201.508	0,01 %
Flex Ltd.	\$ 50.000	4,63 %	15.02.2020	51.695	0,00 %
				3.030.600	0,22 %
Slowenien 0,13 % (2016: 0,08 %)					
Staatsanleihe von Slowenien	€ 1.130.000	4,13 %	26.01.2020	1.482.453	0,11 %
Slovenia Government International Bond	\$ 250.000	4,13 %	18.02.2019	255.626	0,02 %
				1.738.079	0,13 %
Südafrika 0,00 % (2016: 0,14 %)					
Africa Finance Corp.	\$ 50.000	4,38 %	29.04.2020	51.312	0,00 %
				51.312	0,00 %
Südkorea 2,10 % (2016: 1,97 %)					
Korea Treasury Bond	₩ 5.300.000.000	1,25 %	10.12.2019	4.871.564	0,35 %
Korea Treasury Bond	₩ 3.350.000.000	1,75 %	10.12.2018	3.125.819	0,23 %
Korea Treasury Bond	₩ 2.500.000.000	1,38 %	10.09.2021	2.259.491	0,16 %
Korea Treasury Bond	₩ 2.400.000.000	1,88 %	10.03.2022	2.200.120	0,16 %
Korea Treasury Bond	₩ 2.300.000.000	2,00 %	10.03.2020	2.142.116	0,16 %
Korea Treasury Bond	₩ 1.800.000.000	5,00 %	10.06.2020	1.793.100	0,13 %
Korea Treasury Bond	₩ 1.800.000.000	1,75 %	10.06.2020	1.665.197	0,12 %
Korea Treasury Bond	₩ 1.600.000.000	4,25 %	10.06.2021	1.591.030	0,12 %
Korea Treasury Bond	₩ 1.700.000.000	2,00 %	10.03.2021	1.575.910	0,11 %
Korea Treasury Bond	₩ 1.200.000.000	2,00 %	10.09.2022	1.103.705	0,08 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 550.000	5,00 %	11.04.2022	592.066	0,04 %
Koreanische Entwicklungsbank	\$ 400.000	2,63 %	27.02.2022	394.108	0,03 %
Korea Gas Corp.	\$ 400.000	1,88 %	18.07.2021	385.184	0,03 %
Korea Treasury Bond	₩ 350.000.000	2,75 %	10.09.2019	330.662	0,02 %
Korea National Housing Bond I	₩ 350.000.000	2,50 %	31.03.2018	327.677	0,02 %
Woori Bank	\$ 300.000	2,63 %	22.07.2020	296.640	0,02 %
Korea National Housing Bond I	₩ 300.000.000	2,50 %	31.01.2018	280.433	0,02 %
Hyundai Capital America	\$ 275.000	3,00 %	18.03.2021	274.224	0,02 %
Koreanische Entwicklungsbank	\$ 250.000	3,00 %	17.03.2019	251.313	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
KT Corp.	\$ 250.000	2,63 %	07.08.2022	243.850	0,02 %
NongHyup Bank	\$ 250.000	1,88 %	12.09.2021	239.773	0,02 %
Korea International Bond	\$ 200.000	7,13 %	16.04.2019	211.774	0,02 %
Korea Resources Corp.	\$ 200.000	3,00 %	24.04.2022	197.803	0,02 %
Hyundai Capital Services, Inc.	\$ 200.000	3,00 %	06.03.2022	197.329	0,02 %
Korea Gas Corp.	\$ 200.000	2,75 %	20.07.2022	197.095	0,02 %
Shinhan Bank Co., Ltd.	\$ 200.000	2,25 %	15.04.2020	196.757	0,01 %
Korea East-West Power Co., Ltd.	\$ 200.000	2,63 %	19.06.2022	195.541	0,01 %
Korea National Oil Corp.	\$ 200.000	2,13 %	14.04.2021	194.173	0,01 %
Korea National Oil Corp.	\$ 200.000	2,00 %	24.10.2021	192.118	0,01 %
Korea Treasury Bond	₩ 200.000.000	3,13 %	10.03.2019	189.382	0,01 %
Korea National Housing Bond I	₩ 150.000.000	2,50 %	30.04.2018	140.510	0,01 %
Korea National Housing Bond I	₩ 150.000.000	2,25 %	30.06.2018	140.506	0,01 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 100.000	4,00 %	29.01.2021	103.017	0,01 %
Hyundai Capital Services, Inc.	\$ 100.000	2,88 %	16.03.2021	99.189	0,01 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 100.000	1,50 %	21.10.2019	97.899	0,01 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 100.000	1,88 %	21.10.2021	95.900	0,01 %
Korea National Housing Bond I	₩ 100.000.000	2,25 %	30.06.2019	93.724	0,01 %
Korea National Housing Bond I	₩ 100.000.000	2,25 %	31.07.2018	93.692	0,01 %
Korea National Housing Bond I	₩ 100.000.000	2,00 %	30.11.2019	93.264	0,01 %
Minera y Metalurgica del Boleo SA de CV	\$ 50.000	2,88 %	07.05.2019	50.010	0,00 %
GS Caltex Corp.	\$ 50.000	3,00 %	18.06.2019	50.007	0,00 %
Korea National Oil Corp.	\$ 50.000	2,75 %	23.01.2019	49.972	0,00 %
Export-Import Bank von Korea	\$ 50.000	2,38 %	12.08.2019	49.759	0,00 %
Korea Hydro & Nuclear Power Co., Ltd.	\$ 50.000	2,38 %	28.10.2019	49.564	0,00 %
Hyundai Capital America	\$ 50.000	2,55 %	03.04.2020	49.557	0,00 %
Export-Import Bank von Korea	CAD 50.000	2,71 %	05.12.2019	39.780	0,00 %
Hyundai Capital America	\$ 25.000	3,10 %	05.04.2022	24.928	0,00 %
				29.037.232	2,10 %
Spanien 2,76 % (2016: 2,75 %)					
Spain Government Bond	€ 2.820.000	5,85 %	31.01.2022	4.165.660	0,30 %
Spain Government Bond	€ 3.100.000	0,25 %	31.01.2019	3.746.702	0,27 %
Spain Government Bond	€ 2.700.000	4,00 %	30.04.2020	3.557.298	0,26 %
Spain Government Bond	€ 2.600.000	1,40 %	31.01.2020	3.228.075	0,23 %
Spain Government Bond	€ 1.995.000	0,40 %	30.04.2022	2.411.527	0,17 %
Spain Government Bond	€ 1.650.000	2,75 %	30.04.2019	2.062.655	0,15 %
Spain Government Bond	€ 1.500.000	1,15 %	30.07.2020	1.860.571	0,13 %
Spain Government Bond	€ 1.500.000	0,05 %	31.01.2021	1.804.057	0,13 %
Spain Government Bond	€ 1.300.000	0,75 %	30.07.2021	1.598.425	0,11 %
Spain Government Bond	€ 800.000	4,30 %	31.10.2019	1.041.808	0,07 %
Spain Government Bond	€ 700.000	5,50 %	30.04.2021	992.334	0,07 %
Bankia SA	€ 700.000	1,13 %	05.08.2022	871.274	0,06 %
CaixaBank SA	€ 600.000	4,50 %	26.01.2022	846.223	0,06 %
Spain Government Bond	€ 600.000	0,45 %	31.10.2022	722.758	0,05 %
Spain Government Bond	€ 500.000	4,60 %	30.07.2019	647.061	0,05 %
Autonomous Community of Madrid Spain	€ 500.000	0,75 %	30.04.2022	609.356	0,04 %
Autonomous Community of Madrid Spain	€ 400.000	2,88 %	06.04.2019	498.517	0,03 %
FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico	€ 300.000	5,90 %	17.03.2021	425.926	0,03 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	€ 300.000	3,50 %	24.01.2021	399.600	0,03 %
Iberdrola International BV	€ 300.000	3,50 %	01.02.2021	397.417	0,03 %
AyT Cedula Cajas IX FTA	€ 300.000	4,00 %	31.03.2020	393.026	0,03 %
Instituto de Credito Oficial	€ 300.000	4,38 %	20.05.2019	383.353	0,03 %
Banco Santander SA	€ 300.000	1,38 %	09.02.2022	371.262	0,03 %
Santander Consumer Finance SA	€ 300.000	1,00 %	26.05.2021	368.162	0,03 %
Autonomous Community of Madrid Spain	€ 300.000	0,73 %	19.05.2021	366.415	0,03 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 300.000	0,32 %	17.10.2020	362.061	0,03 %
Repsol International Finance BV	€ 300.000	0,50 %	23.05.2022	361.643	0,03 %
Banco de Sabadell SA	€ 300.000	0,88 %	05.03.2023	356.660	0,02 %
Iberdrola Finanzas SA	€ 200.000	4,13 %	23.03.2020	261.963	0,02 %
Gas Natural Capital Markets SA	€ 200.000	5,38 %	24.05.2019	258.119	0,02 %
FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico	€ 200.000	3,38 %	17.03.2019	250.597	0,02 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	€ 200.000	1,00 %	20.01.2021	245.965	0,02 %
CaixaBank SA	€ 200.000	0,63 %	12.11.2020	244.598	0,02 %
Santander Consumer Finance SA	€ 200.000	0,75 %	03.04.2019	242.406	0,02 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 100.000	4,69 %	11.11.2019	130.640	0,01 %
Santander International Debt SA	€ 100.000	1,38 %	03.03.2021	124.519	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Santander Consumer Finance SA	€ 100.000	1,50 %	12.11.2020	124.518	0,01 %
Criteria Caixa SAU	€ 100.000	2,38 %	09.05.2019	123.534	0,01 %
Bankia SA	€ 100.000	0,88 %	21.01.2021	123.007	0,01 %
Cajamar Caja Rural SCC	€ 100.000	1,00 %	22.10.2020	122.715	0,01 %
Banco Popular Espanol SA	€ 100.000	0,75 %	29.09.2020	122.608	0,01 %
Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	€ 100.000	1,00 %	28.04.2021	122.430	0,01 %
Banco de Sabadell SA	€ 100.000	0,63 %	03.11.2020	122.212	0,01 %
Bankinter SA	€ 100.000	0,63 %	09.10.2020	122.206	0,01 %
Santander Consumer Finance SA	€ 100.000	0,90 %	18.02.2020	122.079	0,01 %
NorteGas Energia Distribucion SAU	€ 100.000	0,92 %	28.09.2022	120.728	0,01 %
Iberdrola Finance Ireland DAC	\$ 100.000	5,00 %	11.09.2019	104.013	0,01 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	\$ 100.000	3,00 %	20.10.2020	100.884	0,01 %
Bankia SA	€ 50.000	5,00 %	28.06.2019	64.669	0,00 %
				38.104.236	2,76 %
Supranational 3,25 % (2016: 3,53 %)					
Europäische Investitionsbank	€ 1.900.000	0,25 %	15.10.2020	2.323.393	0,17 %
European Financial Stability Facility	€ 1.500.000	0,00 %	17.11.2022	1.805.487	0,13 %
European Stability Mechanism	€ 1.300.000	0,88 %	15.10.2019	1.599.737	0,12 %
Europäische Union	€ 1.300.000	0,25 %	04.07.2020	1.586.669	0,11 %
Europäische Investitionsbank	€ 1.300.000	0,13 %	15.06.2020	1.583.021	0,11 %
Europäische Investitionsbank	€ 1.200.000	2,63 %	16.03.2020	1.539.611	0,11 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 1.350.000	1,88 %	21.04.2020	1.345.546	0,10 %
European Financial Stability Facility	€ 1.050.000	1,25 %	22.01.2019	1.284.318	0,09 %
Europäische Investitionsbank	\$ 1.075.000	2,38 %	15.06.2022	1.075.459	0,08 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 1.055.000	2,00 %	26.01.2022	1.043.400	0,08 %
European Financial Stability Facility	€ 700.000	3,50 %	04.02.2022	968.030	0,07 %
European Financial Stability Facility	€ 700.000	1,75 %	29.10.2020	890.108	0,06 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	£ 600.000	0,38 %	15.06.2021	799.817	0,06 %
Europäische Investitionsbank	\$ 800.000	1,13 %	15.08.2019	789.254	0,06 %
Europäische Investitionsbank	AUD 1.000.000	2,50 %	30.04.2020	786.151	0,06 %
European Stability Mechanism	€ 600.000	1,38 %	04.03.2021	760.354	0,05 %
Europäische Investitionsbank	€ 600.000	1,38 %	15.09.2020	755.276	0,05 %
Inter-American Development Bank	\$ 700.000	2,13 %	18.01.2022	695.973	0,05 %
Asian Development Bank	\$ 700.000	1,75 %	10.01.2020	695.824	0,05 %
Inter-American Development Bank	\$ 600.000	3,88 %	17.09.2019	618.932	0,04 %
Europäische Investitionsbank	\$ 625.000	1,63 %	14.08.2020	617.343	0,04 %
European Financial Stability Facility	€ 500.000	0,00 %	29.03.2021	605.859	0,04 %
International Finance Corp.	\$ 575.000	1,75 %	16.09.2019	572.380	0,04 %
Europäische Investitionsbank	\$ 535.000	1,63 %	16.03.2020	529.860	0,04 %
Europäische Investitionsbank	\$ 525.000	2,00 %	15.12.2022	515.018	0,04 %
European Financial Stability Facility	€ 400.000	2,63 %	02.05.2019	500.446	0,04 %
Europäische Investitionsbank	\$ 500.000	1,25 %	15.05.2019	495.113	0,04 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 500.000	0,88 %	15.08.2019	491.391	0,04 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	\$ 485.000	1,75 %	14.06.2019	483.325	0,03 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	AUD 600.000	3,75 %	23.01.2019	477.630	0,03 %
African Development Bank	\$ 432.000	1,88 %	16.03.2020	430.532	0,03 %
Asian Development Bank	AUD 500.000	6,25 %	05.03.2020	423.997	0,03 %
European Financial Stability Facility	€ 300.000	3,38 %	05.07.2021	406.328	0,03 %
IDB Trust Services Ltd.	\$ 400.000	2,11 %	25.09.2019	398.488	0,03 %
Europäische Investitionsbank	\$ 400.000	2,00 %	15.03.2021	397.549	0,03 %
Asian Development Bank	\$ 400.000	1,63 %	05.05.2020	396.053	0,03 %
International Finance Corp.	AUD 500.000	2,70 %	05.02.2021	394.202	0,03 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	AUD 500.000	2,80 %	12.01.2022	394.081	0,03 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 400.000	1,38 %	24.05.2021	389.040	0,03 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 380.000	1,63 %	04.09.2020	375.256	0,03 %
Asian Development Bank	\$ 375.000	1,75 %	08.06.2021	368.976	0,03 %
Inter-American Development Bank	\$ 370.000	1,00 %	13.05.2019	365.432	0,03 %
European Financial Stability Facility	€ 300.000	0,10 %	19.01.2021	364.628	0,03 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	NZ(\$ 500.000	3,38 %	25.01.2022	362.732	0,03 %
Europäische Investitionsbank	\$ 350.000	2,25 %	15.08.2022	348.402	0,03 %
Inter-American Development Bank	\$ 350.000	1,63 %	12.05.2020	346.518	0,02 %
Asian Development Bank	\$ 350.000	1,50 %	22.01.2020	346.197	0,02 %
Europäische Investitionsbank	\$ 325.000	1,38 %	15.06.2020	319.332	0,02 %
Corp.Andina de Fomento	\$ 305.000	2,00 %	10.05.2019	303.571	0,02 %
Europäische Investitionsbank	\$ 300.000	2,25 %	15.03.2022	298.985	0,02 %
Asian Development Bank	\$ 300.000	2,00 %	16.02.2022	296.774	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 300.000	1,63 %	09.03.2021	294.831	0,02 %
Asian Development Bank	\$ 300.000	1,75 %	13.09.2022	291.262	0,02 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 290.000	2,13 %	13.12.2021	288.704	0,02 %
Inter-American Development Bank	£ 200.000	1,13 %	17.12.2019	273.104	0,02 %
Nordic Investment Bank	£ 200.000	1,00 %	07.03.2019	271.895	0,02 %
European Financial Stability Facility	€ 200.000	1,50 %	22.01.2020	249.718	0,02 %
Europäische Investitionsbank	€ 200.000	1,38 %	15.11.2019	248.535	0,02 %
Corp.Andina de Fomento	\$ 225.000	8,13 %	04.06.2019	242.689	0,02 %
Inter-American Development Bank	\$ 250.000	1,75 %	14.09.2022	242.660	0,02 %
Nordic Investment Bank	\$ 235.000	1,50 %	09.08.2019	233.293	0,02 %
European Stability Mechanism	\$ 230.000	2,13 %	03.11.2022	227.285	0,02 %
African Development Bank	\$ 235.000	1,25 %	26.07.2021	226.845	0,02 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	\$ 225.000	0,88 %	22.07.2019	220.362	0,02 %
African Development Bank	\$ 220.000	2,13 %	16.11.2022	216.787	0,02 %
Europäische Investitionsbank	CHF 200.000	1,25 %	02.08.2019	211.762	0,02 %
Europäische Investitionsbank	\$ 200.000	1,75 %	15.05.2020	198.532	0,01 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	\$ 200.000	1,50 %	16.03.2020	197.585	0,01 %
International Finance Corp.	\$ 200.000	1,63 %	16.07.2020	197.578	0,01 %
African Development Bank	\$ 200.000	1,38 %	12.02.2020	197.300	0,01 %
Europäische Investitionsbank	\$ 200.000	1,63 %	15.12.2020	197.019	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 200.000	1,38 %	20.09.2021	193.811	0,01 %
Europäische Investitionsbank	€ 150.000	0,00 %	15.01.2019	181.127	0,01 %
Europäische Investitionsbank	\$ 175.000	1,38 %	15.09.2021	169.381	0,01 %
Inter-American Development Bank	AUD 200.000	3,75 %	09.10.2018	158.565	0,01 %
Europäische Investitionsbank	AUD 200.000	3,25 %	30.05.2018	157.303	0,01 %
Council Of Europe Development Bank	\$ 155.000	1,50 %	17.05.2019	154.074	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 150.000	1,88 %	07.10.2019	149.668	0,01 %
Europäische Investitionsbank	\$ 150.000	1,75 %	17.06.2019	149.479	0,01 %
Asian Development Bank	\$ 150.000	1,63 %	26.08.2020	147.949	0,01 %
Asian Development Bank	\$ 150.000	1,63 %	16.03.2021	147.396	0,01 %
International Finance Corp.	NZ(\$) 200.000	3,63 %	20.05.2020	145.976	0,01 %
Europäische Investitionsbank	£ 100.000	2,25 %	07.03.2020	139.904	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	£ 100.000	1,38 %	15.12.2020	137.712	0,01 %
Nordic Investment Bank	£ 100.000	0,63 %	02.11.2021	134.058	0,01 %
Corp.Andina de Fomento	\$ 125.000	4,38 %	15.06.2022	132.887	0,01 %
Europäische Investitionsbank	€ 100.000	2,50 %	15.03.2019	124.447	0,01 %
Inter-American Development Bank	\$ 125.000	1,88 %	16.06.2020	124.393	0,01 %
Inter-American Development Bank	\$ 125.000	1,75 %	14.04.2022	122.238	0,01 %
European Stability Mechanism	€ 100.000	0,10 %	03.11.2020	121.777	0,01 %
European Financial Stability Facility	€ 100.000	0,13 %	04.11.2019	121.364	0,01 %
Corp.Andina de Fomento	\$ 120.000	2,20 %	18.07.2020	119.121	0,01 %
Europäische Investitionsbank	CAD 150.000	1,13 %	16.09.2021	115.684	0,01 %
Europäische Investitionsbank	\$ 100.000	2,88 %	15.09.2020	101.893	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 100.000	1,88 %	15.03.2019	99.880	0,01 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	\$ 100.000	2,00 %	01.02.2021	99.381	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	\$ 100.000	1,13 %	27.11.2019	98.281	0,01 %
Entwicklungsbank des Europarates	\$ 100.000	1,63 %	16.03.2021	98.142	0,01 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	\$ 100.000	1,50 %	02.11.2021	97.157	0,01 %
Asian Development Bank	\$ 75.000	1,88 %	12.04.2019	74.903	0,01 %
Entwicklungsbank des Europarates	\$ 75.000	1,63 %	10.03.2020	74.269	0,01 %
Europäische Investitionsbank	\$ 50.000	1,88 %	15.03.2019	49.939	0,00 %
Inter-American Development Bank	\$ 50.000	1,25 %	15.10.2019	49.326	0,00 %
Europäische Investitionsbank	CAD 50.000	2,13 %	04.02.2019	40.019	0,00 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	CAD 50.000	1,88 %	30.05.2019	39.975	0,00 %
Asian Development Bank	AUD 50.000	3,50 %	25.07.2018	39.456	0,00 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	CAD 50.000	1,13 %	11.03.2020	39.243	0,00 %
Europäische Investitionsbank	CAD 50.000	1,13 %	18.02.2020	39.201	0,00 %
Asian Development Bank	CAD 30.000	1,38 %	11.06.2020	23.563	0,00 %
				44.902.486	3,25 %
Schweden 1,67 % (2016: 1,88 %)					
Nordea Hypotek AB	SEK(kr) 11.700.000	1,00 %	08.04.2022	1.450.483	0,10 %
Kommuninvest I Sverige AB	SEK(kr) 10.000.000	0,25 %	01.06.2022	1.213.092	0,09 %
Stadshypotek AB	SEK(kr) 9.000.000	4,25 %	17.06.2020	1.210.886	0,09 %
Sweden Government Bond	SEK(kr) 8.000.000	5,00 %	01.12.2020	1.131.969	0,08 %
Swedbank Hypotek AB	SEK(kr) 8.200.000	1,00 %	15.06.2022	1.015.595	0,07 %
Swedbank Hypotek AB	SEK(kr) 8.000.000	1,00 %	16.12.2020	999.488	0,07 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Skandinaviska Enskilda Banken AB	€ 800.000	2,00 %	18.03.2019	985.399	0,07 %
Swedbank Hypotek AB	€ 700.000	0,15 %	10.02.2021	847.053	0,06 %
Nordea Hypotek AB	SEK(kr) 6.500.000	2,25 %	19.06.2019	822.494	0,06 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	SEK(kr) 5.500.000	1,50 %	15.12.2021	696.437	0,05 %
Swedbank AB	£ 500.000	1,25 %	29.12.2021	676.842	0,05 %
Svensk Exportkredit AB	£ 500.000	0,63 %	07.12.2020	672.348	0,05 %
Sveriges Sakerställda Obligationer AB	SEK(kr) 5.000.000	2,00 %	17.06.2020	639.230	0,04 %
Nordea Bank AB	€ 400.000	4,00 %	11.07.2019	510.984	0,04 %
Fastighets AB Balder	€ 400.000	1,13 %	14.03.2022	484.798	0,03 %
Kommuninvest I Sverige AB	\$ 400.000	1,50 %	23.04.2019	397.570	0,03 %
Sweden Government International Bond	\$ 400.000	1,63 %	24.03.2020	396.496	0,03 %
Vattenfall AB	€ 300.000	6,75 %	31.01.2019	386.646	0,03 %
Kommuninvest I Sverige AB	\$ 375.000	1,13 %	17.09.2019	368.910	0,03 %
Stadshypotek AB	€ 300.000	0,63 %	10.11.2021	368.545	0,03 %
Sweden Government International Bond	€ 300.000	0,75 %	02.05.2019	366.141	0,03 %
Swedbank AB^	€ 300.000	1,00 %	22.11.2027	358.982	0,02 %
Swedbank Hypotek AB	SEK(kr) 2.500.000	5,70 %	12.05.2020	346.626	0,02 %
Swedbank AB	\$ 300.000	2,80 %	14.03.2022	301.239	0,02 %
Sweden Government International Bond	\$ 280.000	1,88 %	02.11.2020	277.861	0,02 %
Nordea Hypotek AB	SEK(kr) 2.000.000	3,25 %	17.06.2020	263.742	0,02 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	SEK(kr) 2.000.000	3,00 %	19.06.2019	256.072	0,02 %
Stadshypotek AB	SEK(kr) 2.000.000	1,50 %	15.12.2021	253.250	0,02 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	\$ 250.000	2,63 %	15.03.2021	250.991	0,02 %
Nordea Bank AB	\$ 250.000	2,50 %	17.09.2020	250.002	0,02 %
Svenska Handelsbanken AB	\$ 250.000	2,45 %	30.03.2021	249.727	0,02 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	\$ 250.000	2,30 %	11.03.2020	249.419	0,02 %
Svensk Exportkredit AB	\$ 250.000	1,75 %	28.08.2020	246.893	0,02 %
Stadshypotek AB	\$ 250.000	1,75 %	09.04.2020	246.580	0,02 %
Swedbank Hypotek AB	€ 200.000	0,38 %	29.09.2020	243.695	0,02 %
Svenska Handelsbanken AB	€ 200.000	0,25 %	28.02.2022	240.058	0,02 %
Svensk Exportkredit AB	\$ 230.000	1,75 %	18.05.2020	227.726	0,02 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	\$ 200.000	2,63 %	17.11.2020	200.802	0,01 %
Swedbank AB	\$ 200.000	2,65 %	10.03.2021	200.515	0,01 %
Sweden Government International Bond	\$ 200.000	1,13 %	15.03.2019	198.007	0,01 %
Nordea Bank AB	\$ 200.000	1,63 %	30.09.2019	197.797	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	€ 150.000	1,88 %	14.11.2019	186.953	0,01 %
Svenska Handelsbanken AB	\$ 170.000	2,25 %	17.06.2019	170.234	0,01 %
Swedbank AB	£ 100.000	1,63 %	15.04.2019	136.553	0,01 %
Kommuninvest I Sverige AB	£ 100.000	1,13 %	06.09.2019	136.204	0,01 %
Kommuninvest I Sverige AB	SEK(kr) 1.000.000	2,25 %	12.03.2019	125.725	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	€ 100.000	1,50 %	25.02.2020	124.574	0,01 %
Svenska Handelsbanken AB^	€ 100.000	2,66 %	15.01.2024	123.106	0,01 %
Swedbank AB	€ 100.000	1,50 %	18.03.2019	122.522	0,01 %
Swedbank AB	€ 100.000	0,63 %	04.01.2021	122.186	0,01 %
Sveriges Sakerställda Obligationer AB	€ 100.000	0,25 %	20.01.2021	121.354	0,01 %
Essity AB	€ 100.000	0,50 %	05.03.2020	121.090	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	€ 100.000	0,15 %	11.02.2021	121.016	0,01 %
Sweden Government International Bond	\$ 115.000	1,50 %	25.07.2019	114.150	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	\$ 100.000	2,45 %	27.05.2020	100.140	0,01 %
Sweden Government International Bond	\$ 100.000	1,63 %	06.04.2020	99.134	0,01 %
Svensk Exportkredit AB	\$ 100.000	1,75 %	10.03.2021	98.395	0,01 %
Svensk Exportkredit AB	\$ 100.000	2,00 %	30.08.2022	98.011	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	\$ 100.000	1,88 %	13.09.2021	97.513	0,01 %
Svensk Exportkredit AB	\$ 50.000	1,88 %	17.06.2019	49.887	0,00 %
				22.970.137	1,67 %
Schweiz 1,16 % (2016: 1,18 %)					
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 2.000.000	1,88 %	13.05.2020	2.163.150	0,16 %
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 1.000.000	2,38 %	27.01.2021	1.111.442	0,08 %
Credit Suisse Group AG	\$ 750.000	3,57 %	09.01.2023	761.347	0,06 %
Canton of Zurich	CHF 700.000	0,50 %	03.12.2020	738.717	0,05 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 600.000	2,00 %	25.05.2022	684.597	0,05 %
Zuercher Kantonalbank	CHF 600.000	2,13 %	29.06.2022	677.763	0,05 %
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	CHF 600.000	0,00 %	06.07.2020	621.488	0,05 %
Credit Suisse AG	€ 500.000	1,13 %	15.09.2020	617.280	0,04 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 500.000	2,00 %	28.04.2021	558.286	0,04 %
Glencore Finance Canada Ltd.	\$ 500.000	4,95 %	15.11.2021	532.500	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Credit Suisse AG	€ 400.000	0,75 %	17.09.2021	492.165	0,04 %
Credit Suisse AG	€ 400.000	0,38 %	11.04.2019	483.295	0,04 %
Swiss Confederation Government Bond	CHF 400.000	2,25 %	06.07.2020	441.416	0,03 %
Roche Holdings, Inc.	\$ 400.000	2,88 %	29.09.2021	405.676	0,03 %
UBS AG	\$ 400.000	2,20 %	08.06.2020	397.567	0,03 %
Credit Suisse AG	€ 300.000	1,75 %	15.01.2021	379.706	0,03 %
Lunar Funding V for Swisscom AG	€ 300.000	2,00 %	30.09.2020	378.857	0,03 %
UBS AG	\$ 350.000	2,38 %	14.08.2019	350.169	0,03 %
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	CHF 300.000	2,63 %	08.02.2019	319.228	0,02 %
Canton of Basel-Landschaft	CHF 300.000	0,50 %	30.03.2022	318.009	0,02 %
Glencore Canada Financial Corp.	£ 200.000	7,38 %	27.05.2020	307.880	0,02 %
Glencore Funding LLC	\$ 300.000	3,00 %	27.10.2022	296.410	0,02 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	\$ 250.000	3,45 %	16.04.2021	255.024	0,02 %
UBS Group Funding Switzerland AG	\$ 250.000	3,00 %	15.04.2021	251.593	0,02 %
Credit Suisse AG	\$ 250.000	2,30 %	28.05.2019	250.432	0,02 %
Credit Suisse AG	€ 200.000	1,00 %	12.03.2019	243.940	0,02 %
Novartis Securities Investment Ltd.	\$ 200.000	5,13 %	10.02.2019	206.417	0,01 %
UBS AG	\$ 200.000	2,45 %	01.12.2020	199.279	0,01 %
UBS Group Funding Switzerland AG^	\$ 200.000	2,86 %	15.08.2023	197.569	0,01 %
Canton of Basel-City	CHF 150.000	1,88 %	31.05.2019	159.282	0,01 %
Credit Suisse AG	\$ 150.000	5,40 %	14.01.2020	158.135	0,01 %
Novartis Capital Corp.	\$ 150.000	2,40 %	17.05.2022	149.351	0,01 %
Novartis Capital Corp.	\$ 150.000	1,80 %	14.02.2020	148.555	0,01 %
Glencore Finance Europe Ltd.	£ 100.000	6,50 %	27.02.2019	143.494	0,01 %
Nestle Holdings, Inc.	£ 100.000	1,75 %	09.12.2020	138.609	0,01 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	\$ 125.000	3,80 %	15.09.2022	128.769	0,01 %
Coca-Cola HBC Finance BV	€ 100.000	2,38 %	18.06.2020	126.150	0,01 %
ELM BV for Swiss Reinsurance Co., Ltd.^	£ 50.000	6,30 %	25.11.2166	71.899	0,01 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	\$ 50.000	2,75 %	26.03.2020	50.129	0,00 %
Roche Holdings, Inc.	\$ 50.000	2,25 %	30.09.2019	50.065	0,00 %
UBS Group Funding Switzerland AG	\$ 25.000	2,95 %	24.09.2020	25.222	0,00 %
Novartis Capital Corp.	\$ 25.000	2,40 %	21.09.2022	24.829	0,00 %
				16.015.691	1,16 %
Thailand 0,19 % (2016: 0,23 %)					
Thailand Government Bond	฿ 30.000.000	5,85 %	31.03.2021	1.041.471	0,08 %
Thailand Government Bond	฿ 15.000.000	3,65 %	17.12.2021	494.310	0,04 %
Thailand Government Bond	฿ 14.000.000	3,88 %	13.06.2019	444.615	0,03 %
Thailand Government Bond	฿ 13.000.000	1,88 %	17.06.2022	400.461	0,03 %
Thailand Government Bond	฿ 6.900.000	5,13 %	13.03.2018	213.352	0,01 %
				2.594.209	0,19 %
Türkei 0,00 % (2016: 0,00 %)					
Türk Telekomunikasyon A.S.	\$ 50.000	3,75 %	19.06.2019	50.312	0,00 %
				50.312	0,00 %
VAE 0,16 % (2016: 0,08 %)					
Emirates Telecommunications Group Co. PJSC	€ 500.000	1,75 %	18.06.2021	628.465	0,05 %
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	\$ 500.000	5,88 %	13.12.2021	550.265	0,04 %
DIB Sukuk Ltd.	\$ 300.000	3,66 %	14.02.2022	302.652	0,02 %
Abu Dhabi Government International Bond	\$ 250.000	2,13 %	03.05.2021	245.277	0,02 %
Emirates NBD PJSC	\$ 200.000	3,25 %	19.11.2019	201.758	0,01 %
First Abu Dhabi Bank PJSC	\$ 200.000	2,25 %	11.02.2020	197.988	0,01 %
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	\$ 100.000	6,25 %	16.09.2019	106.004	0,01 %
				2.232.409	0,16 %
Vereinigtes Königreich 3,64 % (2016: 3,48 %)					
United Kingdom Gilt	£ 3.915.000	1,75 %	22.07.2019	5.402.440	0,39 %
United Kingdom Gilt	£ 3.000.000	1,50 %	22.01.2021	4.174.749	0,30 %
United Kingdom Gilt	£ 2.940.000	2,00 %	22.07.2020	4.129.122	0,30 %
United Kingdom Gilt	£ 1.800.000	8,00 %	07.06.2021	3.046.771	0,22 %
United Kingdom Gilt	£ 1.700.000	1,75 %	07.09.2022	2.407.722	0,17 %
United Kingdom Gilt	£ 1.500.000	3,75 %	07.09.2021	2.262.553	0,16 %
United Kingdom Gilt	£ 950.000	1,25 %	22.07.2018	1.291.281	0,09 %
Nationwide Building Society	€ 800.000	4,63 %	08.02.2021	1.099.819	0,08 %
HSBC Holdings plc	\$ 925.000	3,40 %	08.03.2021	944.735	0,07 %
United Kingdom Gilt	£ 510.000	0,50 %	22.07.2022	683.056	0,05 %
Santander UK plc	€ 500.000	2,63 %	16.07.2020	638.367	0,05 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
BG Energy Capital plc	€ 500.000	3,63 %	16.07.2019	634.953	0,05 %
BP Capital Markets plc	€ 500.000	1,53 %	26.09.2022	632.763	0,05 %
Barclays plc	€ 500.000	1,50 %	01.04.2022	622.933	0,05 %
Barclays Bank plc	£ 400.000	4,25 %	12.01.2022	609.074	0,04 %
Nestle Holdings, Inc.	£ 400.000	1,00 %	11.06.2021	542.253	0,04 %
FCE Bank plc	€ 400.000	0,87 %	13.09.2021	487.873	0,04 %
Standard Chartered plc^	€ 400.000	0,75 %	03.10.2023	479.027	0,03 %
Cadent Finance plc	£ 332.000	1,13 %	22.09.2021	446.312	0,03 %
TSB Banking Group plc^	£ 267.000	5,75 %	06.05.2026	399.731	0,03 %
Coventry Building Society	€ 300.000	2,50 %	18.11.2020	383.875	0,03 %
BAT Capital Corp.	\$ 375.000	2,76 %	15.08.2022	372.890	0,03 %
BAT Capital Corp.	\$ 375.000	2,30 %	14.08.2020	372.809	0,03 %
Vodafone Group plc	€ 300.000	1,25 %	25.08.2021	372.343	0,03 %
BAT International Finance plc	€ 300.000	1,00 %	23.05.2022	367.920	0,03 %
Vodafone Group plc	€ 300.000	0,88 %	17.11.2020	367.568	0,03 %
Lloyds Bank plc	€ 300.000	0,63 %	14.09.2022	367.395	0,03 %
British Telecommunications plc	€ 300.000	0,50 %	23.06.2022	359.937	0,03 %
GlaxoSmithKline Capital plc	€ 300.000	0,00 %	12.09.2020	359.606	0,03 %
Barclays Bank plc	\$ 300.000	5,14 %	14.10.2020	316.962	0,02 %
Skipton Building Society	£ 227.000	1,75 %	30.06.2022	306.016	0,02 %
Eastern Power Networks plc	£ 200.000	4,75 %	30.09.2021	304.138	0,02 %
HSBC Holdings plc^	\$ 300.000	3,26 %	13.03.2023	303.818	0,02 %
Coventry Building Society	£ 225.000	1,00 %	05.05.2020	303.681	0,02 %
BP Capital Markets plc	\$ 300.000	1,68 %	03.05.2019	298.478	0,02 %
Bank of England Euro Note	\$ 300.000	1,25 %	14.03.2019	297.388	0,02 %
Nationwide Building Society	£ 200.000	5,63 %	09.09.2019	291.607	0,02 %
Royal Bank of Scotland plc	€ 200.000	3,88 %	19.10.2020	266.615	0,02 %
Anglo American Capital plc	€ 200.000	3,50 %	28.03.2022	266.487	0,02 %
BP Capital Markets plc	€ 200.000	2,52 %	17.02.2021	258.554	0,02 %
Anglo American Capital plc	\$ 250.000	4,13 %	15.04.2021	257.187	0,02 %
Imperial Brands Finance plc	€ 200.000	2,25 %	26.02.2021	254.104	0,02 %
Unilever NV	€ 200.000	1,75 %	05.08.2020	251.514	0,02 %
Hammerson plc	€ 200.000	2,75 %	26.09.2019	251.389	0,02 %
BP Capital Markets plc	€ 200.000	1,37 %	03.03.2022	251.320	0,02 %
Lloyds Bank plc	\$ 250.000	2,70 %	17.08.2020	250.948	0,02 %
BP Capital Markets plc	€ 200.000	2,99 %	18.02.2019	248.598	0,02 %
British Telecommunications plc	€ 200.000	1,13 %	10.06.2019	244.184	0,02 %
Lloyds Bank plc	€ 200.000	0,50 %	22.07.2020	244.167	0,02 %
Channel Link Enterprises Finance plc^	€ 200.000	1,76 %	30.06.2050	244.145	0,02 %
British Telecommunications plc	€ 200.000	0,63 %	10.03.2021	242.732	0,02 %
Nationwide Building Society	€ 200.000	0,50 %	29.10.2019	242.345	0,02 %
Leeds Building Society	€ 200.000	0,13 %	21.04.2020	241.493	0,02 %
BP AMI Leasing, Inc.	\$ 200.000	5,52 %	08.05.2019	208.217	0,01 %
Santander UK Group Holdings plc	\$ 200.000	3,13 %	08.01.2021	202.012	0,01 %
Barclays plc	\$ 200.000	3,25 %	12.01.2021	201.812	0,01 %
Lloyds Banking Group plc	\$ 200.000	3,00 %	11.01.2022	200.567	0,01 %
Santander UK plc	\$ 200.000	2,50 %	14.03.2019	200.553	0,01 %
HSBC Holdings plc^	\$ 200.000	3,03 %	22.11.2023	200.342	0,01 %
Santander UK plc	\$ 200.000	2,35 %	10.09.2019	200.053	0,01 %
Rolls-Royce plc	\$ 200.000	2,38 %	14.10.2020	198.612	0,01 %
HSBC Holdings plc	\$ 200.000	2,65 %	05.01.2022	198.536	0,01 %
Standard Chartered plc	\$ 200.000	2,10 %	19.08.2019	198.530	0,01 %
Nationwide Building Society	\$ 200.000	2,45 %	27.07.2021	198.277	0,01 %
Lloyds Banking Group plc^	\$ 200.000	2,91 %	07.11.2023	198.052	0,01 %
Santander UK plc	\$ 200.000	2,13 %	03.11.2020	198.018	0,01 %
Reckitt Benckiser Treasury Services plc	\$ 200.000	2,38 %	24.06.2022	195.098	0,01 %
Barclays Bank plc	\$ 150.000	10,18 %	12.06.2021	182.460	0,01 %
Barclays Bank plc	£ 100.000	10,00 %	21.05.2021	169.754	0,01 %
Centrica plc	£ 100.000	6,38 %	10.03.2022	161.621	0,01 %
BP Capital Markets plc	\$ 150.000	3,56 %	01.11.2021	155.690	0,01 %
WPP Finance SA	£ 100.000	6,38 %	06.11.2020	154.446	0,01 %
BP Capital Markets plc	\$ 150.000	2,32 %	13.02.2020	150.417	0,01 %
Southern Gas Networks plc	£ 100.000	4,88 %	21.12.2020	149.653	0,01 %
Co.-Operative Bank plc	£ 100.000	4,75 %	11.11.2021	148.148	0,01 %
Bank of Scotland plc	£ 100.000	6,38 %	16.08.2019	145.975	0,01 %
EE Finance plc	£ 100.000	4,38 %	28.03.2019	140.697	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Nationwide Building Society	€ 100.000	6,75 %	22.07.2020	139.406	0,01 %
FCE Bank plc	£ 100.000	2,76 %	13.11.2019	139.172	0,01 %
Santander UK plc	£ 100.000	1,88 %	17.02.2020	137.662	0,01 %
BAT International Finance plc	£ 100.000	1,75 %	05.07.2021	137.195	0,01 %
Lloyds Bank plc	€ 100.000	6,50 %	24.03.2020	136.843	0,01 %
Royal Bank of Scotland plc	€ 100.000	5,50 %	23.03.2020	134.401	0,01 %
BP Capital Markets plc	\$ 125.000	4,50 %	01.10.2020	132.068	0,01 %
Bank of Scotland plc	€ 100.000	3,88 %	07.02.2020	130.434	0,01 %
Lloyds Bank plc	\$ 130.000	2,30 %	27.11.2018	130.249	0,01 %
ELM BV for RELX Finance	€ 100.000	2,50 %	24.09.2020	127.879	0,01 %
Royal Bank of Scotland Group plc^	€ 100.000	2,00 %	08.03.2023	126.140	0,01 %
Barclays plc	€ 100.000	1,88 %	23.03.2021	125.729	0,01 %
Standard Chartered plc	€ 100.000	4,13 %	18.01.2019	125.343	0,01 %
Nationwide Building Society	\$ 125.000	2,35 %	21.01.2020	124.853	0,01 %
Lloyds Banking Group plc	€ 102.000	0,75 %	09.11.2021	124.434	0,01 %
HSBC Holdings plc^	€ 100.000	3,38 %	10.01.2024	123.979	0,01 %
Yorkshire Building Society	€ 100.000	2,13 %	18.03.2019	123.223	0,01 %
FCE Bank plc	€ 100.000	1,88 %	18.04.2019	123.012	0,01 %
FCE Bank plc	€ 100.000	1,11 %	13.05.2020	122.909	0,01 %
AstraZeneca plc	\$ 125.000	2,38 %	12.06.2022	122.719	0,01 %
Santander UK plc	€ 100.000	0,88 %	25.11.2020	122.585	0,01 %
Nationwide Building Society	€ 100.000	0,75 %	25.06.2019	122.016	0,01 %
Diageo Finance plc	€ 100.000	1,13 %	20.05.2019	121.983	0,01 %
Nationwide Building Society	€ 100.000	0,38 %	30.07.2020	121.705	0,01 %
Lloyds Bank plc	€ 100.000	0,38 %	18.01.2021	121.619	0,01 %
Santander UK plc	€ 100.000	0,38 %	18.09.2019	121.468	0,01 %
Nationwide Building Society	€ 100.000	0,13 %	25.01.2021	120.729	0,01 %
RELX Finance BV	€ 100.000	0,38 %	22.03.2021	120.530	0,01 %
Unilever NV	€ 100.000	0,00 %	29.04.2020	120.248	0,01 %
Diageo Finance plc	€ 100.000	0,00 %	17.11.2020	119.772	0,01 %
WPP Finance 2010	\$ 100.000	4,75 %	21.11.2021	106.841	0,01 %
HSBC Holdings plc	€ 80.000	6,00 %	10.06.2019	104.184	0,01 %
BP Capital Markets plc	\$ 100.000	3,06 %	17.03.2022	102.049	0,01 %
Imperial Brands Finance plc	\$ 100.000	2,95 %	21.07.2020	100.885	0,01 %
BAE Systems Holdings, Inc.	\$ 100.000	2,85 %	15.12.2020	100.399	0,01 %
Barclays plc	\$ 100.000	2,75 %	08.11.2019	100.280	0,01 %
Royal Bank of Scotland Group plc^	\$ 100.000	3,50 %	15.05.2023	100.142	0,01 %
Santander UK plc	\$ 100.000	2,38 %	16.03.2020	100.011	0,01 %
Network Rail Infrastructure Finance plc	\$ 100.000	1,75 %	24.01.2019	99.767	0,01 %
Vodafone Group plc	\$ 75.000	4,38 %	16.03.2021	79.242	0,01 %
BP Capital Markets plc	\$ 75.000	2,24 %	10.05.2019	75.112	0,01 %
Legal & General Group plc^	£ 50.000	5,88 %	01.10.2166	71.014	0,00 %
Vodafone Group plc	\$ 50.000	5,45 %	10.06.2019	52.195	0,00 %
Lloyds Bank plc	\$ 50.000	2,35 %	05.09.2019	50.070	0,00 %
BP Capital Markets plc	\$ 50.000	2,52 %	19.09.2022	49.790	0,00 %
BP Capital Markets plc	\$ 50.000	1,77 %	19.09.2019	49.636	0,00 %
Standard Chartered plc	\$ 50.000	2,25 %	17.04.2020	49.570	0,00 %
				50.246.779	3,64 %
USA 36,29 % (2016: 37,20 %)					
US Treasury Note	\$ 19.792.000	1,38 %	30.09.2019	19.621.912	1,42 %
US Treasury Note	\$ 14.940.000	1,63 %	31.08.2022	14.566.500	1,06 %
US Treasury Note	\$ 13.240.800	1,75 %	30.11.2019	13.207.698	0,96 %
US Treasury Note	\$ 12.775.000	1,75 %	15.11.2020	12.701.145	0,92 %
US Treasury Note	\$ 10.463.000	1,75 %	30.11.2021	10.315.864	0,75 %
US Treasury Note	€ 10.000.000	1,88 %	31.03.2022	9.885.938	0,72 %
US Treasury Note ¹	\$ 9.410.000	1,63 %	15.10.2020	9.326.193	0,68 %
US Treasury Note ¹	\$ 8.250.000	1,88 %	31.01.2022	8.163.632	0,59 %
US Treasury Note	\$ 7.125.000	1,88 %	28.02.2022	7.047.070	0,51 %
US Treasury Note	\$ 6.782.000	1,88 %	30.09.2022	6.683.449	0,48 %
US Treasury Note	\$ 6.493.000	1,00 %	15.03.2019	6.428.070	0,47 %
US Treasury Note	\$ 5.169.700	1,25 %	31.03.2021	5.042.073	0,37 %
US Treasury Note	\$ 4.875.000	1,50 %	28.02.2019	4.855.195	0,35 %
US Treasury Note ¹	\$ 4.795.000	1,13 %	28.02.2021	4.661.639	0,34 %
US Treasury Note	\$ 4.125.000	1,25 %	31.05.2019	4.090.840	0,30 %
US Treasury Note	\$ 4.175.000	1,13 %	30.06.2021	4.042.574	0,29 %
US Treasury Note	\$ 3.875.000	3,13 %	15.05.2019	3.940.996	0,29 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
US Treasury Note	\$ 4.000.000	1,63 %	15.11.2022	3.896.875	0,28 %
US Treasury Note	\$ 3.800.000	1,13 %	31.05.2019	3.762.000	0,27 %
US Treasury Note	\$ 3.619.000	1,63 %	30.04.2019	3.608.256	0,26 %
US Treasury Note	\$ 3.600.000	2,00 %	28.02.2021	3.597.188	0,26 %
US Treasury Note	\$ 3.689.000	1,13 %	31.08.2021	3.563.343	0,26 %
US Treasury Note	\$ 3.570.000	1,38 %	31.03.2020	3.528.722	0,26 %
US Treasury Note	\$ 3.540.000	1,00 %	15.10.2019	3.486.347	0,25 %
US Treasury Note	\$ 3.475.000	2,00 %	31.10.2022	3.444.594	0,25 %
US Treasury Note	\$ 3.525.000	1,13 %	31.07.2021	3.408.785	0,25 %
US Treasury Note	\$ 3.448.000	0,75 %	15.07.2019	3.390.354	0,25 %
US Treasury Note	\$ 3.420.000	1,88 %	31.07.2022	3.372.975	0,24 %
US Treasury Note	\$ 3.397.000	1,38 %	15.09.2020	3.348.699	0,24 %
US Treasury Note	\$ 3.372.000	1,38 %	15.02.2020	3.335.119	0,24 %
US Treasury Note	\$ 3.370.000	1,75 %	30.06.2022	3.308.919	0,24 %
US Treasury Note	\$ 3.244.000	2,00 %	30.11.2022	3.215.108	0,23 %
US Treasury Note	\$ 3.250.000	1,38 %	31.05.2020	3.208.359	0,23 %
US Treasury Note	\$ 3.255.000	1,13 %	30.09.2021	3.140.567	0,23 %
US Treasury Note	\$ 3.055.000	1,50 %	15.04.2020	3.026.837	0,22 %
US Treasury Note	\$ 3.028.000	1,50 %	31.05.2020	2.997.720	0,22 %
US Treasury Note	\$ 3.000.000	1,63 %	31.08.2019	2.987.813	0,22 %
US Treasury Note	\$ 2.997.000	1,13 %	15.01.2019	2.975.459	0,22 %
US Treasury Note	\$ 3.000.000	1,13 %	31.03.2020	2.948.438	0,21 %
US Treasury Note	\$ 3.000.000	1,38 %	31.05.2021	2.932.031	0,21 %
US Treasury Note	\$ 2.945.000	1,13 %	28.02.2019	2.921.072	0,21 %
US Treasury Note	\$ 2.900.000	2,13 %	31.01.2021	2.909.515	0,21 %
US Treasury Note	\$ 2.810.000	1,63 %	31.03.2019	2.802.097	0,20 %
US Treasury Note	\$ 2.682.000	1,75 %	31.05.2022	2.635.065	0,19 %
US Treasury Note	\$ 2.625.000	2,13 %	30.06.2021	2.629.512	0,19 %
US Treasury Note	\$ 2.600.000	2,00 %	31.05.2021	2.595.125	0,19 %
US Treasury Note	\$ 2.631.500	0,88 %	15.06.2019	2.594.906	0,19 %
US Treasury Note	\$ 2.475.000	2,00 %	30.11.2020	2.477.320	0,18 %
US Treasury Note	\$ 2.488.000	1,38 %	31.08.2020	2.451.846	0,18 %
US Treasury Note	\$ 2.350.000	0,88 %	15.09.2019	2.310.711	0,17 %
US Treasury Note	\$ 2.300.000	1,25 %	31.01.2019	2.285.266	0,17 %
US Treasury Note	\$ 2.210.000	2,13 %	31.08.2020	2.220.359	0,16 %
US Treasury Note	\$ 2.230.000	0,88 %	15.04.2019	2.202.473	0,16 %
US Treasury Note	\$ 2.171.000	1,50 %	30.11.2019	2.155.396	0,16 %
US Treasury Note	\$ 2.060.000	1,50 %	31.10.2019	2.046.159	0,15 %
US Treasury Note	\$ 1.960.000	2,63 %	15.11.2020	1.995.219	0,14 %
US Treasury Note	\$ 2.000.000	1,38 %	31.01.2020	1.978.750	0,14 %
US Treasury Note	\$ 1.975.000	1,50 %	31.01.2019	1.967.594	0,14 %
US Treasury Note	\$ 1.980.000	0,88 %	31.07.2019	1.949.991	0,14 %
US Treasury Note	\$ 1.954.000	1,38 %	30.04.2021	1.911.561	0,14 %
US Treasury Note	\$ 1.900.000	1,88 %	31.10.2022	1.872.391	0,14 %
US Treasury Note	\$ 1.756.000	3,38 %	15.11.2019	1.804.290	0,13 %
US Treasury Note	\$ 1.750.000	2,38 %	31.12.2020	1.769.414	0,13 %
US Treasury Note	\$ 1.780.000	1,50 %	15.06.2020	1.761.922	0,13 %
US Treasury Note	\$ 1.762.000	0,75 %	15.02.2019	1.740.526	0,13 %
US Treasury Note	\$ 1.650.000	2,25 %	30.04.2021	1.660.570	0,12 %
US Treasury Note	\$ 1.585.000	1,25 %	30.06.2019	1.570.884	0,11 %
US Treasury Note	\$ 1.585.000	1,50 %	15.05.2020	1.569.645	0,11 %
US Treasury Note	\$ 1.500.000	3,63 %	15.02.2020	1.553.438	0,11 %
US Treasury Note	\$ 1.560.000	1,63 %	31.12.2019	1.551.713	0,11 %
US Treasury Note	\$ 1.530.000	1,38 %	15.12.2019	1.515.178	0,11 %
US Treasury Note	\$ 1.475.000	2,25 %	31.03.2021	1.484.680	0,11 %
US Treasury Note	\$ 1.491.000	1,63 %	15.03.2020	1.482.147	0,11 %
US Treasury Note	\$ 1.460.000	1,88 %	31.12.2019	1.459.772	0,11 %
US Treasury Note	\$ 1.450.000	2,00 %	31.07.2020	1.452.266	0,11 %
US Treasury Note	\$ 1.458.600	1,75 %	31.10.2020	1.450.395	0,11 %
US Treasury Note	\$ 1.465.000	0,88 %	15.05.2019	1.446.001	0,10 %
US Treasury Note	\$ 1.448.200	1,88 %	30.04.2022	1.430.776	0,10 %
US Treasury Note	\$ 1.437.000	1,38 %	31.10.2020	1.413.649	0,10 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.400.000	1,13 %	15.04.2019	1.386.921	0,10 %
US Treasury Note	\$ 1.344.000	0,75 %	15.08.2019	1.320.270	0,10 %
US Treasury Note	\$ 1.300.000	1,63 %	30.11.2020	1.286.797	0,09 %
US Treasury Note	\$ 1.275.000	1,63 %	31.07.2019	1.270.219	0,09 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
US Treasury Note	\$ 1.200.000	3,63 %	15.08.2019	1.233.187	0,09 %
US Treasury Note	\$ 1.205.000	1,25 %	31.08.2019	1.192.762	0,09 %
US Treasury Note	\$ 1.188.200	1,63 %	30.06.2019	1.184.116	0,09 %
US Treasury Note	\$ 1.175.000	1,38 %	29.02.2020	1.161.781	0,08 %
US Treasury Note	\$ 1.100.000	3,63 %	15.02.2021	1.153.453	0,08 %
US Treasury Note	\$ 1.160.000	1,38 %	15.01.2020	1.148.038	0,08 %
US Treasury Note	\$ 1.150.000	2,13 %	30.06.2022	1.147.484	0,08 %
US Treasury Note	\$ 1.150.000	1,75 %	31.03.2022	1.130.953	0,08 %
US Treasury Note	\$ 1.132.000	1,75 %	31.12.2020	1.124.041	0,08 %
Federal Home Loan Banks	\$ 1.100.000	1,50 %	21.10.2019	1.091.589	0,08 %
US Treasury Note	\$ 1.075.000	1,25 %	31.01.2020	1.061.059	0,08 %
US Treasury Note	\$ 1.025.000	1,50 %	31.05.2019	1.019.875	0,07 %
US Treasury Note	\$ 1.031.000	1,38 %	30.04.2020	1.018.274	0,07 %
US Treasury Note	\$ 1.000.000	2,63 %	15.08.2020	1.017.344	0,07 %
US Treasury Note	\$ 1.034.000	1,38 %	31.01.2021	1.014.289	0,07 %
Federal Home Loan Banks	\$ 1.000.000	1,38 %	18.03.2019	994.294	0,07 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 1.000.000	1,38 %	15.08.2019	991.453	0,07 %
Federal National Mortgage Association	\$ 1.000.000	1,50 %	30.07.2020	987.272	0,07 %
US Treasury Note	\$ 950.000	1,25 %	29.02.2020	937.234	0,07 %
Bank of America Corp.^	\$ 899.000	3,00 %	20.12.2023	899.578	0,07 %
General Electric Co.	€ 700.000	0,38 %	17.05.2022	839.384	0,06 %
US Treasury Note	\$ 850.000	1,38 %	30.09.2020	836.984	0,06 %
US Treasury Note	\$ 800.000	3,13 %	15.05.2021	827.875	0,06 %
US Treasury Note	\$ 775.000	3,50 %	15.05.2020	803.215	0,06 %
US Treasury Note	\$ 795.900	1,75 %	30.09.2019	794.159	0,06 %
US Treasury Note	\$ 800.000	1,63 %	30.06.2020	794.125	0,06 %
US Treasury Note	\$ 775.000	1,38 %	28.02.2019	770.762	0,06 %
US Treasury Note	\$ 759.000	2,00 %	30.09.2020	760.067	0,06 %
Federal National Mortgage Association	\$ 750.000	1,63 %	21.01.2020	744.921	0,05 %
US Treasury Note	\$ 750.000	1,13 %	31.12.2019	738.867	0,05 %
US Treasury Note	\$ 740.000	1,00 %	15.11.2019	728.091	0,05 %
US Treasury Note	\$ 675.000	2,13 %	15.08.2021	675.844	0,05 %
Citigroup, Inc.	€ 500.000	7,38 %	04.09.2019	675.269	0,05 %
Medtronic, Inc. ¹	\$ 650.000	3,15 %	15.03.2022	665.825	0,05 %
New York Life Global Funding	\$ 650.000	1,55 %	02.11.2018	647.953	0,05 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 600.000	4,35 %	15.08.2021	635.321	0,05 %
Dow Chemical Co.	\$ 600.000	4,25 %	15.11.2020	626.335	0,05 %
US Treasury Bond	\$ 500.000	7,25 %	15.08.2022	611.875	0,04 %
Bank of America Corp.^	€ 500.000	0,74 %	07.02.2022	609.500	0,04 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 600.000	3,34 %	18.03.2021	609.192	0,04 %
Newell Brands Inc.	\$ 600.000	3,15 %	01.04.2021	606.739	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 600.000	3,00 %	26.04.2022	602.393	0,04 %
US Treasury Note	\$ 605.000	1,13 %	31.01.2019	600.463	0,04 %
Federal National Mortgage Association	\$ 600.000	1,38 %	28.01.2019	597.220	0,04 %
Wells Fargo & Co.	\$ 600.000	2,63 %	22.07.2022	596.497	0,04 %
Federal Home Loan Banks	\$ 600.000	1,38 %	28.05.2019	595.789	0,04 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 600.000	1,50 %	17.01.2020	594.466	0,04 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 600.000	1,63 %	29.09.2020	593.562	0,04 %
Abbott Laboratories	\$ 575.000	2,35 %	22.11.2019	575.912	0,04 %
PepsiCo, Inc.	\$ 575.000	2,15 %	14.10.2020	573.775	0,04 %
Federal Home Loan Banks	\$ 575.000	1,13 %	14.07.2021	555.451	0,04 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 550.000	2,80 %	02.07.2020	552.922	0,04 %
GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	\$ 550.000	2,34 %	15.11.2020	547.770	0,04 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. ¹	\$ 535.000	2,65 %	01.02.2021	537.600	0,04 %
US Treasury Note	\$ 535.000	1,63 %	31.07.2020	530.820	0,04 %
Morgan Stanley	\$ 525.000	2,80 %	16.06.2020	528.983	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	€ 400.000	2,38 %	17.02.2022	519.322	0,04 %
US Treasury Note	\$ 520.000	2,00 %	31.12.2021	517.319	0,04 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 490.000	6,30 %	23.04.2019	515.868	0,04 %
Schlumberger Investment SA	\$ 500.000	3,30 %	14.09.2021	512.056	0,04 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 500.000	2,38 %	13.01.2022	503.265	0,04 %
BB&T Corp.	\$ 500.000	2,25 %	01.02.2019	500.571	0,04 %
Allergan Funding SCS	\$ 500.000	2,45 %	15.06.2019	500.117	0,04 %
US Treasury Note	\$ 500.000	1,88 %	30.06.2020	499.375	0,04 %
AT&T, Inc.	€ 400.000	1,45 %	01.06.2022	499.201	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 500.000	2,88 %	31.10.2022	498.753	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal National Mortgage Association	\$ 500.000	1,88 %	28.12.2020	497.346	0,04 %
Morgan Stanley	\$ 500.000	2,63 %	17.11.2021	497.126	0,04 %
Federal Home Loan Banks	\$ 500.000	1,25 %	16.01.2019	497.115	0,04 %
Federal National Mortgage Association	\$ 500.000	2,00 %	05.01.2022	496.094	0,04 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 500.000	2,50 %	15.07.2022	495.658	0,04 %
American Express Credit Account Master Trust	\$ 500.000	1,77 %	15.11.2022	495.643	0,04 %
US Treasury Note	\$ 500.000	1,88 %	31.05.2022	494.219	0,04 %
Federal National Mortgage Association	\$ 500.000	1,00 %	28.08.2019	492.593	0,04 %
Federal National Mortgage Association	\$ 500.000	1,00 %	24.10.2019	491.734	0,04 %
CVS Health Corp.	\$ 500.000	2,13 %	01.06.2021	488.476	0,04 %
Honeywell International, Inc.	€ 400.000	0,65 %	21.02.2020	486.447	0,04 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 475.000	3,60 %	15.10.2020	484.978	0,04 %
AbbVie, Inc.	€ 400.000	0,38 %	18.11.2019	483.210	0,03 %
Oracle Corp.	\$ 475.000	2,25 %	08.10.2019	476.935	0,03 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 475.000	2,05 %	03.05.2021	468.615	0,03 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 435.000	7,15 %	15.02.2019	458.942	0,03 %
Visa, Inc.	\$ 450.000	2,80 %	14.12.2022	455.934	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 450.000	2,55 %	29.10.2020	451.313	0,03 %
American Express Credit Corp.	€ 370.000	0,63 %	22.11.2021	450.075	0,03 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 452.000	1,38 %	20.04.2020	445.847	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 450.000	2,35 %	15.11.2021	443.235	0,03 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 425.000	4,42 %	15.06.2021	442.858	0,03 %
Bank of America Corp.	£ 300.000	5,50 %	04.12.2019	440.186	0,03 %
John Deere Capital Corp.	\$ 450.000	2,15 %	08.09.2022	439.670	0,03 %
Berkshire Hathaway, Inc.	\$ 431.000	2,20 %	15.03.2021	428.555	0,03 %
Citigroup, Inc.	\$ 400.000	4,50 %	14.01.2022	425.553	0,03 %
HCP, Inc.	\$ 420.000	2,63 %	01.02.2020	421.146	0,03 %
Federal National Mortgage Association	\$ 425.000	2,00 %	05.10.2022	419.758	0,03 %
Citibank NA	\$ 420.000	2,13 %	20.10.2020	415.663	0,03 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 400.000	3,00 %	15.06.2022	407.614	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.	AUD 500.000	5,00 %	21.08.2019	406.108	0,03 %
Mylan NV	€ 326.000	1,25 %	23.11.2020	400.511	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 400.000	2,55 %	01.03.2021	400.443	0,03 %
US Bancorp	\$ 400.000	2,35 %	29.01.2021	399.264	0,03 %
Pfizer, Inc.	\$ 400.000	1,70 %	15.12.2019	398.148	0,03 %
Chevron Corp.	\$ 400.000	2,10 %	16.05.2021	396.842	0,03 %
Federal Home Loan Banks	\$ 400.000	1,38 %	15.11.2019	395.846	0,03 %
Federal Home Loan Banks	\$ 400.000	1,88 %	29.11.2021	395.762	0,03 %
Mondelez International Holdings Netherlands BV	\$ 400.000	1,63 %	28.10.2019	394.516	0,03 %
Apple, Inc.	AUD 500.000	2,85 %	28.08.2019	394.151	0,03 %
Federal Home Loan Banks	\$ 400.000	1,00 %	26.09.2019	393.733	0,03 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 398.000	1,38 %	01.05.2020	392.370	0,03 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 388.000	1,91 %	06.03.2020	386.206	0,03 %
Morgan Stanley	€ 300.000	2,38 %	31.03.2021	384.986	0,03 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	€ 300.000	6,00 %	15.01.2019	383.198	0,03 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 375.000	3,58 %	23.07.2020	381.790	0,03 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	€ 300.000	2,25 %	20.07.2020	380.193	0,03 %
Federal National Mortgage Association	\$ 379.000	1,50 %	28.02.2020	375.232	0,03 %
Federal National Mortgage Association	\$ 375.000	1,88 %	19.02.2019	375.172	0,03 %
Oracle Corp.	\$ 375.000	2,50 %	15.10.2022	374.578	0,03 %
PNC Bank NA	\$ 375.000	1,80 %	05.11.2018	374.489	0,03 %
General Electric Co.	\$ 375.000	2,70 %	09.10.2022	374.248	0,03 %
Chubb INA Holdings, Inc.	\$ 375.000	2,30 %	03.11.2020	374.188	0,03 %
US Treasury Note	\$ 375.000	2,00 %	15.11.2021	373.887	0,03 %
Metropolitan Life Global Funding I	€ 300.000	1,25 %	17.09.2021	373.032	0,03 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 375.000	2,35 %	15.12.2022	372.990	0,03 %
Procter & Gamble Co.	\$ 375.000	1,90 %	23.10.2020	372.670	0,03 %
American Express Co.	\$ 375.000	2,50 %	01.08.2022	370.474	0,03 %
US Treasury Note	\$ 375.000	1,00 %	31.08.2019	369.727	0,03 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 350.000	5,05 %	01.08.2019	365.418	0,03 %
International Business Machines Corp.	€ 300.000	0,50 %	07.09.2021	364.465	0,03 %
Pfizer, Inc.	€ 300.000	0,25 %	06.03.2022	360.247	0,03 %
Amgen, Inc.	\$ 350.000	3,45 %	01.10.2020	359.330	0,03 %
Crown Castle International Corp.	\$ 350.000	3,40 %	15.02.2021	357.115	0,03 %
Morgan Stanley	\$ 325.000	5,50 %	28.07.2021	355.388	0,03 %
Citigroup, Inc.	\$ 350.000	2,65 %	26.10.2020	351.706	0,03 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Apple, Inc.	\$ 350.000	2,25 %	23.02.2021	349.524	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 350.000	2,63 %	25.04.2021	349.489	0,03 %
Bank of America Corp.^	\$ 350.000	2,82 %	21.07.2023	349.312	0,03 %
Morgan Stanley	\$ 350.000	2,50 %	21.04.2021	348.979	0,03 %
Andeavor Logistics LP/Tesoro Logistics Finance Corp.	\$ 350.000	3,50 %	01.12.2022	348.250	0,03 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	\$ 350.000	1,92 %	07.04.2022	348.159	0,03 %
Constellation Brands, Inc.	\$ 350.000	2,70 %	09.05.2022	348.077	0,03 %
Morgan Stanley	\$ 350.000	2,75 %	19.05.2022	347.961	0,03 %
Federal National Mortgage Association	\$ 350.000	1,13 %	14.12.2018	347.728	0,03 %
Walt Disney Co.	\$ 350.000	2,35 %	01.12.2022	346.869	0,03 %
Federal Home Loan Banks	\$ 350.000	1,13 %	21.06.2019	346.172	0,03 %
Federal National Mortgage Association	\$ 350.000	1,88 %	05.04.2022	345.190	0,02 %
Federal National Mortgage Association	\$ 350.000	1,38 %	07.10.2021	340.253	0,02 %
Digital Realty Trust LP	\$ 325.000	3,95 %	01.07.2022	338.939	0,02 %
US Treasury Bond	\$ 300.000	8,13 %	15.08.2019	329.625	0,02 %
Wells Fargo & Co.	\$ 325.000	2,60 %	22.07.2020	326.526	0,02 %
Capital One Financial Corp.	\$ 325.000	2,45 %	24.04.2019	325.453	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 325.000	2,60 %	23.04.2020	325.354	0,02 %
Anthem, Inc.	\$ 325.000	2,95 %	01.12.2022	325.070	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 300.000	6,00 %	15.06.2020	323.840	0,02 %
Synchrony Bank	\$ 325.000	3,00 %	15.06.2022	322.958	0,02 %
United Technologies Corp.	\$ 325.000	1,50 %	01.11.2019	321.156	0,02 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	\$ 300.000	5,63 %	01.02.2021	320.625	0,02 %
Energy Transfer LP	\$ 300.000	5,20 %	01.02.2022	319.748	0,02 %
HP, Inc.	\$ 300.000	4,65 %	09.12.2021	318.865	0,02 %
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 300.000	4,85 %	15.03.2021	316.851	0,02 %
PNC Financial Services Group, Inc.	\$ 300.000	5,13 %	08.02.2020	316.686	0,02 %
El du Pont de Nemours & Co.	\$ 300.000	4,63 %	15.01.2020	313.539	0,02 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 300.000	4,45 %	15.01.2020	313.538	0,02 %
Berkshire Hathaway, Inc.	\$ 300.000	3,75 %	15.08.2021	313.258	0,02 %
Occidental Petroleum Corp.	\$ 300.000	4,10 %	01.02.2021	313.254	0,02 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 300.000	3,25 %	01.09.2022	307.642	0,02 %
Raytheon Co.	\$ 300.000	3,13 %	15.10.2020	306.883	0,02 %
Carnival Corp.	€ 250.000	1,13 %	06.11.2019	306.055	0,02 %
Welltower, Inc.	\$ 300.000	4,13 %	01.04.2019	305.583	0,02 %
AutoNation, Inc.	\$ 300.000	3,35 %	15.01.2021	303.937	0,02 %
Puget Energy, Inc.	\$ 275.000	5,63 %	15.07.2022	303.123	0,02 %
Exelon Generation Co. LLC	\$ 300.000	2,95 %	15.01.2020	303.022	0,02 %
Allergan Funding SCS	\$ 300.000	3,00 %	12.03.2020	302.266	0,02 %
Medtronic, Inc. ¹	\$ 300.000	2,50 %	15.03.2020	301.603	0,02 %
Chevron Corp.	\$ 300.000	2,42 %	17.11.2020	301.324	0,02 %
Morgan Stanley	\$ 300.000	2,65 %	27.01.2020	301.206	0,02 %
AT&T, Inc.	\$ 300.000	2,38 %	27.11.2018	300.747	0,02 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 300.000	2,65 %	01.02.2019	300.114	0,02 %
Wells Fargo & Co.	\$ 300.000	2,50 %	04.03.2021	299.884	0,02 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 300.000	2,60 %	30.11.2020	299.588	0,02 %
John Deere Capital Corp.	\$ 300.000	1,95 %	08.01.2019	299.452	0,02 %
Citigroup, Inc.	\$ 300.000	2,40 %	18.02.2020	299.385	0,02 %
Mercedes-Benz Auto Lease Trust 2017	\$ 300.000	1,79 %	15.04.2020	299.274	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 300.000	2,30 %	13.12.2019	299.222	0,02 %
Discover Card Execution Note Trust	\$ 300.000	1,64 %	15.07.2021	299.085	0,02 %
PNC Bank NA	\$ 300.000	2,30 %	01.06.2020	299.027	0,02 %
Citigroup, Inc.	\$ 300.000	2,75 %	25.04.2022	298.517	0,02 %
Apple, Inc.	\$ 300.000	1,80 %	11.05.2020	297.060	0,02 %
Bank of America Corp.	\$ 300.000	2,50 %	21.10.2022	296.787	0,02 %
Coca-Cola Co.	\$ 300.000	2,20 %	25.05.2022	296.709	0,02 %
Activision Blizzard, Inc.	\$ 300.000	2,30 %	15.09.2021	296.373	0,02 %
US Treasury Note	\$ 300.000	1,00 %	30.09.2019	295.594	0,02 %
Huntington Bancshares, Inc.	\$ 300.000	2,30 %	14.01.2022	295.195	0,02 %
US Treasury Note	\$ 298.800	1,25 %	31.10.2021	289.463	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 281.000	1,88 %	17.11.2020	279.639	0,02 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 275.000	3,48 %	01.06.2019	278.445	0,02 %
Intel Corp.	\$ 275.000	2,70 %	15.12.2022	277.740	0,02 %
Bank of America Corp.	\$ 275.000	2,63 %	19.10.2020	277.111	0,02 %
CF Industries, Inc.	\$ 275.000	3,40 %	01.12.2021	276.351	0,02 %
AbbVie, Inc.	\$ 275.000	2,50 %	14.05.2020	275.631	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 275.000	1,90 %	01.02.2019	274.435	0,02 %
Johnson & Johnson	\$ 275.000	2,25 %	03.03.2022	274.077	0,02 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 275.000	3,00 %	15.01.2022	273.090	0,02 %
Morgan Stanley	\$ 250.000	5,75 %	25.01.2021	272.237	0,02 %
Microsoft Corp.	\$ 275.000	1,85 %	06.02.2020	272.158	0,02 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 275.000	1,88 %	25.02.2021	270.037	0,02 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 275.000	2,20 %	15.01.2021	268.999	0,02 %
AT&T, Inc.	\$ 250.000	5,00 %	01.03.2021	267.657	0,02 %
HSBC Bank USA NA	\$ 250.000	4,88 %	24.08.2020	264.232	0,02 %
Entergy Corp.	\$ 250.000	5,13 %	15.09.2020	264.209	0,02 %
PSEG Power LLC	\$ 250.000	5,13 %	15.04.2020	263.447	0,02 %
Comcast Corp.	\$ 250.000	5,70 %	01.07.2019	262.896	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 200.000	5,13 %	23.10.2019	262.477	0,02 %
TD Ameritrade Holding Corp.	\$ 260.000	2,95 %	01.04.2022	262.471	0,02 %
Norfolk Southern Corp.	\$ 250.000	5,90 %	15.06.2019	262.308	0,02 %
Oracle Corp.	\$ 260.000	1,90 %	15.09.2021	255.740	0,02 %
Total System Services, Inc.	\$ 250.000	3,80 %	01.04.2021	255.627	0,02 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 250.000	3,12 %	15.04.2022	254.675	0,02 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 250.000	3,30 %	25.02.2021	253.847	0,02 %
Reliance Standard Life Global Funding II	\$ 250.000	3,05 %	20.01.2021	252.873	0,02 %
Discover Bank	\$ 250.000	3,10 %	04.06.2020	252.651	0,02 %
LYB International Finance II BV	€ 200.000	1,88 %	02.03.2022	251.879	0,02 %
Altria Group, Inc.	\$ 250.000	2,63 %	14.01.2020	251.508	0,02 %
Kinder Morgan, Inc.	\$ 250.000	3,05 %	01.12.2019	251.091	0,02 %
Bayer US Finance LLC	\$ 250.000	2,38 %	08.10.2019	250.434	0,02 %
Wells Fargo & Co.	\$ 250.000	2,15 %	15.01.2019	250.168	0,02 %
McDonald's Corp.	\$ 250.000	2,63 %	15.01.2022	250.097	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 250.000	2,40 %	09.05.2019	249.985	0,02 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 250.000	3,05 %	30.11.2022	249.943	0,02 %
Visa, Inc.	\$ 250.000	2,20 %	14.12.2020	249.864	0,02 %
Microsoft Corp.	\$ 251.000	1,85 %	12.02.2020	249.819	0,02 %
Altria Group, Inc.	\$ 225.000	9,25 %	06.08.2019	249.470	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	€ 200.000	1,88 %	21.11.2019	249.226	0,02 %
Chevron Phillips Chemical Co. LLC/Chevron Phillips Chemical Co. LP	\$ 250.000	2,45 %	01.05.2020	249.104	0,02 %
Citizens Bank NA	\$ 250.000	2,55 %	13.05.2021	249.100	0,02 %
AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2017	\$ 250.000	1,98 %	20.12.2021	248.974	0,02 %
US Treasury Note	\$ 250.000	1,50 %	31.03.2019	248.906	0,02 %
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A	\$ 250.000	2,07 %	15.05.2022	248.863	0,02 %
Wells Fargo Bank NA	\$ 250.000	1,75 %	24.05.2019	248.554	0,02 %
Georgia Power Co.	\$ 250.000	2,00 %	08.09.2020	248.514	0,02 %
Merck & Co., Inc.	€ 200.000	1,13 %	15.10.2021	248.379	0,02 %
Toyota Auto Receivables 2017-B Owner Trust	\$ 250.000	1,76 %	15.07.2021	248.352	0,02 %
PNC Bank NA	\$ 250.000	2,00 %	19.05.2020	247.934	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 250.000	2,91 %	05.06.2023	247.903	0,02 %
Moody's Corp.	\$ 250.000	2,75 %	15.07.2019	247.874	0,02 %
Cargill, Inc.	€ 200.000	1,88 %	04.09.2019	247.775	0,02 %
Wells Fargo & Co.	€ 200.000	1,13 %	29.10.2021	247.753	0,02 %
Fifth Third Bank	\$ 250.000	2,25 %	14.06.2021	247.276	0,02 %
MassMutual Global Funding II	\$ 250.000	1,55 %	11.10.2019	247.004	0,02 %
Apple, Inc.	\$ 250.000	1,55 %	07.02.2020	246.948	0,02 %
Huntington National Bank	\$ 250.000	2,50 %	07.08.2022	246.549	0,02 %
State Street Corp.	\$ 250.000	1,95 %	19.05.2021	246.431	0,02 %
Compass Bank	\$ 250.000	2,88 %	29.06.2022	246.399	0,02 %
Ryder System, Inc.	\$ 250.000	2,25 %	01.09.2021	245.374	0,02 %
Bank of America Corp.	€ 200.000	1,88 %	10.01.2019	245.081	0,02 %
Capital One Bank USA NA	\$ 245.000	2,25 %	13.02.2019	244.854	0,02 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	€ 200.000	0,80 %	21.01.2022	244.405	0,02 %
Southern Power Co.	€ 200.000	1,00 %	20.06.2022	244.210	0,02 %
Microsoft Corp.	\$ 250.000	1,55 %	08.08.2021	243.436	0,02 %
DH Europe Finance SA	€ 200.000	1,00 %	08.07.2019	243.361	0,02 %
Boston Properties LP	\$ 225.000	5,63 %	15.11.2020	243.295	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 200.000	0,75 %	10.05.2019	242.768	0,02 %
Berkshire Hathaway, Inc.	€ 200.000	0,50 %	13.03.2020	242.577	0,02 %
McDonald's Corp.	€ 200.000	0,50 %	15.01.2021	242.085	0,02 %
Allergan Funding SCS	€ 200.000	0,50 %	01.06.2021	240.329	0,02 %
Pfizer, Inc.	€ 200.000	0,00 %	06.03.2020	240.309	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
NBCUniversal Media LLC	\$ 225.000	5,15 %	30.04.2020	239.172	0,02 %
Ford Motor Credit Co. LLC	AUD 300.000	4,05 %	10.12.2018	237.658	0,02 %
International Paper Co.	\$ 204.000	7,50 %	15.08.2021	237.327	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 225.000	3,87 %	25.04.2021	234.927	0,02 %
Bank of America Corp.	\$ 230.000	2,63 %	19.04.2021	231.174	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 228.000	2,95 %	15.03.2022	229.352	0,02 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 225.000	3,70 %	28.03.2022	227.592	0,02 %
Abbott Laboratories	\$ 225.000	2,90 %	30.11.2021	227.367	0,02 %
Williams Partners LP	\$ 225.000	3,35 %	15.08.2022	226.966	0,02 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	\$ 225.000	2,70 %	18.11.2019	226.421	0,02 %
Home Depot, Inc.	\$ 225.000	2,63 %	01.06.2022	226.121	0,02 %
AT&T, Inc.	\$ 225.000	2,45 %	30.06.2020	224.789	0,02 %
Reynolds American, Inc.	\$ 215.000	3,25 %	12.06.2020	218.340	0,02 %
American International Group, Inc.	\$ 200.000	4,88 %	01.06.2022	217.150	0,02 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	5,75 %	01.02.2021	216.711	0,02 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 215.000	1,82 %	15.03.2019	214.399	0,02 %
General Electric Co.	\$ 200.000	4,65 %	17.10.2021	214.287	0,02 %
MetLife, Inc.	\$ 201.000	4,75 %	08.02.2021	214.179	0,02 %
NiSource Finance Corp.	\$ 200.000	5,45 %	15.09.2020	213.849	0,02 %
Forest Laboratories LLC	\$ 200.000	5,00 %	15.12.2021	213.679	0,02 %
TD Ameritrade Holding Corp.	\$ 200.000	5,60 %	01.12.2019	212.098	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 200.000	4,95 %	25.03.2020	211.309	0,02 %
Western Gas Partners LP	\$ 200.000	5,38 %	01.06.2021	211.065	0,02 %
Republic Services, Inc.	\$ 200.000	5,00 %	01.03.2020	210.540	0,02 %
CSX Corp.	\$ 200.000	4,25 %	01.06.2021	210.136	0,02 %
BlackRock, Inc.	\$ 200.000	5,00 %	10.12.2019	210.115	0,02 %
Time Warner, Inc.	\$ 200.000	4,88 %	15.03.2020	210.060	0,02 %
Discovery Communications LLC	\$ 200.000	5,63 %	15.08.2019	209.827	0,02 %
Xcel Energy, Inc.	\$ 200.000	4,70 %	15.05.2020	208.683	0,02 %
Deere & Co.	\$ 200.000	4,38 %	16.10.2019	207.562	0,01 %
CNH Industrial Capital LLC	\$ 200.000	4,38 %	06.11.2020	207.500	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 215.000	0,00 %	09.10.2019	207.296	0,01 %
Parker-Hannifin Corp.	\$ 200.000	3,50 %	15.09.2022	206.345	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 200.000	3,38 %	15.11.2021	206.149	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 200.000	4,20 %	01.06.2019	206.052	0,01 %
Marathon Petroleum Corp.	\$ 200.000	3,40 %	15.12.2020	204.348	0,01 %
American International Group, Inc.	\$ 200.000	3,38 %	15.08.2020	204.306	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 200.000	3,03 %	25.10.2020	203.450	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	3,20 %	15.01.2021	202.821	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 200.000	3,45 %	14.01.2022	202.312	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 200.000	2,70 %	15.07.2020	202.061	0,01 %
Celgene Corp.	\$ 200.000	2,88 %	15.08.2020	201.840	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 200.000	2,85 %	15.04.2021	201.679	0,01 %
WEA Finance LLC/Westfield UK & Europe Finance plc	\$ 200.000	2,70 %	17.09.2019	201.217	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 200.000	2,80 %	17.02.2021	200.802	0,01 %
Wells Fargo & Co.	\$ 200.000	2,55 %	07.12.2020	200.735	0,01 %
BB&T Corp.	\$ 200.000	2,45 %	15.01.2020	200.575	0,01 %
MassMutual Global Funding II	\$ 200.000	2,45 %	23.11.2020	200.336	0,01 %
Actavis, Inc.	\$ 200.000	3,25 %	01.10.2022	200.302	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 200.000	3,00 %	30.06.2022	200.295	0,01 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 200.000	2,75 %	15.01.2022	200.115	0,01 %
American Express Credit Corp.	\$ 200.000	2,25 %	15.08.2019	200.115	0,01 %
Kroger Co.	\$ 200.000	2,30 %	15.01.2019	199.932	0,01 %
US Bank NA	\$ 200.000	2,13 %	28.10.2019	199.896	0,01 %
Marathon Oil Corp.	\$ 200.000	2,70 %	01.06.2020	199.863	0,01 %
Citigroup, Inc.	\$ 200.000	2,45 %	10.01.2020	199.855	0,01 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	\$ 200.000	2,35 %	15.06.2020	199.815	0,01 %
International Business Machines Corp.	\$ 200.000	1,95 %	12.02.2019	199.796	0,01 %
Capital One Financial Corp.	\$ 200.000	2,50 %	12.05.2020	199.696	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 200.000	1,75 %	20.06.2019	199.616	0,01 %
Bank of America Corp.^	\$ 200.000	2,37 %	21.07.2021	199.410	0,01 %
American Express Credit Corp.	\$ 200.000	2,20 %	03.03.2020	199.330	0,01 %
TTX Co.	\$ 200.000	2,25 %	01.02.2019	199.316	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	2,46 %	27.03.2020	199.307	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 200.000	2,00 %	03.11.2020	199.074	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	2,02 %	03.05.2019	198.947	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 200.000	1,82 %	15.09.2022	198.933	0,01 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 200.000	2,38 %	15.01.2020	198.804	0,01 %
Xcel Energy, Inc.	\$ 200.000	2,40 %	15.03.2021	198.565	0,01 %
Citizens Bank NA	\$ 200.000	2,20 %	26.05.2020	198.431	0,01 %
American Express Co.	\$ 200.000	2,20 %	30.10.2020	198.430	0,01 %
Ukraine Government AID Bonds	\$ 200.000	1,85 %	29.05.2020	198.317	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 200.000	2,91 %	24.07.2023	198.249	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 200.000	2,30 %	15.08.2021	198.231	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 200.000	1,10 %	02.08.2019	197.972	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	2,34 %	02.11.2020	197.961	0,01 %
Fifth Third Auto Trust 2017	\$ 200.000	2,03 %	15.07.2024	197.805	0,01 %
Bunge Ltd. Finance Corp.	\$ 200.000	3,00 %	25.09.2022	197.606	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 200.000	1,50 %	22.06.2020	197.604	0,01 %
Jackson National Life Global Funding	\$ 200.000	2,50 %	27.06.2022	196.868	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 200.000	0,88 %	02.08.2019	196.777	0,01 %
Federal Home Loan Banks	\$ 200.000	0,88 %	05.08.2019	196.760	0,01 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	\$ 200.000	2,40 %	23.09.2021	196.536	0,01 %
Federal Home Loan Banks	\$ 200.000	1,38 %	28.09.2020	196.531	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 196.522	1,87 %	25.11.2019	195.524	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 200.000	1,70 %	09.08.2021	194.626	0,01 %
EOG Resources, Inc.	\$ 190.000	2,45 %	01.04.2020	190.331	0,01 %
Fidelity National Information Services, Inc.	€ 158.000	0,40 %	15.01.2021	189.364	0,01 %
Atmos Energy Corp.	\$ 175.000	8,50 %	15.03.2019	187.948	0,01 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 175.000	5,38 %	15.01.2020	185.310	0,01 %
Nasdaq, Inc.	\$ 175.000	5,55 %	15.01.2020	185.126	0,01 %
Simon Property Group LP	\$ 175.000	4,13 %	01.12.2021	184.496	0,01 %
Xerox Corp.	\$ 175.000	5,63 %	15.12.2019	184.067	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 175.000	4,40 %	22.07.2020	183.841	0,01 %
DDR Corp.	\$ 175.000	4,63 %	15.07.2022	183.824	0,01 %
Sempra Energy	\$ 180.000	2,85 %	15.11.2020	180.841	0,01 %
Wells Fargo & Co.	£ 134.000	1,38 %	30.06.2022	179.870	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	£ 133.000	1,13 %	15.12.2021	178.846	0,01 %
Progress Energy, Inc.	\$ 175.000	3,15 %	01.04.2022	176.628	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 175.000	2,55 %	01.09.2020	176.532	0,01 %
Tyson Foods, Inc.	\$ 175.000	2,65 %	15.08.2019	175.928	0,01 %
CVS Health Corp.	\$ 175.000	2,80 %	20.07.2020	175.731	0,01 %
Walgreen Co.	\$ 175.000	3,10 %	15.09.2022	175.721	0,01 %
PPG Industries, Inc.	\$ 175.000	2,30 %	15.11.2019	174.956	0,01 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	\$ 175.000	1,90 %	23.09.2019	173.475	0,01 %
Honeywell International, Inc.	\$ 175.000	1,40 %	30.10.2019	173.117	0,01 %
US Treasury Note	\$ 174.000	1,88 %	30.11.2021	172.559	0,01 %
Honda Auto Receivables 2017-2 Owner Trust	\$ 172.000	1,68 %	16.08.2021	170.482	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 175.000	1,25 %	17.08.2021	169.601	0,01 %
ConocoPhillips Co.	\$ 160.000	4,20 %	15.03.2021	167.424	0,01 %
US Treasury Note	\$ 170.000	1,13 %	30.04.2020	166.972	0,01 %
US Treasury Note	\$ 165.000	1,25 %	31.03.2019	163.763	0,01 %
Alterra Finance LLC	\$ 150.000	6,25 %	30.09.2020	162.817	0,01 %
Boston Scientific Corp.	\$ 150.000	6,00 %	15.01.2020	159.946	0,01 %
Morgan Stanley	\$ 150.000	7,30 %	13.05.2019	159.917	0,01 %
Ventas Realty LP/Ventas Capital Corp.	\$ 150.000	4,75 %	01.06.2021	159.225	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 150.000	4,50 %	01.04.2021	159.218	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 150.000	5,88 %	01.10.2019	158.945	0,01 %
NBCUniversal Media LLC	\$ 150.000	4,38 %	01.04.2021	158.733	0,01 %
FedEx Corp.	\$ 150.000	8,00 %	15.01.2019	158.643	0,01 %
Nevada Power Co.	\$ 150.000	7,13 %	15.03.2019	158.524	0,01 %
Williams Partners LP	\$ 150.000	5,25 %	15.03.2020	158.510	0,01 %
Entergy Texas, Inc.	\$ 150.000	7,13 %	01.02.2019	157.290	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	\$ 150.000	5,00 %	01.02.2021	157.246	0,01 %
Boeing Co.	\$ 150.000	6,00 %	15.03.2019	156.959	0,01 %
EOG Resources, Inc.	\$ 150.000	5,63 %	01.06.2019	156.791	0,01 %
Anthem, Inc.	\$ 150.000	4,35 %	15.08.2020	156.599	0,01 %
Wells Fargo & Co.	AUD 200.000	3,00 %	27.07.2021	156.169	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 150.000	5,00 %	30.06.2019	155.831	0,01 %
South Carolina Electric & Gas Co.	\$ 150.000	6,50 %	01.11.2018	155.139	0,01 %
Hospitality Properties Trust	\$ 150.000	4,25 %	15.02.2021	155.107	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 150.000	3,80 %	15.03.2022	154.909	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Energy Transfer LP	\$ 150.000	4,15 %	01.10.2020	154.751	0,01 %
Celgene Corp.	\$ 150.000	3,55 %	15.08.2022	154.020	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 150.000	3,50 %	01.10.2020	153.834	0,01 %
American Campus Communities Operating Partnership LP	\$ 150.000	3,35 %	01.10.2020	152.882	0,01 %
Realty Income Corp.	\$ 150.000	3,25 %	15.10.2022	152.428	0,01 %
Exelon Corp.	\$ 150.000	3,50 %	01.06.2022	152.344	0,01 %
DDR Corp.	\$ 150.000	3,50 %	15.01.2021	152.094	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 150.000	3,13 %	16.03.2022	151.948	0,01 %
Intel Corp.	\$ 150.000	2,45 %	29.07.2020	151.011	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 150.000	3,10 %	15.01.2019	150.952	0,01 %
Mylan NV	\$ 150.000	3,15 %	15.06.2021	150.610	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 150.000	2,45 %	27.11.2020	150.370	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 150.000	2,10 %	06.05.2019	150.368	0,01 %
Stryker Corp.	\$ 150.000	2,63 %	15.03.2021	150.365	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 150.000	2,60 %	07.02.2022	150.159	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 150.000	2,31 %	25.03.2020	150.123	0,01 %
PG&E Corp.	\$ 150.000	2,40 %	01.03.2019	150.112	0,01 %
International Business Machines Corp.	\$ 150.000	2,50 %	27.01.2022	150.087	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 150.000	2,50 %	03.12.2020	150.087	0,01 %
Fifth Third Bancorp	\$ 150.000	2,30 %	01.03.2019	150.041	0,01 %
Aviation Capital Group LLC	\$ 150.000	2,88 %	20.01.2022	149.716	0,01 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	\$ 150.000	2,35 %	06.03.2020	149.685	0,01 %
Wells Fargo Bank NA	\$ 150.000	2,15 %	06.12.2019	149.680	0,01 %
Kroger Co.	\$ 150.000	2,60 %	01.02.2021	149.538	0,01 %
Protective Life Global Funding	\$ 150.000	2,26 %	08.04.2020	149.482	0,01 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2017	\$ 150.000	2,01 %	15.03.2022	149.459	0,01 %
International Business Machines Corp.	\$ 150.000	1,90 %	27.01.2020	149.339	0,01 %
Anthem, Inc.	\$ 150.000	2,25 %	15.08.2019	149.330	0,01 %
CVS Health Corp.	\$ 150.000	2,25 %	12.08.2019	149.310	0,01 %
American Express Credit Account Master Trust	\$ 150.000	2,04 %	15.05.2023	149.290	0,01 %
Becton Dickinson and Co.	\$ 150.000	2,89 %	06.06.2022	149.192	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 150.000	2,30 %	11.05.2022	148.738	0,01 %
Citibank NA	\$ 150.000	2,10 %	12.06.2020	148.660	0,01 %
Citigroup, Inc.	\$ 150.000	2,70 %	27.10.2022	148.376	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 150.000	1,55 %	13.09.2019	148.353	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 150.000	1,25 %	02.10.2019	148.244	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 150.000	1,10 %	08.08.2019	147.950	0,01 %
Air Lease Corp.	\$ 150.000	2,63 %	01.07.2022	147.746	0,01 %
Pricoa Global Funding I	\$ 150.000	1,45 %	13.09.2019	147.614	0,01 %
Fidelity National Information Services, Inc.	\$ 150.000	2,25 %	15.08.2021	147.612	0,01 %
US Treasury Note	\$ 150.000	1,00 %	30.11.2019	147.539	0,01 %
Crown Castle International Corp.	\$ 150.000	2,25 %	01.09.2021	147.430	0,01 %
Duke Energy Corp.	\$ 150.000	2,40 %	15.08.2022	147.258	0,01 %
USAA Capital Corp.	\$ 150.000	2,00 %	01.06.2021	147.249	0,01 %
Wells Fargo Canada Corp.	CAD 180.000	3,04 %	29.01.2021	146.485	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 150.000	1,95 %	15.09.2021	146.348	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 150.000	1,75 %	15.08.2021	145.955	0,01 %
Gilead Sciences, Inc. ¹	\$ 145.000	2,05 %	01.04.2019	145.011	0,01 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2016	\$ 144.000	2,21 %	15.05.2024	143.112	0,01 %
Republic Services, Inc.	\$ 135.000	5,50 %	15.09.2019	142.127	0,01 %
Simon Property Group LP	\$ 140.000	2,50 %	01.09.2020	140.576	0,01 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates	\$ 136.151	2,49 %	25.11.2024	135.760	0,01 %
Fidelity National Information Services, Inc.	€ 100.000	1,70 %	30.06.2022	135.383	0,01 %
Procter & Gamble Co.	€ 100.000	4,13 %	07.12.2020	134.659	0,01 %
Tyson Foods, Inc.	\$ 125.000	4,50 %	15.06.2022	133.428	0,01 %
Cardinal Health, Inc.	\$ 125.000	4,63 %	15.12.2020	131.382	0,01 %
Covidien International Finance SA	\$ 125.000	4,20 %	15.06.2020	130.489	0,01 %
American Express Credit Corp.	\$ 130.000	2,70 %	03.03.2022	130.433	0,01 %
Citigroup, Inc.	€ 100.000	5,00 %	02.08.2019	129.758	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 125.000	5,80 %	15.02.2019	129.746	0,01 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	\$ 130.000	1,80 %	20.09.2021	129.310	0,01 %
Duke Energy Indiana LLC	\$ 125.000	3,75 %	15.07.2020	129.157	0,01 %
Exelon Generation Co. LLC	\$ 125.000	4,00 %	01.10.2020	128.802	0,01 %
Fiserv, Inc.	\$ 125.000	3,50 %	01.10.2022	128.664	0,01 %
Time Warner Cable LLC	\$ 120.000	8,25 %	01.04.2019	128.252	0,01 %
KeyBank NA	\$ 130.000	2,40 %	09.06.2022	128.207	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Baxalta, Inc.	\$ 125.000	3,60 %	23.06.2022	127.723	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 125.000	3,05 %	01.09.2022	126.876	0,01 %
Texas Instruments, Inc.	\$ 125.000	2,75 %	12.03.2021	126.624	0,01 %
Newell Brands Inc.	\$ 125.000	2,88 %	01.12.2019	126.141	0,01 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	€ 100.000	2,88 %	18.06.2019	125.347	0,01 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	\$ 125.000	2,70 %	01.04.2020	125.190	0,01 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. ¹	\$ 125.000	2,15 %	01.02.2019	125.022	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 125.000	2,40 %	06.02.2022	124.976	0,01 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	\$ 125.000	1,74 %	19.01.2021	124.749	0,01 %
Becton Dickinson and Co.	\$ 125.000	2,13 %	06.06.2019	124.738	0,01 %
Amgen, Inc.	\$ 125.000	1,90 %	10.05.2019	124.728	0,01 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 125.000	1,88 %	15.01.2019	124.646	0,01 %
State of California	\$ 125.000	2,37 %	01.04.2022	124.605	0,01 %
Amgen, Inc.	€ 100.000	2,13 %	13.09.2019	124.539	0,01 %
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	\$ 125.000	2,40 %	15.06.2020	124.471	0,01 %
GM Financial Automobile Leasing Trust 2017	\$ 125.000	2,12 %	20.09.2021	124.456	0,01 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 125.000	2,40 %	05.06.2020	124.285	0,01 %
PepsiCo, Inc.	\$ 125.000	1,55 %	02.05.2019	124.259	0,01 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 125.000	1,99 %	17.07.2023	124.221	0,01 %
Coca-Cola European Partners US LLC	€ 100.000	2,00 %	05.12.2019	124.173	0,01 %
General Mills, Inc.	\$ 125.000	2,60 %	12.10.2022	124.082	0,01 %
Chevron Corp.	\$ 125.000	2,36 %	05.12.2022	124.023	0,01 %
United Technologies Corp.	€ 100.000	1,13 %	15.12.2021	123.951	0,01 %
AT&T, Inc.	CAD 150.000	3,83 %	25.11.2020	123.837	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 125.000	1,00 %	26.02.2019	123.820	0,01 %
Praxair, Inc.	€ 100.000	1,50 %	11.03.2020	123.810	0,01 %
PepsiCo, Inc.	\$ 125.000	1,85 %	30.04.2020	123.791	0,01 %
General Motors Financial International BV	€ 100.000	1,17 %	18.05.2020	122.902	0,01 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 125.000	1,85 %	20.09.2021	122.680	0,01 %
Caterpillar International Finance DAC	€ 100.000	0,75 %	13.10.2020	122.499	0,01 %
Federal National Mortgage Association	\$ 125.000	1,38 %	26.02.2021	122.367	0,01 %
Procter & Gamble Co.	\$ 125.000	1,70 %	03.11.2021	122.061	0,01 %
Priceline Group, Inc.	€ 100.000	0,80 %	10.03.2022	121.532	0,01 %
Whirlpool Corp.	€ 100.000	0,63 %	12.03.2020	121.431	0,01 %
FedEx Corp.	€ 100.000	0,50 %	09.04.2020	121.063	0,01 %
Johnson & Johnson	€ 100.000	0,25 %	20.01.2022	120.667	0,01 %
Ford Credit Canada Co.	CAD 150.000	2,92 %	16.09.2020	120.461	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 121.000	1,90 %	15.12.2020	120.208	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 115.000	5,00 %	08.07.2019	120.061	0,01 %
Bank of America Corp.^	CAD 150.000	2,60 %	15.03.2023	118.867	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 119.000	2,20 %	22.10.2019	118.865	0,01 %
US Treasury Note	\$ 117.000	1,00 %	30.06.2019	115.556	0,01 %
Southwest Airlines Co.	\$ 115.000	2,65 %	05.11.2020	115.503	0,01 %
Bank of America Corp.	\$ 115.000	2,60 %	15.01.2019	115.451	0,01 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 115.000	3,40 %	18.01.2023	114.549	0,01 %
Jefferies Group LLC	\$ 100.000	6,88 %	15.04.2021	111.785	0,01 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 100.000	6,88 %	15.11.2019	108.360	0,01 %
Valero Energy Corp.	\$ 100.000	9,38 %	15.03.2019	108.267	0,01 %
Liberty Mutual Group, Inc.	\$ 100.000	4,95 %	01.05.2022	107.920	0,01 %
General Electric Co.	\$ 100.000	5,30 %	11.02.2021	107.554	0,01 %
Whirlpool Corp.	\$ 100.000	4,70 %	01.06.2022	107.338	0,01 %
Florida Gas Transmission Co. LLC	\$ 100.000	7,90 %	15.05.2019	107.118	0,01 %
General Electric Co.	\$ 100.000	5,55 %	04.05.2020	107.067	0,01 %
ONEOK Partners LP	\$ 100.000	8,63 %	01.03.2019	106.778	0,01 %
Time Warner Cable LLC	\$ 100.000	8,75 %	14.02.2019	106.770	0,01 %
EQT Corp.	\$ 100.000	4,88 %	15.11.2021	106.701	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 100.000	5,00 %	01.10.2021	106.537	0,01 %
Energy Transfer LP/Regency Energy Finance Corp.	\$ 100.000	5,00 %	01.10.2022	106.500	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 100.000	5,30 %	15.09.2020	106.376	0,01 %
Roper Technologies, Inc.	\$ 100.000	6,25 %	01.09.2019	106.274	0,01 %
Comcast Corp.	\$ 100.000	5,15 %	01.03.2020	106.170	0,01 %
General Electric Co.	\$ 100.000	5,50 %	08.01.2020	106.142	0,01 %
Home Depot, Inc.	\$ 100.000	4,40 %	01.04.2021	105.964	0,01 %
General Electric Co.	\$ 100.000	6,00 %	07.08.2019	105.720	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 100.000	5,20 %	15.03.2020	105.699	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	\$ 100.000	4,50 %	01.03.2021	105.650	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
AT&T, Inc.	\$ 100.000	4,45 %	15.05.2021	105.544	0,01 %
Indiana Michigan Power Co.	\$ 100.000	7,00 %	15.03.2019	105.437	0,01 %
Morgan Stanley	\$ 100.000	5,63 %	23.09.2019	105.416	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 100.000	4,60 %	15.02.2021	105.289	0,01 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 100.000	4,40 %	15.10.2022	105.076	0,01 %
Travelers Cos, Inc.	\$ 100.000	5,90 %	02.06.2019	105.059	0,01 %
Illinois Tool Works, Inc.	\$ 100.000	6,25 %	01.04.2019	105.013	0,01 %
General Electric Co.	\$ 100.000	4,38 %	16.09.2020	104.924	0,01 %
United Technologies Corp.	\$ 100.000	4,50 %	15.04.2020	104.866	0,01 %
L3 Technologies, Inc.	\$ 100.000	5,20 %	15.10.2019	104.797	0,01 %
Omnicom Group, Inc.	\$ 100.000	4,45 %	15.08.2020	104.780	0,01 %
Viacom, Inc.	\$ 100.000	5,63 %	15.09.2019	104.666	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 105.000	1,75 %	09.10.2019	104.631	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 100.000	4,60 %	15.01.2020	104.626	0,01 %
Alphabet, Inc.	\$ 100.000	3,63 %	19.05.2021	104.597	0,01 %
Enbridge Energy Partners LP	\$ 100.000	4,38 %	15.10.2020	104.325	0,01 %
Time Warner Cable LLC	\$ 100.000	5,00 %	01.02.2020	104.287	0,01 %
Magellan Midstream Partners LP	\$ 100.000	4,25 %	01.02.2021	104.202	0,01 %
Medtronic, Inc.	\$ 100.000	5,60 %	15.03.2019	104.143	0,01 %
Devon Energy Corp.	\$ 100.000	4,00 %	15.07.2021	104.096	0,01 %
Abbott Laboratories	\$ 100.000	4,13 %	27.05.2020	103.692	0,01 %
Travelers Cos, Inc.	\$ 100.000	3,90 %	01.11.2020	103.661	0,01 %
Eversource Energy	\$ 100.000	4,50 %	15.11.2019	103.654	0,01 %
Williams Partners LP	\$ 100.000	4,13 %	15.11.2020	103.598	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 100.000	5,13 %	01.04.2019	103.526	0,01 %
Bank of America Corp.	\$ 100.000	5,49 %	15.03.2019	103.420	0,01 %
Duke Energy Progress LLC	\$ 100.000	5,30 %	15.01.2019	103.229	0,01 %
Amazon.com, Inc.	\$ 100.000	3,30 %	05.12.2021	103.179	0,01 %
LG&E & KU Energy LLC	\$ 100.000	3,75 %	15.11.2020	103.158	0,01 %
Electronic Arts, Inc.	\$ 100.000	3,70 %	01.03.2021	102.902	0,01 %
Kohl's Corp.	\$ 100.000	4,00 %	01.11.2021	102.840	0,01 %
Constellation Brands, Inc.	\$ 100.000	3,88 %	15.11.2019	102.724	0,01 %
Time Warner Cable LLC	\$ 100.000	4,00 %	01.09.2021	102.714	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 100.000	3,13 %	15.01.2021	102.567	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 100.000	3,70 %	24.11.2020	102.428	0,01 %
Ares Capital Corp.	\$ 100.000	4,88 %	30.11.2018	102.296	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 100.000	3,00 %	01.10.2020	102.281	0,01 %
AmerisourceBergen Corp.	\$ 100.000	3,50 %	15.11.2021	102.270	0,01 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	\$ 100.000	3,50 %	15.09.2021	102.001	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 103.000	1,25 %	01.08.2019	101.941	0,01 %
Baker Hughes a GE Co. LLC	\$ 100.000	3,20 %	15.08.2021	101.832	0,01 %
Williams Partners LP	\$ 100.000	3,60 %	15.03.2022	101.775	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 100.000	3,05 %	15.03.2022	101.758	0,01 %
American Tower Corp.	\$ 100.000	3,30 %	15.02.2021	101.706	0,01 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	\$ 100.000	2,90 %	15.10.2020	101.664	0,01 %
Clorox Co.	\$ 100.000	3,05 %	15.09.2022	101.556	0,01 %
Motorola Solutions, Inc.	\$ 100.000	3,75 %	15.05.2022	101.509	0,01 %
Biogen, Inc.	\$ 100.000	2,90 %	15.09.2020	101.405	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 100.000	3,00 %	01.11.2021	101.174	0,01 %
Marriott International, Inc.	\$ 100.000	3,13 %	15.10.2021	101.140	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 100.000	3,20 %	13.07.2020	101.118	0,01 %
AT&T, Inc.	\$ 100.000	3,20 %	01.03.2022	101.069	0,01 %
Applied Materials, Inc.	\$ 100.000	2,63 %	01.10.2020	101.047	0,01 %
McDonald's Corp.	\$ 100.000	2,75 %	09.12.2020	101.016	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 100.000	3,15 %	15.01.2020	100.985	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 100.000	3,20 %	06.07.2021	100.953	0,01 %
Emerson Electric Co.	\$ 100.000	2,63 %	01.12.2021	100.929	0,01 %
Fortune Brands Home & Security, Inc.	\$ 100.000	3,00 %	15.06.2020	100.898	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 100.000	2,70 %	13.05.2022	100.800	0,01 %
Southwest Airlines Co.	\$ 100.000	2,75 %	06.11.2019	100.800	0,01 %
Dominion Energy Gas Holdings LLC	\$ 100.000	2,80 %	15.11.2020	100.743	0,01 %
Synchrony Financial	\$ 100.000	3,00 %	15.08.2019	100.727	0,01 %
Bank of America Corp.	\$ 100.000	2,65 %	01.04.2019	100.690	0,01 %
Southern Co.	\$ 100.000	2,75 %	15.06.2020	100.687	0,01 %
Eastman Chemical Co.	\$ 100.000	2,70 %	15.01.2020	100.653	0,01 %
Ryder System, Inc.	\$ 100.000	2,88 %	01.09.2020	100.652	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Hasbro, Inc.	\$ 100.000	3,15 %	15.05.2021	100.651	0,01 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 100.000	3,13 %	08.11.2021	100.540	0,01 %
Baxalta, Inc.	\$ 100.000	2,88 %	23.06.2020	100.537	0,01 %
FLIR Systems, Inc.	\$ 100.000	3,13 %	15.06.2021	100.456	0,01 %
American Express Credit Corp.	\$ 100.000	2,60 %	14.09.2020	100.416	0,01 %
Abbott Laboratories	\$ 100.000	2,80 %	15.09.2020	100.415	0,01 %
Morgan Stanley	\$ 100.000	2,50 %	24.01.2019	100.402	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 100.000	2,63 %	31.01.2019	100.396	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 100.000	2,75 %	15.09.2020	100.354	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 100.000	2,55 %	15.10.2019	100.305	0,01 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 100.000	2,50 %	01.12.2019	100.253	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 100.000	2,35 %	28.01.2019	100.227	0,01 %
Citigroup, Inc.	\$ 100.000	2,50 %	29.07.2019	100.224	0,01 %
Buckeye Partners LP	\$ 100.000	2,65 %	15.11.2018	100.183	0,01 %
HSBC USA, Inc.	\$ 100.000	2,38 %	13.11.2019	100.164	0,01 %
John Deere Capital Corp.	\$ 100.000	2,45 %	11.09.2020	100.156	0,01 %
Union Pacific Corp.	\$ 100.000	2,25 %	19.06.2020	100.145	0,01 %
Packaging Corp. of America	\$ 100.000	2,45 %	15.12.2020	100.144	0,01 %
Amphenol Corp.	\$ 100.000	2,55 %	30.01.2019	100.144	0,01 %
Oracle Corp.	\$ 100.000	2,63 %	15.02.2023	100.136	0,01 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	\$ 100.000	2,15 %	15.07.2021	100.130	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 100.000	2,25 %	01.12.2019	100.124	0,01 %
PNC Bank NA	\$ 100.000	2,40 %	18.10.2019	100.110	0,01 %
Manufacturers & Traders Trust Co.	\$ 100.000	2,30 %	30.01.2019	100.101	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 100.000	2,50 %	09.02.2022	100.097	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	\$ 100.000	2,15 %	14.12.2018	100.090	0,01 %
Ameren Corp.	\$ 100.000	2,70 %	15.11.2020	100.083	0,01 %
Bank of America Corp.^	\$ 100.000	2,88 %	24.04.2023	100.073	0,01 %
Roper Technologies, Inc.	\$ 100.000	2,80 %	15.12.2021	100.056	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.000	2,22 %	25.12.2018	100.053	0,01 %
Huntington National Bank	\$ 100.000	2,20 %	06.11.2018	100.046	0,01 %
Autodesk, Inc.	\$ 100.000	3,13 %	15.06.2020	100.036	0,01 %
ERP Operating LP	\$ 100.000	2,38 %	01.07.2019	100.032	0,01 %
Discover Card Execution Note Trust	\$ 100.000	2,39 %	15.07.2024	100.000	0,01 %
Bank of America Corp. ¹	\$ 100.000	2,25 %	21.04.2020	99.979	0,01 %
World Financial Network Credit Card Master Trust	\$ 100.000	1,61 %	15.12.2021	99.973	0,01 %
Discover Card Execution Note Trust	\$ 100.000	2,19 %	17.04.2023	99.960	0,01 %
Walt Disney Co.	\$ 100.000	2,30 %	12.02.2021	99.955	0,01 %
AbbVie, Inc.	\$ 100.000	2,00 %	06.11.2018	99.955	0,01 %
American Express Credit Corp.	\$ 100.000	2,38 %	26.05.2020	99.920	0,01 %
eBay, Inc.	\$ 100.000	2,20 %	01.08.2019	99.902	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 100.000	2,65 %	08.04.2022	99.899	0,01 %
Mylan, Inc.	\$ 100.000	2,55 %	28.03.2019	99.898	0,01 %
Smithfield Foods, Inc.	\$ 100.000	3,35 %	01.02.2022	99.867	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 100.000	3,15 %	30.06.2022	99.866	0,01 %
JM Smucker Co.	\$ 100.000	2,20 %	06.12.2019	99.863	0,01 %
Baker Hughes a GE Co. LLC/Baker Hughes Co.-Obligor, Inc.	\$ 100.000	2,77 %	15.12.2022	99.857	0,01 %
Aetna, Inc.	\$ 100.000	2,20 %	15.03.2019	99.854	0,01 %
VMware, Inc.	\$ 100.000	2,95 %	21.08.2022	99.806	0,01 %
Coca-Cola Co.	\$ 100.000	1,65 %	01.11.2018	99.800	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 100.000	2,10 %	10.01.2020	99.786	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 100.000	2,15 %	09.02.2022	99.786	0,01 %
Duke Energy Florida LLC	\$ 100.000	2,10 %	15.12.2019	99.785	0,01 %
State Board of Administration Finance Corp.	\$ 100.000	2,16 %	01.07.2019	99.784	0,01 %
Wells Fargo & Co.	\$ 100.000	2,15 %	30.01.2020	99.780	0,01 %
Illinois Tool Works, Inc.	\$ 100.000	1,95 %	01.03.2019	99.779	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 100.000	1,88 %	15.01.2019	99.778	0,01 %
Ecolab, Inc.	\$ 100.000	2,25 %	12.01.2020	99.766	0,01 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 100.000	1,85 %	23.11.2018	99.751	0,01 %
Amgen, Inc.	\$ 100.000	2,65 %	11.05.2022	99.734	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 100.000	2,00 %	29.11.2019	99.715	0,01 %
Procter & Gamble Co.	\$ 100.000	1,75 %	25.10.2019	99.710	0,01 %
Mercedes-Benz Auto Lease Trust 2017	\$ 100.000	2,01 %	17.01.2023	99.695	0,01 %
Walt Disney Co.	\$ 100.000	1,85 %	30.05.2019	99.664	0,01 %
Walt Disney Co.	\$ 100.000	1,95 %	04.03.2020	99.663	0,01 %
Discover Card Execution Note Trust	\$ 100.000	1,45 %	15.03.2021	99.663	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
John Deere Capital Corp.	\$ 100.000	2,05 %	10.03.2020	99.661	0,01 %
Amgen, Inc.	\$ 100.000	2,20 %	11.05.2020	99.659	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 100.000	1,70 %	15.02.2019	99.655	0,01 %
Bristol-Myers Squibb Co.	\$ 100.000	1,75 %	01.03.2019	99.653	0,01 %
American Express Credit Account Master Trust	\$ 100.000	2,35 %	15.05.2025	99.650	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 100.000	2,98 %	03.08.2022	99.645	0,01 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 100.000	1,85 %	20.05.2019	99.643	0,01 %
ConocoPhillips Co.	\$ 100.000	2,20 %	15.05.2020	99.640	0,01 %
American Express Credit Corp.	\$ 100.000	1,88 %	03.05.2019	99.635	0,01 %
Chevron Corp.	\$ 100.000	1,96 %	03.03.2020	99.603	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 100.000	1,80 %	13.11.2019	99.594	0,01 %
Microsoft Corp.	\$ 100.000	1,30 %	03.11.2018	99.593	0,01 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	\$ 100.000	1,65 %	08.02.2019	99.590	0,01 %
Healthcare Trust of America Holdings LP	\$ 100.000	2,95 %	01.07.2022	99.572	0,01 %
Eli Lilly & Co.	\$ 100.000	2,35 %	15.05.2022	99.568	0,01 %
BA Credit Card Trust	\$ 100.000	1,95 %	15.08.2022	99.562	0,01 %
Molson Coors Brewing Co.	\$ 100.000	1,90 %	15.03.2019	99.560	0,01 %
Manufacturers & Traders Trust Co.	\$ 100.000	2,10 %	06.02.2020	99.555	0,01 %
American Express Credit Account Master Trust	\$ 100.000	1,93 %	15.09.2022	99.531	0,01 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 100.000	2,20 %	28.02.2021	99.531	0,01 %
Molson Coors Brewing Co.	\$ 100.000	2,25 %	15.03.2020	99.511	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 100.000	2,35 %	16.05.2022	99.485	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 100.000	2,55 %	29.11.2022	99.475	0,01 %
Toyota Auto Receivables 2017-D Owner Trust	\$ 100.000	1,93 %	18.01.2022	99.442	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.000	1,73 %	25.07.2019	99.436	0,01 %
Reliance Standard Life Global Funding II	\$ 100.000	2,38 %	04.05.2020	99.427	0,01 %
3M Co.	\$ 100.000	2,00 %	07.08.2020	99.425	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 100.000	1,95 %	23.07.2019	99.417	0,01 %
Costco Wholesale Corp.	\$ 100.000	2,15 %	18.05.2021	99.403	0,01 %
Cardinal Health, Inc.	\$ 100.000	1,95 %	14.06.2019	99.398	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 100.000	1,63 %	21.02.2019	99.389	0,01 %
Discover Card Execution Note Trust	\$ 100.000	1,90 %	17.10.2022	99.375	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 100.000	2,00 %	21.02.2020	99.298	0,01 %
Smithfield Foods, Inc.	\$ 100.000	2,70 %	31.01.2020	99.294	0,01 %
Amazon.com, Inc.	\$ 100.000	1,90 %	21.08.2020	99.289	0,01 %
Pfizer, Inc.	\$ 100.000	1,45 %	03.06.2019	99.286	0,01 %
Chase Issuance Trust	\$ 100.000	1,84 %	15.04.2022	99.284	0,01 %
AbbVie, Inc.	\$ 100.000	2,30 %	14.05.2021	99.278	0,01 %
Starbucks Corp.	\$ 100.000	2,10 %	04.02.2021	99.275	0,01 %
Sysco Corp.	\$ 100.000	2,60 %	12.06.2022	99.274	0,01 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 100.000	2,29 %	15.07.2025	99.270	0,01 %
Estee Lauder Cos, Inc.	\$ 100.000	1,80 %	07.02.2020	99.268	0,01 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 100.000	2,25 %	20.05.2020	99.267	0,01 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	\$ 100.000	2,19 %	20.11.2023	99.243	0,01 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	\$ 100.000	3,15 %	01.04.2022	99.193	0,01 %
Analog Devices, Inc.	\$ 100.000	2,50 %	05.12.2021	99.168	0,01 %
eBay, Inc.	\$ 100.000	2,15 %	05.06.2020	99.161	0,01 %
Coca-Cola Co.	\$ 100.000	1,38 %	30.05.2019	99.159	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 100.000	1,38 %	25.02.2019	99.158	0,01 %
Kimberly-Clark Corp.	\$ 100.000	1,40 %	15.02.2019	99.151	0,01 %
VMware, Inc.	\$ 100.000	2,30 %	21.08.2020	99.142	0,01 %
Edison International	\$ 100.000	2,13 %	15.04.2020	99.086	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 100.000	2,13 %	15.03.2021	99.051	0,01 %
Barclays Dryrock Issuance Trust 2016	\$ 100.000	1,52 %	16.05.2022	99.045	0,01 %
Walt Disney Co.	\$ 100.000	1,80 %	05.06.2020	99.040	0,01 %
Costco Wholesale Corp.	\$ 100.000	2,30 %	18.05.2022	99.033	0,01 %
Chase Issuance Trust	\$ 100.000	1,37 %	15.06.2021	99.031	0,01 %
United Technologies Corp.	\$ 100.000	1,90 %	04.05.2020	98.984	0,01 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 100.000	1,34 %	15.04.2022	98.946	0,01 %
Athene Global Funding	\$ 100.000	3,00 %	01.07.2022	98.943	0,01 %
PACCAR Financial Corp.	\$ 100.000	1,30 %	10.05.2019	98.921	0,01 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2016	\$ 100.000	1,58 %	15.09.2022	98.911	0,01 %
Pfizer, Inc.	\$ 100.000	1,95 %	03.06.2021	98.905	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 100.000	2,50 %	02.11.2022	98.854	0,01 %
Protective Life Global Funding	\$ 100.000	1,56 %	13.09.2019	98.845	0,01 %
Fortive Corp.	\$ 100.000	2,35 %	15.06.2021	98.839	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sempra Energy	\$ 100.000	1,63 %	07.10.2019	98.784	0,01 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 100.000	1,33 %	15.06.2022	98.761	0,01 %
International Business Machines Corp.	\$ 100.000	1,63 %	15.05.2020	98.705	0,01 %
Ecolab, Inc.	\$ 100.000	2,38 %	10.08.2022	98.666	0,01 %
BB&T Corp.	\$ 100.000	2,05 %	10.05.2021	98.585	0,01 %
Johnson & Johnson	\$ 100.000	1,65 %	01.03.2021	98.465	0,01 %
New York Life Global Funding	\$ 100.000	2,30 %	10.06.2022	98.442	0,01 %
DTE Energy Co.	\$ 100.000	1,50 %	01.10.2019	98.432	0,01 %
Boeing Co.	\$ 100.000	1,65 %	30.10.2020	98.395	0,01 %
Air Lease Corp.	\$ 100.000	2,75 %	15.01.2023	98.379	0,01 %
Wells Fargo & Co.	\$ 100.000	2,10 %	26.07.2021	98.234	0,01 %
Intel Corp.	\$ 100.000	1,70 %	19.05.2021	97.949	0,01 %
Federal Home Loan Banks	\$ 100.000	1,38 %	18.02.2021	97.908	0,01 %
Estee Lauder Cos, Inc.	\$ 100.000	1,70 %	10.05.2021	97.774	0,01 %
Commercial Mortgage Pass Through Certificates	\$ 97.000	3,15 %	10.02.2047	97.681	0,01 %
Smithfield Foods, Inc.	\$ 100.000	2,65 %	03.10.2021	97.603	0,01 %
Coca-Cola Co.	\$ 100.000	1,55 %	01.09.2021	97.570	0,01 %
Amgen, Inc.	\$ 100.000	1,85 %	19.08.2021	97.538	0,01 %
Protective Life Global Funding	\$ 100.000	2,00 %	14.09.2021	96.674	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 100.000	1,13 %	12.08.2021	96.494	0,01 %
Nissan Auto Receivables 2017-B Owner Trust	\$ 94.000	1,75 %	15.10.2021	93.275	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 90.000	2,75 %	23.06.2020	90.774	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 90.000	2,65 %	13.04.2020	89.961	0,01 %
Adobe Systems, Inc.	\$ 80.000	4,75 %	01.02.2020	84.205	0,01 %
Puget Energy, Inc.	\$ 75.000	6,50 %	15.12.2020	82.694	0,01 %
XLIT Ltd.	\$ 75.000	5,75 %	01.10.2021	82.153	0,01 %
Thomson Reuters Corp.	CAD 100.000	3,31 %	12.11.2021	81.699	0,01 %
Morgan Stanley	CAD 100.000	3,13 %	05.08.2021	81.054	0,01 %
Alleghany Corp.	\$ 75.000	5,63 %	15.09.2020	80.553	0,01 %
Valero Energy Corp.	\$ 75.000	6,13 %	01.02.2020	80.471	0,01 %
Ameriprise Financial, Inc.	\$ 75.000	7,30 %	28.06.2019	80.341	0,01 %
Union Pacific Corp.	\$ 75.000	4,16 %	15.07.2022	80.331	0,01 %
John Deere Canada Funding, Inc.	CAD 100.000	2,35 %	24.06.2019	80.117	0,01 %
Nissan Auto Lease Trust 2017	\$ 80.000	2,05 %	15.09.2020	79.774	0,01 %
Ameriprise Financial, Inc.	\$ 75.000	5,30 %	15.03.2020	79.517	0,01 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 75.000	5,00 %	15.04.2020	79.513	0,01 %
Southern Co.^	\$ 75.000	5,50 %	15.03.2057	79.313	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	CAD 100.000	2,43 %	26.04.2023	78.298	0,01 %
Biogen, Inc.	\$ 75.000	3,63 %	15.09.2022	77.555	0,01 %
AutoZone, Inc.	\$ 75.000	3,70 %	15.04.2022	77.140	0,01 %
Mosaic Co.	\$ 75.000	3,75 %	15.11.2021	76.721	0,01 %
General Mills, Inc.	\$ 75.000	3,15 %	15.12.2021	76.412	0,01 %
Mead Johnson Nutrition Co.	\$ 75.000	3,00 %	15.11.2020	76.115	0,01 %
Delta Air Lines, Inc.	\$ 75.000	3,63 %	15.03.2022	76.109	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 75.000	3,45 %	10.04.2022	75.973	0,01 %
American Tower Corp.	\$ 75.000	3,40 %	15.02.2019	75.867	0,01 %
US Bancorp	\$ 75.000	2,95 %	15.07.2022	75.820	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 75.000	2,85 %	01.06.2022	75.792	0,01 %
Amazon.com, Inc.	\$ 75.000	2,60 %	05.12.2019	75.769	0,01 %
Kennametal, Inc.	\$ 75.000	3,88 %	15.02.2022	75.595	0,01 %
Humana, Inc.	\$ 75.000	3,15 %	01.12.2022	75.527	0,01 %
CA, Inc.	\$ 75.000	3,60 %	15.08.2022	75.491	0,01 %
Delta Air Lines, Inc.	\$ 75.000	2,88 %	13.03.2020	75.373	0,01 %
Ralph Lauren Corp.	\$ 75.000	2,63 %	18.08.2020	75.314	0,01 %
Capital One Financial Corp.	\$ 75.000	3,05 %	09.03.2022	75.280	0,01 %
Citigroup, Inc.	\$ 75.000	2,55 %	08.04.2019	75.246	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 75.000	2,30 %	15.12.2019	75.209	0,01 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	\$ 75.000	2,35 %	10.09.2019	75.180	0,01 %
Jackson National Life Global Funding	\$ 75.000	2,60 %	09.12.2020	75.107	0,01 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2017	\$ 75.000	2,62 %	15.10.2025	75.097	0,01 %
PNC Bank NA	\$ 75.000	2,63 %	17.02.2022	75.036	0,01 %
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	\$ 75.000	2,30 %	01.04.2019	74.932	0,01 %
SunTrust Bank	\$ 75.000	2,25 %	31.01.2020	74.798	0,01 %
Iraq Government AID Bond	\$ 75.000	2,15 %	18.01.2022	74.753	0,01 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 75.000	2,43 %	15.01.2025	74.720	0,01 %
World Financial Network Credit Card Master Trust	\$ 75.000	2,31 %	15.08.2024	74.673	0,01 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Apple, Inc.	\$ 75.000	1,90 %	07.02.2020	74.650	0,01 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 75.000	2,00 %	17.01.2023	74.625	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 75.000	2,40 %	07.06.2021	74.603	0,01 %
Intel Corp.	\$ 75.000	1,85 %	11.05.2020	74.572	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 75.000	2,00 %	13.11.2020	74.526	0,01 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 75.000	2,10 %	04.10.2019	74.458	0,01 %
Capital One Financial Corp.	\$ 75.000	2,40 %	30.10.2020	74.393	0,01 %
Home Depot, Inc.	\$ 75.000	1,80 %	05.06.2020	74.385	0,01 %
JPMorgan Chase Bank NA	\$ 75.000	1,65 %	23.09.2019	74.377	0,01 %
NetApp, Inc.	\$ 75.000	2,00 %	27.09.2019	74.375	0,01 %
Apple, Inc.	\$ 75.000	1,50 %	12.09.2019	74.375	0,01 %
Federal Farm Credit Banks	\$ 75.000	1,68 %	13.10.2020	74.275	0,01 %
Capital One Na	\$ 75.000	1,85 %	13.09.2019	74.264	0,01 %
Colgate-Palmolive Co.	\$ 75.000	2,25 %	15.11.2022	74.264	0,01 %
NVIDIA Corp.	\$ 75.000	2,20 %	16.09.2021	74.248	0,01 %
FirstEnergy Corp.	\$ 75.000	2,85 %	15.07.2022	74.104	0,01 %
EQT Corp.	\$ 75.000	3,00 %	01.10.2022	74.002	0,01 %
First Republic Bank	\$ 75.000	2,50 %	06.06.2022	74.001	0,01 %
Public Service Enterprise Group, Inc.	\$ 75.000	1,60 %	15.11.2019	73.826	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 75.000	1,85 %	04.09.2020	73.788	0,01 %
Honeywell International, Inc.	\$ 75.000	1,85 %	01.11.2021	73.567	0,01 %
Molson Coors Brewing Co.	\$ 75.000	2,10 %	15.07.2021	73.432	0,01 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 75.000	2,65 %	15.01.2023	72.326	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 70.000	2,50 %	15.04.2021	70.166	0,00 %
Rockwell Collins, Inc.	\$ 70.000	2,80 %	15.03.2022	70.068	0,00 %
International Lease Finance Corp.	\$ 65.000	6,25 %	15.05.2019	68.006	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 69.000	1,50 %	30.11.2020	67.934	0,00 %
Pitney Bowes, Inc.	\$ 70.000	3,63 %	01.10.2021	65.127	0,00 %
Ally Auto Receivables Trust 2017	\$ 61.000	1,96 %	15.07.2022	60.293	0,00 %
Principal Life Global Funding II	\$ 60.000	2,63 %	19.11.2020	60.175	0,00 %
Reliance Standard Life Global Funding II	\$ 60.000	2,50 %	15.01.2020	59.942	0,00 %
International Lease Finance Corp.	\$ 52.000	8,25 %	15.12.2020	59.670	0,00 %
Fidelity National Information Services, Inc.	\$ 56.000	3,63 %	15.10.2020	57.486	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 57.036	3,15 %	25.02.2018	57.026	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 56.000	2,25 %	23.01.2020	55.956	0,00 %
Wyndham Worldwide Corp.	\$ 55.000	4,25 %	01.03.2022	55.953	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 50.000	5,75 %	24.01.2022	55.292	0,00 %
US Treasury Note	\$ 55.000	1,38 %	31.07.2019	54.588	0,00 %
Energy Transfer LP	\$ 50.000	9,00 %	15.04.2019	53.948	0,00 %
US Treasury Bond	\$ 50.000	8,88 %	15.02.2019	53.938	0,00 %
Moody's Corp.	\$ 50.000	5,50 %	01.09.2020	53.838	0,00 %
Expedia, Inc.	\$ 50.000	5,95 %	15.08.2020	53.789	0,00 %
Sherwin-Williams Co.	\$ 50.000	7,25 %	15.06.2019	53.381	0,00 %
Time Warner, Inc.	\$ 50.000	4,75 %	29.03.2021	53.165	0,00 %
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 50.000	6,95 %	15.06.2019	53.080	0,00 %
American Tower Corp.	\$ 50.000	5,05 %	01.09.2020	53.024	0,00 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 50.000	4,50 %	15.02.2021	52.910	0,00 %
Omnicom Group, Inc.	\$ 50.000	6,25 %	15.07.2019	52.886	0,00 %
McKesson Corp.	\$ 50.000	7,50 %	15.02.2019	52.818	0,00 %
Dover Corp.	\$ 50.000	4,30 %	01.03.2021	52.695	0,00 %
DR Horton, Inc.	\$ 50.000	4,38 %	15.09.2022	52.644	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2017	\$ 53.000	1,69 %	15.11.2021	52.580	0,00 %
Federal Home Loan Banks	\$ 50.000	5,13 %	15.08.2019	52.548	0,00 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 50.000	4,38 %	25.09.2021	52.366	0,00 %
Entergy Corp.	\$ 50.000	4,00 %	15.07.2022	52.224	0,00 %
KLA-Tencor Corp.	\$ 50.000	4,13 %	01.11.2021	52.175	0,00 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 50.000	4,20 %	01.03.2021	51.930	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015	\$ 50.000	3,64 %	15.10.2048	51.840	0,00 %
Chevron Corp.	\$ 50.000	4,95 %	03.03.2019	51.636	0,00 %
Athene Global Funding	\$ 50.000	4,00 %	25.01.2022	51.598	0,00 %
State of Illinois	\$ 50.000	5,88 %	01.03.2019	51.558	0,00 %
Time Warner Cable LLC	\$ 50.000	4,13 %	15.02.2021	51.524	0,00 %
Nissan Auto Receivables 2017-B Owner Trust	\$ 52.000	1,95 %	16.10.2023	51.399	0,00 %
Prospect Capital Corp.	\$ 50.000	5,00 %	15.07.2019	51.341	0,00 %
Block Financial LLC	\$ 50.000	4,13 %	01.10.2020	51.338	0,00 %
Western Union Co.	\$ 50.000	3,60 %	15.03.2022	51.264	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Zoetis, Inc.	\$ 50.000	3,45 %	13.11.2020	51.137	0,00 %
CA, Inc.	\$ 50.000	3,60 %	01.08.2020	51.076	0,00 %
Air Lease Corp.	\$ 50.000	3,38 %	01.06.2021	51.035	0,00 %
Digital Realty Trust LP	\$ 50.000	3,40 %	01.10.2020	51.013	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 50.000	2,99 %	25.09.2021	50.994	0,00 %
Viacom, Inc.	\$ 50.000	3,88 %	15.12.2021	50.917	0,00 %
PacifiCorp	\$ 50.000	2,95 %	01.02.2022	50.780	0,00 %
Marriott International, Inc.	\$ 50.000	3,25 %	15.09.2022	50.730	0,00 %
DR Horton, Inc.	\$ 50.000	3,75 %	01.03.2019	50.696	0,00 %
Avnet, Inc.	\$ 50.000	3,75 %	01.12.2021	50.681	0,00 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	\$ 50.000	3,20 %	15.07.2020	50.646	0,00 %
Seagate HDD Cayman	\$ 50.000	3,75 %	15.11.2018	50.625	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 50.000	3,34 %	28.03.2022	50.584	0,00 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	\$ 50.000	3,05 %	09.01.2020	50.578	0,00 %
US Treasury Note	\$ 50.000	2,75 %	15.02.2019	50.492	0,00 %
Intercontinental Exchange, Inc.	\$ 50.000	2,75 %	01.12.2020	50.478	0,00 %
Seagate HDD Cayman	\$ 50.000	4,25 %	01.03.2022	50.375	0,00 %
ONEOK Partners LP	\$ 50.000	3,38 %	01.10.2022	50.370	0,00 %
Marriott International, Inc.	\$ 50.000	2,88 %	01.03.2021	50.346	0,00 %
Fiserv, Inc.	\$ 50.000	2,70 %	01.06.2020	50.327	0,00 %
HSBC USA, Inc.	\$ 50.000	2,75 %	07.08.2020	50.325	0,00 %
Cintas Corp.No 2	\$ 50.000	2,90 %	01.04.2022	50.308	0,00 %
Government Properties Income Trust	\$ 50.000	4,00 %	15.07.2022	50.278	0,00 %
John Deere Capital Corp.	\$ 50.000	2,65 %	06.01.2022	50.275	0,00 %
Lam Research Corp.	\$ 50.000	2,80 %	15.06.2021	50.271	0,00 %
Sysco Corp.	\$ 50.000	2,60 %	01.10.2020	50.212	0,00 %
DXC Technology Co.	\$ 50.000	2,88 %	27.03.2020	50.199	0,00 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	\$ 50.000	3,65 %	01.06.2022	50.183	0,00 %
Private Export Funding Corp.	\$ 50.000	2,30 %	15.09.2020	50.183	0,00 %
Ameren Illinois Co.	\$ 50.000	2,70 %	01.09.2022	50.141	0,00 %
HSBC USA, Inc.	\$ 50.000	2,25 %	23.06.2019	50.120	0,00 %
Cisco Systems, Inc.1	\$ 50.000	2,13 %	01.03.2019	50.103	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 50.000	2,55 %	23.10.2019	50.093	0,00 %
Danaher Corp.	\$ 50.000	2,40 %	15.09.2020	50.092	0,00 %
Citigroup, Inc.	\$ 50.000	2,70 %	30.03.2021	50.088	0,00 %
Automatic Data Processing, Inc.	\$ 50.000	2,25 %	15.09.2020	50.079	0,00 %
JM Smucker Co.	\$ 50.000	2,50 %	15.03.2020	50.075	0,00 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 50.000	2,70 %	24.05.2019	50.072	0,00 %
Moody's Corp.	\$ 50.000	2,75 %	15.12.2021	50.028	0,00 %
Athene Global Funding	\$ 50.000	2,75 %	20.04.2020	50.022	0,00 %
Aflac, Inc.	\$ 50.000	2,40 %	16.03.2020	50.022	0,00 %
CBS Corp.	\$ 50.000	2,30 %	15.08.2019	50.021	0,00 %
Molex Electronic Technologies LLC	\$ 50.000	2,88 %	15.04.2020	50.020	0,00 %
Home Depot, Inc.	\$ 50.000	2,00 %	15.06.2019	50.019	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 50.000	2,20 %	22.05.2019	50.018	0,00 %
Starbucks Corp.	\$ 50.000	2,20 %	22.11.2020	49.987	0,00 %
HSBC USA, Inc.	\$ 50.000	2,35 %	05.03.2020	49.979	0,00 %
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	\$ 50.000	2,80 %	15.01.2023	49.964	0,00 %
Dignity Health	\$ 50.000	2,64 %	01.11.2019	49.958	0,00 %
AIG Global Funding	\$ 50.000	2,70 %	15.12.2021	49.954	0,00 %
Branch Banking & Trust Co.	\$ 50.000	2,25 %	01.06.2020	49.944	0,00 %
GM Financial Automobile Leasing Trust 2016	\$ 50.000	1,62 %	20.09.2019	49.931	0,00 %
Walt Disney Co.	\$ 50.000	2,45 %	04.03.2022	49.931	0,00 %
Hashemite Kingdom of Jordan Government AID Bond	\$ 50.000	1,95 %	23.06.2019	49.925	0,00 %
Huntington National Bank	\$ 50.000	2,40 %	01.04.2020	49.913	0,00 %
El du Pont de Nemours & Co.	\$ 50.000	2,20 %	01.05.2020	49.910	0,00 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 50.000	2,15 %	24.02.2020	49.876	0,00 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates	\$ 50.000	1,88 %	25.05.2019	49.859	0,00 %
Delta Air Lines, Inc.	\$ 50.000	2,60 %	04.12.2020	49.856	0,00 %
Georgia Power Co.	\$ 50.000	2,40 %	01.04.2021	49.852	0,00 %
Honda Auto Receivables 2017-4 Owner Trust	\$ 50.000	2,05 %	22.11.2021	49.847	0,00 %
Sherwin-Williams Co.	\$ 50.000	2,25 %	15.05.2020	49.840	0,00 %
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A	\$ 50.000	1,76 %	15.02.2021	49.836	0,00 %
ITC Holdings Corp.	\$ 50.000	2,70 %	15.11.2022	49.830	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 50.000	1,55 %	08.02.2019	49.825	0,00 %
Sherwin-Williams Co.	\$ 50.000	2,75 %	01.06.2022	49.825	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal National Mortgage Association	\$ 50.000	1,75 %	26.11.2019	49.820	0,00 %
SL Green Operating Partnership LP	\$ 50.000	3,25 %	15.10.2022	49.790	0,00 %
American Electric Power Co., Inc.	\$ 50.000	2,15 %	13.11.2020	49.767	0,00 %
Humana, Inc.	\$ 50.000	2,90 %	15.12.2022	49.765	0,00 %
AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2016	\$ 50.000	1,46 %	10.05.2021	49.762	0,00 %
Southern Co.	\$ 50.000	2,35 %	01.07.2021	49.759	0,00 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 50.000	2,10 %	20.05.2020	49.759	0,00 %
Amgen, Inc.	\$ 50.000	2,13 %	01.05.2020	49.725	0,00 %
Amphenol Corp.	\$ 50.000	2,20 %	01.04.2020	49.718	0,00 %
Southern Co.	\$ 50.000	1,85 %	01.07.2019	49.713	0,00 %
Intel Corp.	\$ 50.000	2,35 %	11.05.2022	49.702	0,00 %
Constellation Brands, Inc.	\$ 50.000	2,00 %	07.11.2019	49.692	0,00 %
Chevron Corp.	\$ 50.000	1,99 %	03.03.2020	49.676	0,00 %
NiSource Finance Corp.	\$ 50.000	2,65 %	17.11.2022	49.672	0,00 %
Alabama Power Co.	\$ 50.000	2,45 %	30.03.2022	49.670	0,00 %
Kroger Co.	\$ 50.000	2,80 %	01.08.2022	49.670	0,00 %
IBM Credit LLC	\$ 50.000	1,63 %	06.09.2019	49.665	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2017	\$ 50.000	1,67 %	15.06.2021	49.661	0,00 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 50.000	2,40 %	06.06.2022	49.657	0,00 %
Air Lease Corp.	\$ 50.000	2,13 %	15.01.2020	49.651	0,00 %
Exelon Corp.	\$ 50.000	2,45 %	15.04.2021	49.648	0,00 %
New York Life Global Funding	\$ 50.000	2,00 %	09.04.2020	49.638	0,00 %
Synovus Financial Corp.	\$ 50.000	3,13 %	01.11.2022	49.628	0,00 %
Southern Power Co.	\$ 50.000	1,95 %	15.12.2019	49.599	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2016	\$ 50.000	1,39 %	17.05.2021	49.587	0,00 %
Boeing Co.	\$ 50.000	2,13 %	01.03.2022	49.586	0,00 %
AutoZone, Inc.	\$ 50.000	1,63 %	21.04.2019	49.580	0,00 %
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	\$ 50.000	2,15 %	26.02.2020	49.575	0,00 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 50.000	1,35 %	18.05.2019	49.546	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 50.000	1,95 %	15.10.2020	49.543	0,00 %
Constellation Brands, Inc.	\$ 50.000	2,25 %	06.11.2020	49.538	0,00 %
Jackson National Life Global Funding	\$ 50.000	2,25 %	29.04.2021	49.533	0,00 %
Intercontinental Exchange, Inc.	\$ 50.000	2,35 %	15.09.2022	49.532	0,00 %
Union Pacific Corp.	\$ 50.000	1,80 %	01.02.2020	49.526	0,00 %
Southern Power Co.	\$ 50.000	2,50 %	15.12.2021	49.526	0,00 %
Nissan Master Owner Trust Receivables	\$ 50.000	1,54 %	15.06.2021	49.522	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 50.000	2,38 %	15.10.2022	49.517	0,00 %
Public Service Enterprise Group, Inc.	\$ 50.000	2,65 %	15.11.2022	49.492	0,00 %
BB&T Corp.	\$ 50.000	2,15 %	01.02.2021	49.486	0,00 %
Nissan Auto Receivables 2016-C Owner Trust	\$ 50.000	1,18 %	15.01.2021	49.480	0,00 %
Simon Property Group LP	\$ 50.000	2,35 %	30.01.2022	49.453	0,00 %
Activision Blizzard, Inc.	\$ 50.000	2,60 %	15.06.2022	49.450	0,00 %
Home Depot, Inc.	\$ 50.000	2,00 %	01.04.2021	49.448	0,00 %
Costco Wholesale Corp.	\$ 50.000	1,75 %	15.02.2020	49.446	0,00 %
Mylan NV	\$ 50.000	2,50 %	07.06.2019	49.440	0,00 %
Fifth Third Bank	\$ 50.000	1,63 %	27.09.2019	49.434	0,00 %
Constellation Brands, Inc.	\$ 50.000	2,65 %	07.11.2022	49.405	0,00 %
Hyundai Capital America	\$ 50.000	2,00 %	01.07.2019	49.394	0,00 %
PepsiCo, Inc.	\$ 50.000	1,35 %	04.10.2019	49.380	0,00 %
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	\$ 50.000	2,55 %	09.06.2022	49.313	0,00 %
Kroger Co.	\$ 50.000	1,50 %	30.09.2019	49.276	0,00 %
Molson Coors Brewing Co.	\$ 50.000	1,45 %	15.07.2019	49.265	0,00 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 50.000	2,38 %	17.08.2022	49.245	0,00 %
Visa, Inc.	\$ 50.000	2,15 %	15.09.2022	49.217	0,00 %
Mastercard, Inc.	\$ 50.000	2,00 %	21.11.2021	49.217	0,00 %
Consolidated Edison, Inc.	\$ 50.000	2,00 %	15.05.2021	49.205	0,00 %
Public Service Electric & Gas Co.	\$ 50.000	1,90 %	15.03.2021	49.181	0,00 %
Guardian Life Global Funding	\$ 50.000	2,00 %	26.04.2021	49.155	0,00 %
CenterPoint Energy, Inc.	\$ 50.000	2,50 %	01.09.2022	49.144	0,00 %
Hyundai Capital America	\$ 50.000	1,75 %	27.09.2019	49.064	0,00 %
IBM Credit LLC	\$ 50.000	2,20 %	08.09.2022	49.026	0,00 %
Jackson National Life Global Funding	\$ 50.000	2,10 %	25.10.2021	49.000	0,00 %
Hyundai Capital America	\$ 50.000	2,45 %	15.06.2021	48.924	0,00 %
Bristol-Myers Squibb Co.	\$ 50.000	2,00 %	01.08.2022	48.893	0,00 %
Guardian Life Global Funding	\$ 50.000	1,95 %	27.10.2021	48.721	0,00 %
PepsiCo, Inc.	\$ 50.000	1,70 %	06.10.2021	48.705	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
AIG Global Funding	\$ 50.000	1,90 %	06.10.2021	48.588	0,00 %
Apple, Inc.	\$ 50.000	1,55 %	04.08.2021	48.523	0,00 %
Ukraine Government AID Bonds	\$ 50.000	1,47 %	29.09.2021	48.489	0,00 %
Baxter International, Inc.	\$ 50.000	1,70 %	15.08.2021	48.482	0,00 %
New York Life Global Funding	\$ 50.000	1,70 %	14.09.2021	48.466	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 47.000	0,88 %	19.07.2019	46.267	0,00 %
Pitney Bowes, Inc.	\$ 50.000	4,13 %	15.05.2022	46.090	0,00 %
Bank of America Corp.^	\$ 45.000	3,12 %	20.01.2023	45.602	0,00 %
Federal National Mortgage Association^	\$ 45.089	2,17 %	25.09.2019	45.098	0,00 %
LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2008^	\$ 43.322	6,32 %	15.04.2041	43.390	0,00 %
Coventry Health Care, Inc.	\$ 40.000	5,45 %	15.06.2021	43.305	0,00 %
International Lease Finance Corp.	\$ 39.000	5,88 %	01.04.2019	40.623	0,00 %
Target Corp.	\$ 40.000	2,30 %	26.06.2019	40.114	0,00 %
Santander Drive Auto Receivables Trust 2017	\$ 40.000	1,87 %	15.06.2021	39.839	0,00 %
LyondellBasell Industries NV	\$ 37.000	5,00 %	15.04.2019	37.983	0,00 %
Delta Air Lines 2010-2 Klasse A Pass Through Trust	\$ 36.864	4,95 %	23.05.2019	37.747	0,00 %
Honda Auto Receivables 2017-2 Owner Trust	\$ 38.000	1,87 %	15.09.2023	37.585	0,00 %
US Treasury Note	\$ 37.000	1,50 %	31.01.2022	36.081	0,00 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	\$ 35.000	1,70 %	15.03.2019	34.875	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2015	\$ 34.062	1,63 %	15.05.2020	34.001	0,00 %
Cantor Fitzgerald LP	\$ 30.000	7,88 %	15.10.2019	32.452	0,00 %
Chubb INA Holdings, Inc.	\$ 30.000	5,90 %	15.06.2019	31.618	0,00 %
Scripps Networks Interactive, Inc.	\$ 30.000	3,50 %	15.06.2022	30.364	0,00 %
General Electric Co.	\$ 30.000	2,20 %	09.01.2020	29.895	0,00 %
AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2017	\$ 30.000	1,90 %	18.03.2022	29.781	0,00 %
GM Financial Automobile Leasing Trust 2015	\$ 28.830	1,69 %	20.03.2019	28.819	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2015	\$ 27.663	1,41 %	15.02.2020	27.611	0,00 %
Delta Air Lines 2007-1 Klasse A Pass Through Trust	\$ 24.214	6,82 %	10.08.2022	27.409	0,00 %
CMS Energy Corp.	\$ 25.000	5,05 %	15.03.2022	27.104	0,00 %
Reynolds American, Inc.	\$ 25.000	8,13 %	23.06.2019	27.038	0,00 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 25.000	7,50 %	15.02.2019	26.429	0,00 %
Avnet, Inc.	\$ 25.000	4,88 %	01.12.2022	26.313	0,00 %
Highmark, Inc.	\$ 25.000	4,75 %	15.05.2021	26.166	0,00 %
Union Electric Co.	\$ 25.000	6,70 %	01.02.2019	26.147	0,00 %
HP, Inc.	\$ 25.000	4,05 %	15.09.2022	26.047	0,00 %
Aetna, Inc.	\$ 25.000	4,13 %	01.06.2021	25.983	0,00 %
General Mills, Inc.	\$ 25.000	5,65 %	15.02.2019	25.942	0,00 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 25.000	4,95 %	15.02.2019	25.817	0,00 %
Cintas Corp.No 2	\$ 25.000	3,25 %	01.06.2022	25.752	0,00 %
Digital Realty Trust LP	\$ 25.000	3,63 %	01.10.2022	25.702	0,00 %
PPL Capital Funding, Inc.	\$ 25.000	3,50 %	01.12.2022	25.665	0,00 %
First Horizon National Corp.	\$ 25.000	3,50 %	15.12.2020	25.487	0,00 %
Duke Energy Corp.	\$ 25.000	3,05 %	15.08.2022	25.263	0,00 %
Washington Prime Group LP	\$ 25.000	3,85 %	01.04.2020	25.192	0,00 %
BB&T Corp.	\$ 25.000	2,75 %	01.04.2022	25.164	0,00 %
Starbucks Corp.	\$ 25.000	2,70 %	15.06.2022	25.162	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	\$ 25.000	2,57 %	25.09.2020	25.150	0,00 %
Oracle Corp.	\$ 25.000	2,38 %	15.01.2019	25.107	0,00 %
Altera Corp.	\$ 25.000	2,50 %	15.11.2018	25.104	0,00 %
Laboratory Corp. of America Holdings	\$ 25.000	2,63 %	01.02.2020	25.073	0,00 %
Harris Corp.	\$ 25.000	2,70 %	27.04.2020	25.073	0,00 %
Scripps Networks Interactive, Inc.	\$ 25.000	2,75 %	15.11.2019	25.043	0,00 %
Lam Research Corp.	\$ 25.000	2,75 %	15.03.2020	25.037	0,00 %
Church & Dwight Co., Inc.	\$ 25.000	2,88 %	01.10.2022	25.033	0,00 %
Tech Data Corp.	\$ 25.000	3,70 %	15.02.2022	25.023	0,00 %
Morgan Stanley	\$ 25.000	2,38 %	23.07.2019	25.008	0,00 %
Capital One Na	\$ 25.000	2,40 %	05.09.2019	25.006	0,00 %
Simon Property Group LP	\$ 25.000	2,20 %	01.02.2019	25.004	0,00 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	\$ 25.000	2,40 %	01.02.2019	25.004	0,00 %
Royal Caribbean Cruises Ltd.	\$ 25.000	2,65 %	28.11.2020	25.000	0,00 %
Ally Master Owner Trust	\$ 25.000	1,63 %	15.05.2020	24.984	0,00 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	\$ 25.000	1,60 %	17.05.2021	24.980	0,00 %
Mastercard, Inc.	\$ 25.000	2,00 %	01.04.2019	24.974	0,00 %
Toyota Auto Receivables 2015-C Owner Trust	\$ 25.000	1,69 %	15.12.2020	24.949	0,00 %
Church & Dwight Co., Inc.	\$ 25.000	2,45 %	15.12.2019	24.946	0,00 %
Eversource Energy	\$ 25.000	2,75 %	15.03.2022	24.946	0,00 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Stryker Corp.	\$ 25.000	2,00 %	08.03.2019	24.944	0,00 %
BMW Vehicle Lease Trust 2017	\$ 25.000	2,07 %	20.10.2020	24.927	0,00 %
McDonald's Corp.	\$ 25.000	1,88 %	29.05.2019	24.914	0,00 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 25.000	2,45 %	01.10.2022	24.905	0,00 %
Protective Life Global Funding	\$ 25.000	1,72 %	15.04.2019	24.902	0,00 %
Nissan Auto Lease Trust 2017	\$ 25.000	2,17 %	15.12.2021	24.894	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2017	\$ 25.000	2,11 %	17.10.2022	24.873	0,00 %
Cboe Global Markets Inc.	\$ 25.000	1,95 %	28.06.2019	24.843	0,00 %
Georgia Power Co.	\$ 25.000	2,00 %	30.03.2020	24.837	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2017	\$ 25.000	2,33 %	15.05.2023	24.828	0,00 %
Toyota Auto Receivables 2016	\$ 25.000	1,14 %	17.08.2020	24.821	0,00 %
EQT Corp.	\$ 25.000	2,50 %	01.10.2020	24.803	0,00 %
American Express Co.	\$ 25.000	2,65 %	02.12.2022	24.767	0,00 %
Consolidated Edison, Inc.	\$ 25.000	2,00 %	15.03.2020	24.766	0,00 %
Tapestry Inc.	\$ 25.000	3,00 %	15.07.2022	24.765	0,00 %
eBay, Inc.	\$ 25.000	2,60 %	15.07.2022	24.762	0,00 %
Hyundai Auto Receivables Trust 2016	\$ 25.000	1,29 %	15.04.2021	24.720	0,00 %
Church & Dwight Co., Inc.	\$ 25.000	2,45 %	01.08.2022	24.695	0,00 %
PACCAR Financial Corp.	\$ 25.000	2,30 %	10.08.2022	24.618	0,00 %
IBM Credit LLC	\$ 25.000	1,80 %	20.01.2021	24.602	0,00 %
Public Storage	\$ 25.000	2,37 %	15.09.2022	24.600	0,00 %
AEP Texas, Inc.	\$ 25.000	2,40 %	01.10.2022	24.542	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 24.387	2,32 %	25.10.2018	24.431	0,00 %
Toyota Auto Receivables 2016-B Owner Trust	\$ 24.371	1,30 %	15.04.2020	24.280	0,00 %
Edison International	\$ 25.000	2,40 %	15.09.2022	24.266	0,00 %
International Business Machines Corp.	\$ 25.000	1,88 %	01.08.2022	24.260	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	\$ 24.127	2,41 %	25.08.2018	24.168	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2015	\$ 23.126	1,28 %	15.09.2019	23.101	0,00 %
Bunge Ltd. Finance Corp.	\$ 20.000	3,50 %	24.11.2020	20.381	0,00 %
Quest Diagnostics, Inc.	\$ 20.000	2,50 %	30.03.2020	19.957	0,00 %
Mosaic Co.	\$ 20.000	3,25 %	15.11.2022	19.800	0,00 %
US Treasury Note	\$ 20.000	1,50 %	15.07.2020	19.788	0,00 %
Ally Auto Receivables Trust 2015	\$ 19.492	1,49 %	15.11.2019	19.477	0,00 %
Newell Brands Inc.	\$ 19.000	2,60 %	29.03.2019	19.029	0,00 %
Nissan Auto Receivables 2015-B Owner Trust	\$ 16.050	1,34 %	16.03.2020	16.012	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2015	\$ 16.027	1,16 %	15.11.2019	15.993	0,00 %
International Lease Finance Corp.	\$ 15.000	4,63 %	15.04.2021	15.675	0,00 %
CMS Energy Corp.	\$ 14.000	8,75 %	15.06.2019	15.206	0,00 %
Honda Auto Receivables 2015-3 Owner Trust	\$ 15.191	1,27 %	18.04.2019	15.179	0,00 %
Nissan Auto Receivables 2014-B Owner Trust	\$ 14.549	1,11 %	15.05.2019	14.535	0,00 %
Masco Corp.	\$ 13.000	7,13 %	15.03.2020	14.191	0,00 %
Mercedes-Benz Auto Receivables Trust 2015	\$ 12.545	1,34 %	16.12.2019	12.519	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2015	\$ 11.333	1,37 %	16.03.2020	11.307	0,00 %
Stanley Black & Decker, Inc.^	\$ 10.000	5,75 %	15.12.2053	10.250	0,00 %
Toyota Auto Receivables 2015-C Owner Trust	\$ 9.809	1,34 %	17.06.2019	9.797	0,00 %
Capital Auto Receivables Asset Trust 2015	\$ 8.335	1,61 %	20.06.2019	8.334	0,00 %
Ally Auto Receivables Trust 2015	\$ 8.106	1,39 %	16.09.2019	8.099	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2017	\$ 7.000	1,87 %	15.09.2022	6.932	0,00 %
Ally Auto Receivables Trust 2014	\$ 5.053	1,28 %	17.06.2019	5.051	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2014	\$ 4.810	1,25 %	15.11.2019	4.805	0,00 %
Honda Auto Receivables 2015-2 Owner Trust	\$ 4.357	1,04 %	21.02.2019	4.348	0,00 %
BMW Vehicle Lease Trust 2015	\$ 3.261	1,40 %	20.09.2018	3.260	0,00 %
Federal National Mortgage Association	\$ 3.037	1,63 %	25.02.2018	3.033	0,00 %
Honda Auto Receivables 2015-1 Owner Trust	\$ 1.300	1,05 %	15.10.2018	1.300	0,00 %
Volkswagen Auto Loan Enhanced Trust 2014	\$ 880	0,95 %	22.04.2019	879	0,00 %
				500.581.231	36,29 %
Summe Anleihen				1.355.734.882	98,27 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				1.355.734.882	98,27 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominal-betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt-nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures (0,00 %) (2016: (0,00 %))				
Long Gilt Future März 2018	7	1.175.039	10.132	0,00 %
US 2-Year Note März 2018	11	2.358.953	(3.750)	(0,00 %)
Euro-Bobl Futures März 2018	20	3.166.317	(5.572)	(0,00 %)
AUS 3-Year Bond Futures März 2018	21	1.832.644	(7.862)	(0,00 %)
US 5-Year Note März 2018	55	6.419.322	(30.298)	(0,00 %)
			(37.350)	(0,00 %)

Währung	Kauf-betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs-datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt-nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte (0,26 %) (2016: 0,59 %)							
USD	133.079.294	JPY	(14.862.760.000)	UBS	05.01.2018	1.128.033	0,08 %
USD	4.806.639	MXN	(89.910.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	211.305	0,01 %
KRW	26.372.522.000	USD	(24.441.633)	BNP Paribas	02.01.2018	192.921	0,01 %
EUR	11.000.000	USD	(13.016.075)	BNP Paribas	03.01.2018	192.728	0,01 %
USD	45.280.974	GBP	(33.410.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	85.603	0,01 %
GBP	2.500.000	USD	(3.343.168)	BNP Paribas	03.01.2018	38.707	0,00 %
MYR	19.117.958	USD	(4.692.099)	JP Morgan Chase	03.01.2018	31.884	0,00 %
THB	103.729.674	USD	(3.168.286)	BNP Paribas	04.01.2018	14.687	0,00 %
JPY	15.212.760.000	USD	(135.044.474)	UBS	05.01.2018	14.079	0,00 %
USD	3.190.701	THB	(103.729.674)	BNP Paribas	04.01.2018	7.728	0,00 %
USD	895.335	JPY	(100.000.000)	BNP Paribas	05.01.2018	7.537	0,00 %
EUR	500.000	USD	(592.888)	BNP Paribas	03.01.2018	7.512	0,00 %
GBP	700.000	USD	(940.527)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	6.398	0,00 %
USD	4.569.819	MXN	(89.910.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	2.962	0,00 %
USD	1.640.537	RUB	(94.700.000)	JP Morgan Chase	01.02.2018	2.217	0,00 %
JPY	200.000.000	USD	(1.773.422)	BNP Paribas	05.01.2018	2.173	0,00 %
USD	1.645.643	RUB	(94.700.000)	JP Morgan Chase	09.01.2018	2.008	0,00 %
USD	948.842	GBP	(700.000)	BNP Paribas	03.01.2018	1.917	0,00 %
USD	1.776.215	JPY	(200.000.000)	JP Morgan Chase	05.01.2018	619	0,00 %
JPY	200.000.000	USD	(1.775.411)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	185	0,00 %
GBP	500.000	USD	(677.039)	UBS	02.02.2018	54	0,00 %
USD	413	JPY	(46.480)	Brown Brothers Harriman & Co.	05.01.2018	—	0,00 %
USD	3.000.019	NZD	(4.220.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(21)	(0,00 %)
USD	2.269.581	ILS	(7.870.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(115)	(0,00 %)
USD	3.480.982	SGD	(4.650.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(169)	(0,00 %)
USD	1.592.349	CZK	(33.800.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(179)	(0,00 %)
USD	5.090.794	PLN	(17.690.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(293)	(0,00 %)
USD	1.777.762	JPY	(200.000.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(332)	(0,00 %)
USD	2.487.443	NOK	(20.330.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(419)	(0,00 %)
USD	24.867.895	AUD	(31.794.319)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(501)	(0,00 %)
USD	2.209.500	HUF	(570.000.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(684)	(0,00 %)
USD	4.951.615	DKK	(30.650.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(1.544)	(0,00 %)
USD	43.747.829	CAD	(54.790.000)	UBS	02.02.2018	(1.572)	(0,00 %)
RUB	94.700.000	USD	(1.645.643)	JP Morgan Chase	09.01.2018	(2.008)	(0,00 %)
USD	45.512.074	GBP	(33.610.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(2.056)	(0,00 %)
USD	244.858	MYR	(1.000.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(2.239)	(0,00 %)
RUB	94.700.000	USD	(1.646.098)	JP Morgan Chase	09.01.2018	(2.463)	(0,00 %)
USD	12.001.909	SEK	(98.100.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(3.187)	(0,00 %)
USD	9.758.565	CHF	(9.492.000)	BNP Paribas	02.02.2018	(3.804)	(0,00 %)
USD	1.619.477	GBP	(1.200.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(3.823)	(0,00 %)
USD	1.585.254	CZK	(33.800.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(4.586)	(0,00 %)
USD	302.896	CHF	(300.000)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	(4.976)	(0,00 %)
USD	670.906	GBP	(500.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(5.469)	(0,00 %)
USD	1.192.050	EUR	(1.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(8.750)	(0,00 %)
USD	2.254.756	ILS	(7.870.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(12.178)	(0,00 %)
USD	1.013.544	CHF	(1.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(12.624)	(0,00 %)
USD	3.171.967	THB	(103.729.674)	BNP Paribas	02.02.2018	(13.711)	(0,00 %)
USD	2.202.917	JPY	(250.000.000)	BNP Paribas	05.01.2018	(16.578)	(0,00 %)
USD	1.334.847	GBP	(1.000.000)	UBS	03.01.2018	(17.903)	(0,00 %)

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
USD	1.338.133	CAD	(1.700.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(18.665)	(0,00 %)
USD	1.181.700	EUR	(1.000.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(19.100)	(0,00 %)
USD	135.229.341	JPY	(15.212.760.000)	UBS	02.02.2018	(19.236)	(0,00 %)
USD	1.781.366	EUR	(1.500.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(19.834)	(0,00 %)
USD	4.921.521	DKK	(30.650.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(21.709)	(0,00 %)
USD	1.178.476	EUR	(1.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(22.325)	(0,00 %)
USD	4.779.829	EUR	(4.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(23.372)	(0,00 %)
USD	1.003.833	KRW	(1.100.000.000)	BNP Paribas	02.01.2018	(23.676)	(0,00 %)
USD	2.975.875	EUR	(2.500.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(26.125)	(0,00 %)
USD	1.616.800	RUB	(94.700.000)	JP Morgan Chase	09.01.2018	(26.835)	(0,00 %)
USD	3.452.308	SGD	(4.650.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(27.189)	(0,00 %)
USD	2.176.869	HUF	(570.000.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(29.594)	(0,00 %)
USD	2.455.189	NOK	(20.330.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(30.339)	(0,00 %)
USD	3.570.351	EUR	(3.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(32.050)	(0,00 %)
USD	2.961.466	EUR	(2.500.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(40.534)	(0,00 %)
USD	9.387.926	CHF	(9.192.000)	BNP Paribas	04.01.2018	(45.262)	(0,00 %)
USD	4.665.192	MYR	(19.117.958)	BNP Paribas	05.02.2018	(52.495)	(0,00 %)
USD	4.410.838	MYR	(18.117.958)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(66.048)	(0,01 %)
USD	4.135.513	EUR	(3.500.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(67.288)	(0,01 %)
USD	5.023.142	PLN	(17.690.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(67.798)	(0,01 %)
USD	417.862.611	EUR	(347.414.000)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(106.195)	(0,01 %)
USD	2.894.637	NZD	(4.220.000)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	(106.591)	(0,01 %)
USD	11.802.498	SEK	(98.100.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(179.182)	(0,01 %)
USD	24.454.325	KRW	(26.372.522.000)	BNP Paribas	02.02.2018	(192.892)	(0,02 %)
USD	23.342.344	KRW	(25.272.522.000)	BNP Paribas	02.01.2018	(264.701)	(0,02 %)
USD	24.133.223	AUD	(31.794.319)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(734.706)	(0,05 %)
USD	41.231.909	CAD	(53.090.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(1.140.093)	(0,08 %)
USD	404.941.225	EUR	(338.914.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(2.026.778)	(0,15 %)
						(3.601.539)	(0,26 %)

Offene Devisenterminkontrakte zu Absicherungszwecken auf Ebene der Anteilsklasse 0,07 % (2016: (0,96 %))

EUR	386.388.524	USD	(461.664.737)	JP Morgan Chase	03.01.2018	2.310.687	0,17 %
EUR	10.384.444	USD	(12.270.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	199.643	0,02 %
EUR	372.324.728	USD	(447.824.737)	JP Morgan Chase	02.02.2018	113.810	0,01 %
CHF	21.056.235	USD	(21.505.046)	BNP Paribas	04.01.2018	103.682	0,01 %
GBP	3.918.052	USD	(5.230.000)	UBS	03.01.2018	70.144	0,01 %
EUR	4.772.126	USD	(5.680.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	50.370	0,00 %
GBP	598.402.073	USD	(810.310.010)	JP Morgan Chase	02.02.2018	36.597	0,00 %
EUR	5.941.635	USD	(7.100.000)	BNP Paribas	03.01.2018	34.717	0,00 %
GBP	3.253.836	USD	(4.370.000)	BNP Paribas	03.01.2018	31.627	0,00 %
EUR	1.272.831	USD	(1.500.000)	BNP Paribas	03.01.2018	28.415	0,00 %
EUR	2.306.950	USD	(2.750.000)	BNP Paribas	03.01.2018	20.186	0,00 %
CHF	1.429.341	USD	(1.450.000)	BNP Paribas	04.01.2018	16.845	0,00 %
GBP	956.973	USD	(1.280.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	14.545	0,00 %
GBP	1.259.491	USD	(1.690.000)	BNP Paribas	03.01.2018	13.776	0,00 %
GBP	1.066.949	USD	(1.430.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	13.315	0,00 %
GBP	697.100	USD	(930.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	13.001	0,00 %
GBP	762.002	USD	(1.020.000)	BNP Paribas	03.01.2018	10.797	0,00 %
GBP	5.358.874	USD	(7.240.000)	BNP Paribas	03.01.2018	9.216	0,00 %
CHF	22.639.265	USD	(23.275.046)	BNP Paribas	02.02.2018	9.073	0,00 %
GBP	1.602.919	USD	(2.160.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	8.348	0,00 %
GBP	841.018	USD	(1.130.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	7.687	0,00 %
GBP	574.846	USD	(770.000)	BNP Paribas	03.01.2018	7.623	0,00 %
GBP	471.110	USD	(630.000)	BNP Paribas	03.01.2018	7.294	0,00 %
GBP	551.280	USD	(740.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	5.744	0,00 %
GBP	550.268	USD	(740.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	4.375	0,00 %
EUR	619.815	USD	(740.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	4.274	0,00 %
GBP	1.289.305	USD	(1.740.000)	BNP Paribas	03.01.2018	4.107	0,00 %
GBP	940.165	USD	(1.270.000)	JP Morgan Chase	03.01.2018	1.808	0,00 %
GBP	3.922.047	USD	(5.310.000)	BNP Paribas	02.02.2018	1.173	0,00 %
CHF	234.960	USD	(240.000)	BNP Paribas	04.01.2018	1.125	0,00 %
CHF	59.078	USD	(60.000)	JP Morgan Chase	04.01.2018	628	0,00 %
CHF	49.073	USD	(50.000)	BNP Paribas	04.01.2018	360	0,00 %
USD	810.310.010	GBP	(599.009.432)	JP Morgan Chase	03.01.2018	119	0,00 %

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
CHF	9.826	USD	(10.000)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	84	0,00 %
JPY	5.435.865	USD	(48.318)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	9	0,00 %
USD	525	JPY	(59.065)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	—	0,00 %
JPY	11.243	USD	(100)	BNP Paribas	02.02.2018	—	0,00 %
USD	63	JPY	(7.128)	BNP Paribas	05.01.2018	—	0,00 %
USD	1.999.541	EUR	(1.665.174)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	—	0,00 %
GBP	974.448	USD	(1.318.184)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	—	0,00 %
JPY	46.480	USD	(413)	Brown Brothers Harriman & Co.	05.01.2018	—	0,00 %
USD	48.318	JPY	(5.443.064)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	(5)	(0,00 %)
JPY	74.718	USD	(669)	BNP Paribas	05.01.2018	(6)	(0,00 %)
USD	120.613	CHF	(117.538)	Brown Brothers Harriman & Co.	04.01.2018	(8)	(0,00 %)
USD	10.000	CHF	(9.814)	JP Morgan Chase	04.01.2018	(72)	(0,00 %)
USD	447.824.737	EUR	(372.938.655)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(80)	(0,00 %)
CHF	106.872	USD	(110.000)	BNP Paribas	02.02.2018	(84)	(0,00 %)
USD	570.000	EUR	(473.855)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(88)	(0,00 %)
USD	10.000	CHF	(9.880)	JP Morgan Chase	04.01.2018	(140)	(0,00 %)
USD	20.000	CHF	(19.749)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	(267)	(0,00 %)
JPY	5.328.994	USD	(47.712)	BNP Paribas	05.01.2018	(402)	(0,00 %)
USD	7.340.000	GBP	(5.421.135)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(1.215)	(0,00 %)
USD	23.275.046	CHF	(22.681.532)	BNP Paribas	04.01.2018	(1.624)	(0,00 %)
EUR	2.142.448	USD	(2.580.000)	BNP Paribas	02.02.2018	(2.452)	(0,00 %)
USD	260.000	EUR	(220.769)	BNP Paribas	03.01.2018	(5.099)	(0,00 %)
USD	760.000	EUR	(640.930)	BNP Paribas	03.01.2018	(9.629)	(0,00 %)
USD	610.000	EUR	(516.857)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(10.642)	(0,00 %)
USD	570.000	EUR	(484.911)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(12.281)	(0,00 %)
USD	1.280.000	GBP	(957.136)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(14.766)	(0,00 %)
GBP	6.219.158	USD	(8.430.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(17.036)	(0,00 %)
USD	1.670.000	EUR	(1.406.224)	BNP Paribas	03.01.2018	(18.594)	(0,00 %)
USD	6.180.000	GBP	(4.598.823)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(41.057)	(0,00 %)
USD	40.010.000	EUR	(33.812.806)	BNP Paribas	03.01.2018	(592.424)	(0,04 %)
GBP	573.277.599	USD	(776.970.010)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(1.468.852)	(0,11 %)
						958.381	0,07 %
Summe Derivative Finanzinstrumente						(2.680.508)	(0,19 %)
						Marktwert	% des Gesamt-
						US-Dollars (\$)	nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva						26.508.645	1,92 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)						1.379.563.019	100,00 %
							% des Gesamt-
Analyse des Gesamtvermögens						US-Dollar (\$)	nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind						1.077.327.424	78,09 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						216.332.834	15,68 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						62.074.624	4,50 %
(d) Derivative Finanzinstrumente						(2.680.508)	(0,19 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva						26.508.645	1,92 %
Gesamtnettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)						1.379.563.019	100,00 %

[^] Zinsvariable Anleihe (FRN). Der Effektivzins zum 31. Dezember 2017.

1 Bezeichnet Wertpapiere, die vollständig oder teilweise als Sicherheiten für offene Derivate verpfändet wurden.

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Kosten		Erlöse	
	Kapital	US-Dollar (\$)	Kapital	US-Dollar (\$)
Käufe				
US Treasury Note 1,75 % 15.11.2020	\$ 28.265.000	28.141.149		
US Treasury Note 1,38 % 30.9.2019	\$ 24.985.000	24.888.837		
US Treasury Note 1,63 % 15.10.2020	\$ 22.985.000	22.907.546		
US Treasury Note 1,75 % 30.11.2019	\$ 20.770.000	20.733.818		
Bundesobligation 0,00 % 8.4.2022	\$ 17.000.000	19.644.209		
US Treasury Note 1,63 % 31.8.2022	\$ 19.025.000	18.695.195		
US Treasury Note 1,88 % 31.1.2022	\$ 18.400.000	18.399.695		
US Treasury Note 1,88 % 28.2.2022	\$ 16.000.000	15.955.941		
US Treasury Note 1,88 % 30.9.2022	\$ 15.515.000	15.419.575		
US Treasury Note 2,00 % 31.10.2022	\$ 15.290.000	15.255.161		
US Treasury Note 1,88 % 31.3.2022	\$ 15.285.000	15.238.225		
US Treasury Note 1,75 % 30.6.2022	\$ 15.215.000	15.128.367		
Bundesobligation 0,00 % 7.10.2022	€ 11.600.000	13.815.681		
US Treasury Note 1,88 % 31.7.2022	\$ 13.745.000	13.788.336		
Japan Government Bond 0,10 % 20.6.2022	¥ 1.392.000.000	12.557.151		
US Treasury Note 1,50 % 15.5.2020	\$ 11.825.000	11.841.143		
US Treasury Note 1,75 % 31.5.2022	\$ 11.780.000	11.776.985		
US Treasury Note 1,63 % 15.3.2020	\$ 11.061.000	11.062.973		
Bundesobligation 0,00 % 9.4.2021	€ 9.100.000	10.882.518		
Japan Government Bond 0,10 % 20.3.2022	¥ 1.140.000.000	10.309.442		
Verkäufe				
Bundesobligation 0,00 % 8.4.2022	€ 14.674.000	17.361.296		
US Treasury Note 1,75 % 15.11.2020	\$ 15.490.000	15.407.440		
US Treasury Note 1,63 % 15.10.2020	\$ 13.575.000	13.488.009		
Bundesrepublik Deutschland 4,25 % 4.7.2018	€ 10.800.000	12.557.277		
US Treasury Note 1,75 % 30.6.2022	\$ 11.845.000	11.793.252		
US Treasury Note 2,00 % 31.10.2022	\$ 11.815.000	11.752.079		
Bundesobligation 0,00 % 7.10.2022	€ 8.850.000	10.595.042		
US Treasury Note 1,88 % 31.7.2022	\$ 10.325.000	10.374.430		
US Treasury Note 1,50 % 15.5.2020	\$ 10.240.000	10.258.743		
US Treasury Note 1,88 % 31.1.2022	\$ 10.150.000	10.152.658		
US Treasury Note 1,63 % 15.3.2020	\$ 9.570.000	9.610.599		
Bundesobligation 0,00 % 8.10.2021	€ 8.720.000	9.596.903		
US Treasury Note 2,00 % 31.12.2021	\$ 9.130.000	9.171.554		
US Treasury Note 1,75 % 31.5.2022	\$ 9.098.000	9.088.984		
US Treasury Note 1,88 % 28.2.2022	\$ 8.875.000	8.864.188		
US Treasury Note 1,88 % 30.9.2022	\$ 8.733.000	8.681.282		
Bundesobligation 0,00 % 9.4.2021	€ 6.740.000	7.878.300		
US Treasury Note 1,50 % 15.6.2020	\$ 7.560.000	7.560.229		
US Treasury Note 1,75 % 30.11.2019	\$ 7.529.200	7.515.067		
United Kingdom Gilt 1,25 % 22.07.2018	£ 4.500.000	6.035.394		

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.355.734.882	1.023.056.177
Derivative Finanzinstrumente	5.116.593	7.124.040
Barmittel und liquide Vermögenswerte	25.220.422	12.636.205
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenkassageschäften	53.271	—
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	8.670.940	6.817.215
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	19.391.831	4.675.839
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	18.421.050	4.832.847
Bareinschüsse für Futures	46.067	35.495
Sonstige Forderungen	137	1.222
Summe Umlaufvermögen	1.432.655.193	1.059.179.040
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	7.797.101	10.937.379
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	—	46.836
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	36.147.672	11.053.283
Zahlbare Dividenden	931.853	721.001
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	8.042.364	1.349.514
Zahlbare Verwaltungsgebühren	173.184	130.702
Summe kurzfristige Passiva	53.092.174	24.238.715
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken) („Nettovermögen“)	1.379.563.019	1.034.940.325

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Anteile, abgesichert in CHF			
Gegenwert in US (\$)	18.366.932	10.076.667	13.148.669
Nettovermögen	17.898.575	10.241.421	13.161.818
Anzahl der umlaufenden Anteile	179.602	101.843	130.646
Nettoinventarwert je Anteil	99,66	100,56	100,74
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR (€)			
Gegenwert in US (\$)	363.806.293	254.974.774	71.755.016
Nettovermögen	302.969.933	241.739.539	66.054.512
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.962.231	2.355.915	647.195
Nettoinventarwert je Anteil	102,28	102,61	102,06
Institutionelle Anteile, abgesichert in USD (\$)			
Nettovermögen	80.380.428	55.586.157	42.736.576
Anzahl der umlaufenden Anteile	756.359	530.933	415.959
Nettoinventarwert je Anteil	106,27	104,70	102,74
Anlegeranteile, abgesichert in CHF (CHF)			
Gegenwert in US (\$)	3.664.049	2.180.813	327.078
Nettovermögen	3.570.616	2.216.469	327.405
Anzahl der umlaufenden Anteile	35.876	22.059	3.252
Nettoinventarwert je Anteil	99,53	100,48	100,70
Anlegeranteile, abgesichert in EUR (€)			
Gegenwert in US (\$)	49.402.149	49.401.091	23.112.321
Nettovermögen	41.141.030	46.836.778	21.276.186
Anzahl der umlaufenden Anteile	402.783	456.832	208.564
Nettoinventarwert je Anteil	102,14	102,53	102,01

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Nettoinventarwert je Anteil (Fortsetzung)

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Anlegeranteile, abgesichert in USD (\$)			
Nettovermögen	7.540.226	7.907.301	4.351.050
Anzahl der umlaufenden Anteile	72.543	77.183	43.250
Nettoinventarwert je Anteil	103,94	102,45	100,60
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in US (\$)	387.218.742	281.962.402	171.282.475
Nettovermögen	286.245.615	228.189.547	116.210.379
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.716.559	2.175.444	1.124.271
Nettoinventarwert je Anteil	105,37	104,89	103,37
Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in US (\$)	375.534.327	336.970.844	275.059.020
Nettovermögen	277.608.087	272.707.367	186.619.868
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.724.171	2.664.861	1.834.682
Nettoinventarwert je Anteil	101,91	102,33	101,72
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in CHF (CHF)			
Gegenwert in US (\$)	1.364.569	4.951	5.030
Nettovermögen	1.329.772	5.032	5.035
Anzahl der umlaufenden Anteile	13.301	50	50
Nettoinventarwert je Anteil	99,98	100,64	100,90
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in EUR (€)			
Gegenwert in US (\$)	36.477.552	2.371.723	43.328
Nettovermögen	30.377.708	2.248.612	39.886
Anzahl der umlaufenden Anteile	296.486	21.886	391
Nettoinventarwert je Anteil	102,46	102,74	102,13
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in JPY (¥)			
Gegenwert in US (\$)	47.900	46.281	—
Nettovermögen	5.395.935	5.397.984	—
Anzahl der umlaufenden Anteile	545	545	—
Nettoinventarwert je Anteil	9.900,80	9.904,56	—
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in USD (\$)			
Nettovermögen	10.696.457	12.072.480	10.904.259
Anzahl der umlaufenden Anteile	102.622	117.627	108.296
Nettoinventarwert je Anteil	104,23	102,63	100,69
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in US (\$)	13.679.152	5.313.921	1.182.243
Nettovermögen	10.112.107	4.300.507	802.119
Anzahl der umlaufenden Anteile	97.109	41.507	7.861
Nettoinventarwert je Anteil	104,13	103,61	102,03
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in US (\$)	31.384.243	16.070.920	22.191
Nettovermögen	23.200.328	13.006.046	15.056
Anzahl der umlaufenden Anteile	229.574	128.164	149
Nettoinventarwert je Anteil	101,06	101,48	100,80

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	12.820.313	8.701.944
Verschiedene Erträge	29.551	23.351
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	110.187.506	(111.171.108)
Summe Anlageerträge/(-verluste)	123.037.370	(102.445.813)
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	1.823.760	1.291.010
Transaktionsgebühren und Provisionen	2.813	1.015
Sonstige Aufwendungen	423	2.385
Summe Aufwendungen	1.826.996	1.294.410
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	41.123	14.591
Ausgezahlte Ausschüttungen	3.335.883	2.728.329
Ertragsausgleich	(48.771)	(94.052)
Summe Finanzierungskosten	3.328.235	2.648.868
Nettoanlageerträge/(-verluste)	117.882.139	(106.389.091)
Ausländische Quellensteuer	(103.914)	(95.782)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	117.778.225	(106.484.873)

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	117.778.225	(106.484.873)
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	641.359.014	1.403.068.571
Rücknahmen	(414.519.110)	(875.575.287)
Reinvestitionen	4.565	2.658
Summe Kapitalgeschäfte ¹	226.844.469	527.495.942
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	344.622.694	421.011.069
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	1.034.940.325	613.929.256
Zum Jahresende	1.379.563.019	1.034.940.325

¹ Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Global Short-Term Corporate Bond Index Fund

Verwaltet durch The Vanguard Group, Inc.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds hat sich zum Ziel gesetzt, Renditen zu liefern, die der Performance des Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate 1–5 Year Float Adjusted Index, einem marktgewichteten Index aus globalen festverzinslichen Unternehmensanlagen mit Laufzeiten zwischen 1 und 5 Jahren.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	977	4.791
Rendite auf Endfälligkeit	1,8 % ³	1,9 %
Durchschnittlicher Kupon	2,9 %	3,1 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	3,0 Jahre	3,0 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	A3	A3
Durchschnittliche Duration	2,8 Jahre	2,8 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Thesaurierungsanteile	0,20 %	
Anlegeranteile Thesaurierungsanteile	0,25 %	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,12 %	
Kurzfristige Reserven	3,2 %	—

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds
Industriegüter	47,6 %
Finanzinstitute	43,7
Versorger	4,8
Treasury/Federal	3,1
Barmittel	0,8

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	2,6 %
Aa	11,9
A	41,9
Baa	42,8
nicht eingestuft	0,8

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	94,7 %
Mehr als 5 Jahre	5,3 %

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit

Durchschnittliche Fälligkeit	Kurz	Mittel	Lang
Kreditqualität Staats-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate 1–5 Year Float Adjusted Index Hedged.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

Global Short-Term Corporate Bond Index Fund

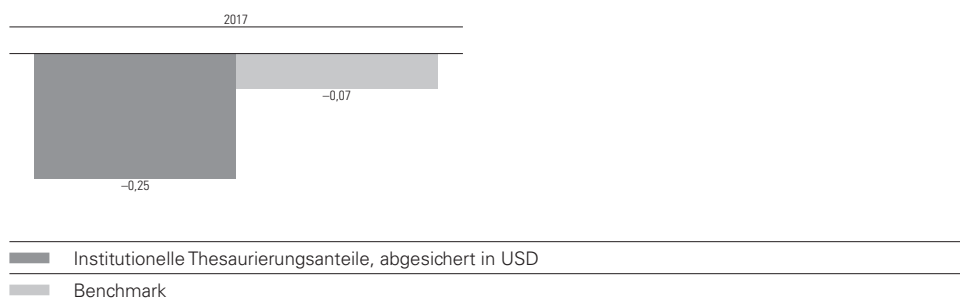
Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate 1-5Year Float Adjusted Index USD-Hedged

Abgesichert in US-Dollar

	Gesamtrenditen		Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in USD	-0,25 %		\$ 4.987.640
Benchmark	-0,07		4.996.292

Der Tracking-Unterschied für den Zeitraum betrug 0,18 Prozentpunkte für in USD abgesicherte institutionelle Thesaurierungsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 2. November 2017–31. Dezember 2017



¹ 2. November 2017.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Global Short-Term Corporate Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate 1–5Year Float Adjusted Index GBP-Hedged

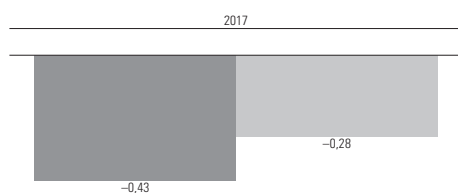
Abgesichert in GBP

	Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017	Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in GBP	-0,43 %	£ 99.567
Benchmark	-0,28	99.717

	Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017	Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
	Seit Auflegung ¹	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	-0,42 %	£ 199.155.227
Benchmark	-0,28	199.434.482

Der Tracking-Unterschied für den Zeitraum betrug 0,15 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte thesaurierende Anlegeranteile und 0,14 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 2. November 2017–31. Dezember 2017



	Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in GBP
	Benchmark

¹ 2. November 2017.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 98,25 %					
Australien 3,24 %					
National Australia Bank Ltd.	\$ 350.000	2,25 %	10.01.2020	349.183	0,31 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	\$ 250.000	2,70 %	16.11.2020	251.311	0,23 %
Westpac Banking Corp.	\$ 200.000	2,15 %	06.03.2020	199.032	0,18 %
Macquarie Group Ltd. ^	\$ 200.000	3,19 %	28.11.2023	198.599	0,18 %
Telstra Corp., Ltd.	AUD 250.000	2,90 %	19.04.2021	195.476	0,18 %
Commonwealth Bank of Australia	AUD 200.000	3,75 %	18.10.2019	160.047	0,14 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 150.000	5,00 %	19.03.2020	158.082	0,14 %
National Australia Bank Ltd.	AUD 200.000	3,00 %	10.02.2023	155.302	0,14 %
National Australia Bank Ltd.	£ 100.000	5,13 %	09.12.2021	154.904	0,14 %
Suncorp-Metway Ltd.	\$ 150.000	2,80 %	04.05.2022	149.438	0,13 %
Westpac Banking Corp.	\$ 150.000	1,65 %	13.05.2019	148.892	0,13 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 150.000	2,50 %	18.09.2022	148.386	0,13 %
Telstra Corp., Ltd.	€ 100.000	3,50 %	21.09.2022	137.208	0,12 %
Commonwealth Bank of Australia	€ 100.000	4,38 %	25.02.2020	131.386	0,12 %
BHP Billiton Finance Ltd.	€ 100.000	2,25 %	25.09.2020	127.366	0,12 %
National Australia Bank Ltd.	€ 100.000	2,00 %	12.11.2020	126.629	0,11 %
Commonwealth Bank of Australia ^	€ 100.000	2,00 %	22.04.2027	124.039	0,11 %
APT Pipelines Ltd.	€ 100.000	1,38 %	22.03.2022	123.961	0,11 %
Westpac Banking Corp.	€ 100.000	0,25 %	17.01.2022	119.799	0,11 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.	\$ 100.000	2,88 %	24.02.2022	101.014	0,09 %
Westpac Banking Corp.	\$ 100.000	2,75 %	11.01.2023	99.650	0,09 %
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	\$ 60.000	9,75 %	01.03.2022	66.450	0,06 %
Westpac Banking Corp.	\$ 50.000	2,50 %	28.06.2022	49.633	0,05 %
Commonwealth Bank of Australia	\$ 50.000	1,75 %	07.11.2019	49.512	0,05 %
Newcrest Finance Pty Ltd.	\$ 40.000	4,20 %	01.10.2022	41.470	0,04 %
Rio Tinto Finance USA Ltd.	\$ 30.000	4,13 %	20.05.2021	31.476	0,03 %
				3.598.245	3,24 %
Österreich 0,23 %					
OMV AG	€ 100.000	4,38 %	10.02.2020	131.144	0,12 %
UniCredit Bank Austria AG	€ 100.000	2,50 %	27.05.2019	124.239	0,11 %
				255.383	0,23 %
Belgien 0,38 %					
Anheuser-Busch InBev SA	€ 150.000	0,63 %	17.03.2020	182.574	0,16 %
Anheuser-Busch InBev SA	€ 100.000	0,88 %	17.03.2022	122.983	0,11 %
Belfius Bank SA	€ 100.000	0,75 %	12.09.2022	120.369	0,11 %
				425.926	0,38 %
Brasilien 0,32 %					
Embraer SA	\$ 100.000	5,15 %	15.06.2022	106.553	0,10 %
Braskem Finance Ltd.	\$ 75.000	5,38 %	02.05.2022	79.687	0,07 %
Vale Overseas Ltd.	\$ 60.000	4,38 %	11.01.2022	62.100	0,05 %
Vale Overseas Ltd.	\$ 50.000	5,88 %	10.06.2021	54.563	0,05 %
Gerdau Holdings, Inc.	\$ 50.000	7,00 %	20.01.2020	53.625	0,05 %
				356.528	0,32 %
Kanada 5,28 %					
Royal Bank of Canada	\$ 250.000	2,15 %	26.10.2020	248.110	0,22 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	\$ 200.000	2,10 %	05.10.2020	198.304	0,18 %
Bank of Nova Scotia	CAD 200.000	2,40 %	28.10.2019	160.469	0,14 %
Royal Bank of Canada	CAD 200.000	1,92 %	17.07.2020	158.247	0,14 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	CAD 200.000	1,66 %	20.01.2020	157.914	0,14 %
Toronto-Dominion Bank	CAD 200.000	1,69 %	02.04.2020	157.796	0,14 %
HSBC Bank Canada	CAD 200.000	1,82 %	07.07.2020	157.572	0,14 %
Royal Bank of Canada	\$ 150.000	2,75 %	01.02.2022	151.416	0,14 %
Bank of Montreal	\$ 150.000	1,75 %	11.09.2019	148.733	0,13 %
Toronto-Dominion Bank	\$ 150.000	1,85 %	11.09.2020	147.982	0,13 %
TransCanada PipeLines Ltd.	\$ 125.000	7,13 %	15.01.2019	131.263	0,12 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Bank of Nova Scotia	\$ 125.000	1,65 %	14.06.2019	124.055	0,11 %
Toronto-Dominion Bank	\$ 125.000	1,45 %	13.08.2019	123.634	0,11 %
Royal Bank of Canada^	CAD 150.000	2,99 %	06.12.2024	121.306	0,11 %
Bank of Montreal	CAD 150.000	2,10 %	06.10.2020	119.010	0,11 %
Caisse Centrale Desjardins	CAD 150.000	1,75 %	02.03.2020	118.493	0,11 %
National Bank of Canada	CAD 150.000	1,74 %	03.03.2020	118.476	0,11 %
Royal Bank of Canada	CAD 150.000	2,00 %	21.03.2022	117.365	0,11 %
Royal Bank of Canada	CAD 150.000	1,65 %	15.07.2021	116.709	0,11 %
Bank of Montreal	CAD 150.000	1,61 %	28.10.2021	116.133	0,10 %
Canadian Government Bond	CAD 150.000	1,00 %	01.09.2022	115.102	0,10 %
Husky Energy, Inc.	\$ 100.000	6,15 %	15.06.2019	104.897	0,09 %
TELUS Corp.	CAD 125.000	3,60 %	26.01.2021	102.896	0,09 %
Canadian Natural Resources Ltd.	CAD 125.000	2,89 %	14.08.2020	100.601	0,09 %
Bank of Nova Scotia	\$ 100.000	2,15 %	14.07.2020	99.562	0,09 %
Bank of Nova Scotia	\$ 100.000	2,45 %	19.09.2022	98.835	0,09 %
Bank of Montreal	\$ 100.000	2,35 %	11.09.2022	98.316	0,09 %
Toronto-Dominion Bank	\$ 100.000	1,80 %	13.07.2021	97.668	0,09 %
CU, Inc.	CAD 100.000	6,80 %	13.08.2019	85.755	0,08 %
Rogers Communications, Inc.	CAD 100.000	4,00 %	06.06.2022	84.335	0,08 %
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	\$ 80.000	6,50 %	15.05.2019	84.105	0,08 %
Enbridge Pipelines, Inc.	CAD 100.000	4,49 %	12.11.2019	83.176	0,08 %
Suncor Energy, Inc.	CAD 100.000	3,10 %	26.11.2021	81.437	0,07 %
Loblaw Cos Ltd.	CAD 100.000	3,75 %	12.03.2019	81.339	0,07 %
Bank of Nova Scotia^	CAD 100.000	3,37 %	08.12.2025	81.205	0,07 %
Bell Canada, Inc.	CAD 100.000	3,35 %	18.06.2019	81.171	0,07 %
Enbridge, Inc.	CAD 100.000	3,16 %	11.03.2021	80.807	0,07 %
Bell Canada, Inc.	CAD 100.000	3,00 %	03.10.2022	80.676	0,07 %
Rogers Communications, Inc.	CAD 100.000	2,80 %	13.03.2019	80.515	0,07 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	CAD 100.000	2,30 %	11.07.2022	79.018	0,07 %
Bank of Montreal	CAD 100.000	2,27 %	11.07.2022	78.917	0,07 %
Toronto-Dominion Bank	CAD 100.000	1,99 %	23.03.2022	78.379	0,07 %
Bank of Nova Scotia	CAD 100.000	1,83 %	27.04.2022	77.592	0,07 %
Canadian Pacific Railway Co.	\$ 50.000	7,25 %	15.05.2019	53.258	0,05 %
Barrick North America Finance LLC	\$ 50.000	4,40 %	30.05.2021	52.892	0,05 %
Thomson Reuters Corp.	\$ 50.000	3,95 %	30.09.2021	51.641	0,05 %
Alimentation Couche-Tard, Inc.	\$ 50.000	2,35 %	13.12.2019	49.928	0,05 %
Bank of Nova Scotia	\$ 50.000	2,05 %	05.06.2019	49.830	0,05 %
Emera US Finance LP	\$ 50.000	2,15 %	15.06.2019	49.729	0,04 %
Cenovus Energy, Inc.	\$ 50.000	3,00 %	15.08.2022	49.562	0,04 %
Fortis, Inc.	\$ 50.000	2,10 %	04.10.2021	48.770	0,04 %
Manulife Financial Capital Trust II^	CAD 50.000	7,41 %	31.12.2108	43.539	0,04 %
Agrium, Inc.	\$ 40.000	6,75 %	15.01.2019	41.755	0,04 %
Canadian Imperial Bank of Commerce^	CAD 50.000	3,42 %	26.01.2026	40.629	0,04 %
Bank of Montreal^	CAD 50.000	3,32 %	01.06.2026	40.555	0,04 %
Toronto-Dominion Bank^	CAD 50.000	2,69 %	24.06.2025	39.978	0,04 %
Manufacturers Life Insurance Co.^	CAD 50.000	2,10 %	01.06.2025	39.612	0,04 %
Federation des Caisses Desjardins du Quebec	CAD 50.000	2,39 %	25.08.2022	39.569	0,04 %
HSBC Bank Canada	CAD 50.000	2,17 %	29.06.2022	39.144	0,04 %
Fairfax Financial Holdings Ltd.	CAD 40.000	5,84 %	14.10.2022	35.251	0,03 %
Encana Corp.	\$ 25.000	6,50 %	15.05.2019	26.254	0,02 %
Encana Corp.	\$ 25.000	3,90 %	15.11.2021	25.700	0,02 %
TransAlta Corp.	\$ 25.000	4,50 %	15.11.2022	25.387	0,02 %
Canadian National Railway Co.	\$ 25.000	2,85 %	15.12.2021	25.294	0,02 %
Emera US Finance LP	\$ 25.000	2,70 %	15.06.2021	24.857	0,02 %
Great-West Lifeco, Inc.	CAD 25.000	4,65 %	13.08.2020	21.121	0,02 %
Sun Life Financial, Inc.^	CAD 25.000	3,10 %	19.02.2026	20.246	0,02 %
				5.863.792	5,28 %
Chile 0,06 %					
Celulosa Arauco y Constitucion SA	\$ 60.000	4,75 %	11.01.2022	63.473	0,06 %
				63.473	0,06 %
China 0,89 %					
Alibaba Group Holding Ltd.	\$ 200.000	2,50 %	28.11.2019	200.251	0,18 %
CSCEC Finance Cayman II Ltd.	\$ 200.000	2,70 %	14.06.2021	198.040	0,18 %
Azure Orbit III International Finance Ltd.	\$ 200.000	2,63 %	21.03.2021	196.740	0,18 %
Union Life Insurance Co., Ltd.	\$ 200.000	3,00 %	19.09.2021	191.286	0,17 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Baidu, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	28.11.2022	101.667	0,09 %
Tencent Holdings Ltd.	\$ 100.000	3,38 %	02.05.2019	101.145	0,09 %
				989.129	0,89 %
Dänemark 0,51 %					
Danske Bank A/S	\$ 200.000	2,20 %	02.03.2020	199.037	0,18 %
ISS Global A/S	€ 100.000	1,13 %	09.01.2020	122.191	0,11 %
Jyske Bank A/S	€ 100.000	0,63 %	14.04.2021	121.547	0,11 %
Nykredit Realkredit A/S	€ 100.000	0,75 %	14.07.2021	121.539	0,11 %
				564.314	0,51 %
Finnland 0,23 %					
Citycon Oyj	€ 100.000	3,75 %	24.06.2020	130.452	0,12 %
OP Corporate Bank plc	€ 100.000	0,88 %	21.06.2021	123.144	0,11 %
				253.596	0,23 %
Frankreich 6,64 %					
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 200.000	2,63 %	24.02.2021	258.804	0,23 %
BPCE SA	\$ 250.000	3,00 %	22.05.2022	249.743	0,22 %
Orange SA	€ 200.000	1,88 %	02.10.2019	248.483	0,22 %
Credit Agricole SA	\$ 250.000	2,38 %	01.07.2021	248.176	0,22 %
BNP Paribas SA	\$ 200.000	2,38 %	21.05.2020	200.025	0,18 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	\$ 200.000	2,20 %	20.07.2020	198.288	0,18 %
BNP Paribas SA	€ 150.000	0,50 %	01.06.2022	181.636	0,16 %
Pernod Ricard SA	\$ 150.000	4,25 %	15.07.2022	158.543	0,14 %
Orange SA	\$ 150.000	1,63 %	03.11.2019	148.141	0,13 %
AXA SA^	£ 100.000	6,77 %	16.10.2166	147.396	0,13 %
Veolia Environnement SA	€ 100.000	5,13 %	24.05.2022	144.727	0,13 %
Holding d'Infrastructures de Transport SAS	€ 100.000	4,88 %	27.10.2021	141.084	0,13 %
Bouygues SA	€ 100.000	4,50 %	09.02.2022	140.756	0,13 %
RCI Banque SA	£ 100.000	3,00 %	09.05.2019	138.861	0,13 %
TOTAL SA^	€ 100.000	3,88 %	18.05.2166	134.490	0,12 %
Credit Agricole SA	€ 100.000	3,90 %	19.04.2021	134.238	0,12 %
BNP Paribas SA	£ 100.000	1,13 %	16.08.2022	133.622	0,12 %
AXA SA^	€ 100.000	5,25 %	16.04.2040	133.072	0,12 %
BNP Paribas SA	€ 100.000	3,75 %	25.11.2020	132.926	0,12 %
Lafarge SA	€ 100.000	5,50 %	16.12.2019	132.588	0,12 %
Autoroutes du Sud de la France SA	€ 100.000	4,13 %	13.04.2020	131.244	0,12 %
Arkema SA	€ 100.000	3,85 %	30.04.2020	130.591	0,12 %
Suez	€ 100.000	6,25 %	08.04.2019	129.655	0,12 %
Cie de Saint-Gobain	€ 100.000	4,50 %	30.09.2019	129.584	0,12 %
Engie SA	€ 100.000	6,88 %	24.01.2019	129.039	0,12 %
Orange SA^	€ 100.000	4,25 %	07.02.2166	128.981	0,12 %
BNP Paribas SA^	€ 100.000	2,88 %	20.03.2026	128.259	0,12 %
Auchan Holding SA	€ 100.000	1,75 %	23.04.2021	126.277	0,11 %
Unibail-Rodamco SE	€ 100.000	1,38 %	17.10.2022	125.793	0,11 %
Pernod Ricard SA	€ 100.000	2,00 %	22.06.2020	125.789	0,11 %
Total Capital Canada Ltd.	€ 100.000	1,88 %	09.07.2020	125.786	0,11 %
BNP Paribas SA	€ 100.000	2,50 %	23.08.2019	125.255	0,11 %
HSBC France SA	€ 100.000	1,88 %	16.01.2020	124.737	0,11 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	€ 100.000	2,00 %	19.09.2019	124.419	0,11 %
Publicis Groupe SA	€ 100.000	1,13 %	16.12.2021	123.385	0,11 %
APRR SA	€ 100.000	1,13 %	15.01.2021	123.339	0,11 %
Carrefour SA	€ 100.000	1,75 %	22.05.2019	123.113	0,11 %
Societe Generale SA	€ 100.000	1,00 %	01.04.2022	122.598	0,11 %
BPCE SA	€ 100.000	0,75 %	22.01.2020	122.038	0,11 %
Air Liquide Finance SA	€ 100.000	0,50 %	13.06.2022	121.399	0,11 %
RCI Banque SA	€ 100.000	0,63 %	04.03.2020	121.344	0,11 %
Engie SA	€ 100.000	0,50 %	13.03.2022	121.342	0,11 %
Capgemini SE	€ 100.000	0,50 %	09.11.2021	120.999	0,11 %
RCI Banque SA	€ 100.000	0,75 %	26.09.2022	120.856	0,11 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	€ 100.000	0,38 %	26.05.2022	120.522	0,11 %
Sanofi	€ 100.000	0,00 %	05.04.2019	120.371	0,11 %
Danone SA	€ 100.000	0,42 %	03.11.2022	120.306	0,11 %
Societe Generale SA	€ 100.000	0,13 %	05.10.2021	119.704	0,11 %
Sanofi	€ 100.000	0,00 %	13.09.2022	118.496	0,11 %
Total Capital International SA	\$ 100.000	2,88 %	17.02.2022	101.184	0,09 %
Total Capital International SA	\$ 100.000	2,10 %	19.06.2019	100.024	0,09 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Air Liquide Finance SA	\$ 100.000	1,75 %	27.09.2021	96.906	0,09 %
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	£ 50.000	1,00 %	14.06.2022	67.319	0,06 %
				7.376.253	6,64 %
Deutschland 5,83 %					
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	€ 700.000	1,75 %	04.07.2022	917.654	0,83 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	\$ 250.000	2,20 %	16.03.2020	249.681	0,22 %
Daimler AG	€ 200.000	0,50 %	09.09.2019	242.513	0,22 %
BMW Finance NV	€ 200.000	0,13 %	03.07.2020	240.894	0,22 %
Deutsche Bank AG	\$ 200.000	2,70 %	13.07.2020	199.036	0,18 %
Deutsche Telekom International Finance BV	£ 100.000	6,50 %	08.04.2022	163.642	0,15 %
Deutsche Bank AG	\$ 150.000	4,25 %	14.10.2021	155.481	0,14 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 150.000	2,85 %	06.01.2022	150.723	0,14 %
Deutsche Telekom International Finance BV	\$ 150.000	2,82 %	19.01.2022	150.030	0,13 %
E.ON International Finance BV	£ 100.000	6,00 %	30.10.2019	147.388	0,13 %
Allianz SE^	€ 100.000	5,63 %	17.10.2042	146.150	0,13 %
Commerzbank AG	€ 100.000	7,75 %	16.03.2021	145.968	0,13 %
Allianz Finance II BV^	€ 100.000	5,75 %	08.07.2041	140.757	0,13 %
Volkswagen Financial Services NV	£ 100.000	1,75 %	17.04.2020	136.910	0,12 %
Allianz Finance II BV	€ 100.000	3,50 %	14.02.2022	136.545	0,12 %
BMW International Investment BV	£ 100.000	1,00 %	17.11.2021	134.328	0,12 %
Merck Financial Services GmbH	€ 100.000	4,50 %	24.03.2020	132.183	0,12 %
innogy Finance BV	€ 100.000	6,63 %	31.01.2019	128.827	0,12 %
Fresenius SE & Co. KGaA	€ 100.000	2,88 %	15.07.2020	128.279	0,11 %
Bayer AG^	€ 100.000	3,00 %	01.07.2075	125.934	0,11 %
Vonovia Finance BV	€ 100.000	1,63 %	15.12.2020	125.098	0,11 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 100.000	2,00 %	30.10.2019	124.810	0,11 %
BMW Finance NV	€ 100.000	1,00 %	15.02.2022	124.019	0,11 %
Deutsche Bank AG	€ 100.000	1,50 %	20.01.2022	124.004	0,11 %
Volkswagen International Finance NV^	€ 100.000	2,50 %	20.03.2166	123.191	0,11 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	€ 100.000	1,13 %	27.04.2020	122.586	0,11 %
Deutsche Bank AG	€ 100.000	1,00 %	18.03.2019	121.403	0,11 %
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA	€ 100.000	0,50 %	18.01.2021	121.201	0,11 %
Volkswagen International Finance NV	€ 100.000	0,50 %	30.03.2021	120.966	0,11 %
Continental Rubber of America Corp.	€ 100.000	0,50 %	19.02.2019	120.934	0,11 %
Linde Finance BV	€ 100.000	0,25 %	18.01.2022	120.870	0,11 %
E.ON SE	€ 100.000	0,38 %	23.08.2021	120.870	0,11 %
Deutsche Telekom International Finance BV	€ 100.000	0,38 %	30.10.2021	120.726	0,11 %
Bertelsmann SE & Co. KGaA	€ 100.000	0,25 %	26.05.2021	120.511	0,11 %
Volkswagen Leasing GmbH	€ 100.000	0,25 %	05.10.2020	120.295	0,11 %
BASF Finance Europe NV	€ 100.000	0,00 %	10.11.2020	120.183	0,11 %
Daimler International Finance BV	€ 100.000	0,20 %	13.09.2021	120.042	0,11 %
DVB Bank SE	€ 100.000	1,00 %	25.04.2022	119.257	0,11 %
Daimler Canada Finance, Inc.	CAD 100.000	1,57 %	25.05.2020	78.397	0,07 %
BMW US Capital LLC	\$ 75.000	1,50 %	11.04.2019	74.453	0,07 %
Deutsche Post AG	€ 50.000	1,88 %	11.12.2020	63.305	0,06 %
BMW US Capital LLC	\$ 50.000	2,70 %	06.04.2022	50.029	0,04 %
BMW US Capital LLC	\$ 50.000	2,00 %	11.04.2021	49.261	0,04 %
				6.479.334	5,83 %
Hongkong 0,48 %					
CK Hutchison International 17 II Ltd.	\$ 400.000	2,25 %	29.09.2020	395.073	0,36 %
Hutchison Whampoa Europe Finance 12 Ltd.	€ 100.000	3,63 %	06.06.2022	136.111	0,12 %
				531.184	0,48 %
Indien 0,36 %					
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	\$ 200.000	3,95 %	19.01.2022	203.958	0,18 %
ICICI Bank Ltd.	\$ 200.000	3,13 %	12.08.2020	200.000	0,18 %
				403.958	0,36 %
Irland 0,15 %					
CRH Finland Services OYJ	€ 100.000	2,75 %	15.10.2020	127.969	0,12 %
Johnson Controls International plc	\$ 35.000	5,00 %	30.03.2020	36.896	0,03 %
				164.865	0,15 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Israel 0,15 %					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	\$ 100.000	2,20 %	21.07.2021	91.621	0,08 %
Teva Pharmaceutical Finance IV LLC	\$ 75.000	2,25 %	18.03.2020	72.405	0,07 %
				164.026	0,15 %
Italien 1,81 %					
Enel Finance International NV	€ 200.000	5,00 %	14.09.2022	293.053	0,26 %
Enel SpA	£ 100.000	6,25 %	20.06.2019	145.306	0,13 %
Autostrade per l'Italia SpA	€ 100.000	4,38 %	16.03.2020	131.701	0,12 %
ENI SpA	€ 100.000	2,63 %	22.11.2021	131.229	0,12 %
UniCredit SpA	€ 100.000	4,38 %	29.01.2020	130.820	0,12 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	€ 100.000	4,88 %	03.10.2019	130.456	0,12 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 100.000	4,00 %	20.05.2019	126.808	0,11 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 100.000	2,00 %	18.06.2021	126.792	0,11 %
FCA Bank SpA	€ 100.000	2,00 %	23.10.2019	124.183	0,11 %
FCA Bank SpA	€ 100.000	1,25 %	23.09.2020	123.475	0,11 %
Intesa Sanpaolo SpA	€ 100.000	1,13 %	14.01.2020	122.577	0,11 %
Italgas SpA	€ 100.000	0,50 %	19.01.2022	120.925	0,11 %
Mediobanca SpA	€ 100.000	0,63 %	27.09.2022	119.001	0,11 %
Intesa Sanpaolo SpA	\$ 100.000	6,50 %	24.02.2021	110.147	0,10 %
Enel Finance International NV	\$ 75.000	2,88 %	25.05.2022	74.540	0,07 %
				2.011.013	1,81 %
Japan 4,83 %					
Japanische Staatsanleihe	¥ 150.000.000	0,10 %	15.09.2019	1.337.017	1,20 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	\$ 500.000	2,09 %	18.10.2019	497.629	0,45 %
Japanische Staatsanleihe	¥ 50.000.000	0,10 %	20.09.2022	448.162	0,40 %
Shinkin Central Bank	¥ 50.000.000	0,03 %	25.06.2021	442.710	0,40 %
Norinchukin Bank	¥ 40.000.000	0,28 %	26.06.2020	357.026	0,32 %
Mizuho Financial Group, Inc.	\$ 300.000	2,60 %	11.09.2022	294.862	0,27 %
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.	\$ 250.000	2,30 %	05.03.2020	249.108	0,22 %
Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.	\$ 200.000	2,65 %	19.10.2020	200.269	0,18 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 150.000	2,13 %	18.07.2019	150.048	0,14 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 150.000	2,15 %	12.03.2020	149.714	0,13 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	\$ 150.000	2,67 %	25.07.2022	148.157	0,13 %
American Honda Finance Corp.	€ 100.000	1,88 %	04.09.2019	124.096	0,11 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	€ 100.000	0,61 %	18.01.2022	120.899	0,11 %
Nomura Holdings, Inc.	\$ 100.000	6,70 %	04.03.2020	108.393	0,10 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	\$ 100.000	2,78 %	18.10.2022	99.258	0,09 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 100.000	2,15 %	13.07.2020	99.223	0,09 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 100.000	1,90 %	08.04.2021	98.369	0,09 %
American Honda Finance Corp.	\$ 100.000	1,70 %	09.09.2021	97.159	0,09 %
Toyota Credit Canada, Inc.	CAD 100.000	2,35 %	18.07.2022	79.185	0,07 %
Toyota Motor Credit Corp.	\$ 75.000	4,50 %	17.06.2020	78.937	0,07 %
American Honda Finance Corp.	\$ 75.000	1,20 %	12.07.2019	73.922	0,07 %
Mitsui Sumitomo Insurance Co., Ltd.^	\$ 50.000	7,00 %	15.03.2022	56.792	0,05 %
Dai-ichi Life Insurance Co., Ltd.^	\$ 50.000	7,25 %	25.07.2016	56.188	0,05 %
				5.367.123	4,83 %
Jersey 0,14 %					
Glencore Finance Europe Ltd.	£ 100.000	6,00 %	03.04.2022	156.559	0,14 %
				156.559	0,14 %
Mexiko 0,39 %					
America Movil SAB de CV	€ 100.000	3,00 %	12.07.2021	131.204	0,12 %
Grupo Bimbo SAB de CV	\$ 100.000	4,50 %	25.01.2022	105.474	0,09 %
America Movil SAB de CV	\$ 100.000	5,00 %	16.10.2019	104.672	0,09 %
America Movil SAB de CV	\$ 50.000	3,13 %	16.07.2022	50.528	0,05 %
Alpek SAB de CV	\$ 40.000	4,50 %	20.11.2022	41.012	0,04 %
				432.890	0,39 %
Niederlande 3,49 %					
Cooperatieve Rabobank UA	\$ 250.000	3,95 %	09.11.2022	260.355	0,24 %
ING Groep NV	€ 200.000	0,75 %	09.03.2022	243.342	0,22 %
ING Groep NV	\$ 200.000	3,15 %	29.03.2022	201.779	0,18 %
ABN AMRO Bank NV	\$ 200.000	2,45 %	04.06.2020	200.003	0,18 %
Shell International Finance BV	\$ 200.000	2,13 %	11.05.2020	199.569	0,18 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 150.000	0,13 %	11.10.2021	180.155	0,16 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Delta Lloyd Levensverzekering NV^	€ 100.000	9,00 %	29.08.2042	163.009	0,15 %
ABN AMRO Bank NV	€ 100.000	7,13 %	06.07.2022	153.430	0,14 %
Shell International Finance BV	\$ 150.000	2,38 %	21.08.2022	148.568	0,14 %
Shell International Finance BV	\$ 150.000	1,38 %	10.05.2019	148.550	0,13 %
ABN AMRO Bank NV	€ 100.000	1,00 %	30.06.2020	135.005	0,12 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 100.000	4,13 %	12.01.2021	134.744	0,12 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 100.000	3,75 %	09.11.2020	132.003	0,12 %
Cooperatieve Rabobank UA	€ 100.000	4,13 %	14.01.2020	130.270	0,12 %
Cooperatieve Rabobank UA^	€ 100.000	2,50 %	26.05.2026	127.094	0,12 %
Shell International Finance BV	€ 100.000	1,25 %	15.03.2022	125.592	0,11 %
JAB Holdings BV	€ 100.000	1,50 %	24.11.2021	125.592	0,11 %
Akzo Nobel NV	€ 100.000	4,00 %	17.12.2018	124.838	0,11 %
Heineken NV	€ 100.000	1,25 %	10.09.2021	124.466	0,11 %
NIBC Bank NV	€ 100.000	1,50 %	31.01.2022	123.509	0,11 %
ING Bank NV	€ 100.000	1,25 %	13.12.2019	123.287	0,11 %
ABN AMRO Bank NV	€ 100.000	0,75 %	09.06.2020	122.220	0,11 %
ING Bank NV	€ 100.000	0,70 %	16.04.2020	122.041	0,11 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	€ 100.000	0,38 %	25.07.2020	114.073	0,10 %
Cooperatieve Rabobank UA^	\$ 100.000	11,00 %	31.12.2166	111.750	0,10 %
Unilever Capital Corp.	\$ 100.000	2,20 %	06.03.2019	100.134	0,09 %
				3.875.378	3,49 %
Neuseeland 0,41 %					
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	\$ 200.000	2,20 %	17.07.2020	198.537	0,18 %
ASB Finance Ltd.	€ 100.000	1,00 %	07.09.2020	134.714	0,12 %
ASB Finance Ltd.	€ 100.000	0,50 %	10.06.2022	120.261	0,11 %
				453.512	0,41 %
Norwegen 0,58 %					
DNB Bank A.S.A	\$ 200.000	2,13 %	02.10.2020	198.286	0,18 %
SpareBank 1 SR-Bank A.S.A.	€ 150.000	2,13 %	14.04.2021	191.036	0,17 %
DNB Bank A.S.A.	€ 100.000	3,88 %	29.06.2020	131.675	0,12 %
SpareBank 1 SMN	€ 100.000	0,75 %	08.06.2021	121.909	0,11 %
				642.906	0,58 %
Peru 0,19 %					
Banco de Credito del Peru	\$ 200.000	5,38 %	16.09.2020	213.016	0,19 %
				213.016	0,19 %
Portugal 0,17 %					
EDP Finance BV	€ 150.000	2,63 %	15.04.2019	186.225	0,17 %
				186.225	0,17 %
Katar 0,18 %					
CBQ Finance Ltd.	\$ 200.000	3,25 %	13.06.2021	197.000	0,18 %
				197.000	0,18 %
Russische Föderation 0,08 %					
MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC	\$ 75.000	6,63 %	14.10.2022	84.469	0,08 %
				84.469	0,08 %
Singapur 0,18 %					
United Overseas Bank Ltd.^	\$ 200.000	3,50 %	16.09.2026	201.508	0,18 %
				201.508	0,18 %
Südkorea 0,45 %					
Shinhan Bank Co., Ltd.	\$ 200.000	2,25 %	15.04.2020	196.758	0,18 %
Hyundai Capital America	\$ 100.000	2,55 %	06.02.2019	99.824	0,09 %
Hyundai Capital America	\$ 100.000	3,10 %	05.04.2022	99.622	0,09 %
POSCO	\$ 50.000	4,25 %	28.10.2020	51.519	0,05 %
KT Corp.	\$ 50.000	2,63 %	07.08.2022	48.770	0,04 %
				496.493	0,45 %
Spanien 1,51 %					
Gas Natural Fenosa Finance BV	€ 100.000	3,88 %	11.04.2022	137.987	0,12 %
Iberdrola International BV	€ 100.000	3,50 %	01.02.2021	132.472	0,12 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 100.000	4,69 %	11.11.2019	130.640	0,12 %
Repsol International Finance BV	€ 100.000	2,63 %	28.05.2020	127.231	0,11 %
Santander International Debt SA	€ 100.000	1,38 %	03.03.2021	124.519	0,11 %
Criteria Caixa SAU	€ 100.000	2,38 %	09.05.2019	123.534	0,11 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Santander Consumer Finance SA	€ 100.000	1,00 %	26.05.2021	122.721	0,11 %
Santander Consumer Finance SA	€ 100.000	0,90 %	18.02.2020	122.079	0,11 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 100.000	0,75 %	13.04.2022	121.662	0,11 %
NorteGas Energia Distribucion SAU	€ 100.000	0,92 %	28.09.2022	120.728	0,11 %
Telefonica Emisiones SAU	€ 100.000	0,32 %	17.10.2020	120.687	0,11 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	€ 100.000	0,75 %	11.09.2022	120.196	0,11 %
Gas Natural Capital Markets SA	€ 50.000	6,38 %	09.07.2019	65.891	0,06 %
Telefonica Emisiones SAU	\$ 50.000	5,46 %	16.02.2021	54.080	0,05 %
Telefonica Emisiones SAU	\$ 50.000	5,88 %	15.07.2019	52.556	0,05 %
				1.676.983	1,51 %
Schweden 2,12 %					
Skandinaviska Enskilda Banken AB	\$ 250.000	2,30 %	11.03.2020	249.419	0,23 %
Svenska Handelsbanken AB	\$ 250.000	1,50 %	06.09.2019	246.920	0,22 %
Swedbank AB	\$ 200.000	2,20 %	04.03.2020	199.310	0,18 %
Nordea Bank AB	\$ 200.000	2,13 %	29.05.2020	198.771	0,18 %
Svenska Handelsbanken AB	€ 150.000	0,25 %	28.02.2022	180.044	0,16 %
Svenska Handelsbanken AB	£ 100.000	3,00 %	20.11.2020	142.577	0,13 %
Nordea Bank AB	€ 100.000	4,00 %	29.03.2021	134.314	0,12 %
Akelius Residential Property AB	€ 100.000	3,38 %	23.09.2020	129.689	0,12 %
Volvo Treasury AB^	€ 100.000	4,20 %	10.06.2075	129.040	0,12 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB^	€ 100.000	2,50 %	28.05.2026	127.238	0,11 %
Nordea Bank AB	€ 100.000	2,00 %	17.02.2021	127.220	0,11 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	€ 100.000	1,88 %	14.11.2019	124.635	0,11 %
Fastighets AB Balder	€ 100.000	1,13 %	14.03.2022	121.200	0,11 %
Essity AB	€ 100.000	0,50 %	05.03.2020	121.090	0,11 %
Swedbank AB	€ 100.000	0,30 %	06.09.2022	119.702	0,11 %
				2.351.169	2,12 %
Schweiz 2,04 %					
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	\$ 300.000	3,13 %	10.12.2020	303.412	0,27 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	\$ 250.000	3,80 %	15.09.2022	257.539	0,23 %
UBS AG	\$ 200.000	2,45 %	01.12.2020	199.279	0,18 %
Roche Holdings, Inc.	€ 100.000	6,50 %	04.03.2021	144.697	0,13 %
Cloverie plc zur Zurich Insurance Co., Ltd.^	€ 100.000	7,50 %	24.07.2039	133.478	0,12 %
ABB Finance BV	€ 100.000	2,63 %	26.03.2019	123.992	0,11 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	€ 100.000	1,25 %	14.04.2022	123.867	0,11 %
Credit Suisse AG	€ 100.000	1,13 %	15.09.2020	123.456	0,11 %
Credit Suisse AG	€ 100.000	1,38 %	29.11.2019	123.406	0,11 %
Nestle Finance International Ltd.	€ 100.000	1,50 %	19.07.2019	123.373	0,11 %
UBS AG	€ 100.000	1,13 %	30.06.2020	123.328	0,11 %
Glencore Finance Europe Ltd.	€ 100.000	1,25 %	17.03.2021	122.890	0,11 %
Novartis Finance SA	€ 100.000	0,00 %	31.03.2021	119.728	0,11 %
Novartis Securities Investment Ltd.	\$ 100.000	5,13 %	10.02.2019	103.208	0,09 %
Glencore Finance Canada Ltd.	\$ 50.000	4,25 %	25.10.2022	52.313	0,05 %
Glencore Funding LLC	\$ 50.000	3,13 %	29.04.2019	50.375	0,05 %
ABB Finance USA, Inc.	\$ 40.000	2,88 %	08.05.2022	40.672	0,04 %
				2.269.013	2,04 %
Türkei 0,04 %					
Turk Telekomunikasyon A.S.	\$ 50.000	3,75 %	19.06.2019	50.312	0,04 %
				50.312	0,04 %
Vereinigte Arabische Emirate 0,18 %					
DIB Sukuk Ltd.	\$ 200.000	3,66 %	14.02.2022	201.768	0,18 %
				201.768	0,18 %
Vereinigtes Königreich 7,26 %					
BP Capital Markets plc	€ 200.000	2,99 %	18.02.2019	248.598	0,22 %
HSBC Holdings plc	\$ 200.000	4,88 %	14.01.2022	215.043	0,19 %
HSBC Holdings plc^	\$ 200.000	3,26 %	13.03.2023	202.545	0,18 %
HSBC Holdings plc	\$ 200.000	2,95 %	25.05.2021	201.319	0,18 %
Santander UK Group Holdings plc	\$ 200.000	2,88 %	16.10.2020	200.774	0,18 %
Lloyds Banking Group plc	\$ 200.000	3,00 %	11.01.2022	200.567	0,18 %
Barclays plc	\$ 200.000	2,88 %	08.06.2020	200.565	0,18 %
United Kingdom Gilt	£ 137.000	2,00 %	07.09.2025	198.917	0,18 %
BAT Capital Corp.	\$ 200.000	2,30 %	14.08.2020	198.831	0,18 %
Standard Chartered plc	\$ 200.000	2,25 %	17.04.2020	198.280	0,18 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
HSBC Holdings plc	€ 150.000	1,50 %	15.03.2022	188.677	0,17 %
Bank of Scotland plc	£ 100.000	9,38 %	15.05.2021	168.514	0,15 %
Coventry Building Society	£ 100.000	5,88 %	28.09.2022	161.546	0,15 %
BP Capital Markets plc	\$ 150.000	4,74 %	11.03.2021	160.552	0,15 %
Aviva plc^	£ 100.000	6,63 %	03.06.2041	154.656	0,14 %
BP Capital Markets plc	\$ 150.000	1,68 %	03.05.2019	149.239	0,13 %
BAT Capital Corp.	\$ 150.000	2,76 %	15.08.2022	149.156	0,13 %
Heathrow Funding Ltd.	£ 100.000	6,00 %	20.03.2020	148.985	0,13 %
BAT International Finance plc	£ 100.000	6,38 %	12.12.2019	148.878	0,13 %
Phoenix Group Holdings	£ 100.000	4,13 %	20.07.2022	144.205	0,13 %
Sky plc	£ 100.000	2,88 %	24.11.2020	141.642	0,13 %
Nationwide Building Society	€ 100.000	6,75 %	22.07.2020	139.406	0,13 %
Cadent Finance plc	£ 100.000	1,13 %	22.09.2021	134.431	0,12 %
Royal Bank of Scotland plc	€ 100.000	5,38 %	30.09.2019	131.386	0,12 %
Lloyds Bank plc	€ 100.000	5,38 %	03.09.2019	131.184	0,12 %
Standard Chartered plc^	€ 100.000	4,00 %	21.10.2025	130.896	0,12 %
Barclays Bank plc	€ 100.000	4,88 %	13.08.2019	129.895	0,12 %
BP Capital Markets plc	€ 100.000	2,52 %	17.02.2021	129.277	0,12 %
Leeds Building Society	€ 100.000	2,63 %	01.04.2021	128.226	0,12 %
Coventry Building Society	€ 100.000	2,50 %	18.11.2020	127.958	0,12 %
Rolls-Royce plc	€ 100.000	2,13 %	18.06.2021	127.840	0,12 %
Heathrow Funding Ltd.	€ 100.000	1,88 %	23.05.2022	127.696	0,12 %
Santander UK plc	€ 100.000	2,63 %	16.07.2020	127.674	0,12 %
BG Energy Capital plc	€ 100.000	3,63 %	16.07.2019	126.991	0,11 %
Royal Bank of Scotland Group plc^	€ 100.000	2,00 %	08.03.2023	126.140	0,11 %
Barclays plc	€ 100.000	1,88 %	23.03.2021	125.729	0,11 %
Hammerson plc	€ 100.000	2,75 %	26.09.2019	125.695	0,11 %
BP Capital Markets plc	\$ 125.000	2,32 %	13.02.2020	125.348	0,11 %
Sky plc	€ 100.000	1,50 %	15.09.2021	125.343	0,11 %
FCE Bank plc	€ 100.000	1,66 %	11.02.2021	125.146	0,11 %
Anglo American Capital plc	€ 100.000	2,75 %	07.06.2019	124.643	0,11 %
Vodafone Group plc	€ 100.000	1,00 %	11.09.2020	122.657	0,11 %
BAT International Finance plc	€ 100.000	1,00 %	23.05.2022	122.640	0,11 %
British Telecommunications plc	€ 100.000	1,13 %	10.06.2019	122.092	0,11 %
Barclays Bank plc	\$ 100.000	10,18 %	12.06.2021	121.640	0,11 %
Unilever NV	€ 100.000	0,00 %	29.04.2020	120.248	0,11 %
Vodafone Group plc	€ 100.000	0,38 %	22.11.2021	120.176	0,11 %
GlaxoSmithKline Capital plc	€ 100.000	0,00 %	12.09.2020	119.869	0,11 %
Royal Bank of Scotland plc	\$ 100.000	5,63 %	24.08.2020	107.012	0,10 %
HSBC Bank plc	\$ 100.000	4,13 %	12.08.2020	104.131	0,09 %
Anglo American Capital plc	\$ 100.000	4,13 %	15.04.2021	102.875	0,09 %
BP Capital Markets plc	\$ 100.000	3,06 %	17.03.2022	102.049	0,09 %
Anglian Water Services Financing plc	£ 50.000	5,84 %	30.07.2022	81.043	0,07 %
RELX Capital, Inc.	\$ 75.000	8,63 %	15.01.2019	79.694	0,07 %
Nationwide Building Society	£ 50.000	5,63 %	09.09.2019	72.902	0,07 %
WPP Finance 2010	\$ 50.000	4,75 %	21.11.2021	53.421	0,05 %
Vodafone Group plc	\$ 50.000	5,45 %	10.06.2019	52.195	0,05 %
Sky plc	\$ 50.000	3,13 %	26.11.2022	50.395	0,05 %
Trinity Acquisition plc	\$ 25.000	3,50 %	15.09.2021	25.255	0,02 %
Vodafone Group plc	\$ 25.000	2,50 %	26.09.2022	24.796	0,02 %
				8.057.483	7,26 %
USA 47,45 %					
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 800.000	2,63 %	31.01.2019	803.166	0,72 %
Morgan Stanley	\$ 500.000	5,75 %	25.01.2021	544.473	0,49 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 500.000	4,50 %	24.01.2022	533.729	0,48 %
Bank of America Corp.^	\$ 524.014	3,00 %	20.12.2023	524.351	0,47 %
PNC Bank NA	\$ 500.000	2,00 %	19.05.2020	495.869	0,45 %
Morgan Stanley	\$ 400.000	2,45 %	01.02.2019	400.786	0,36 %
Citigroup, Inc.	\$ 400.000	2,75 %	25.04.2022	398.022	0,36 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 400.000	2,30 %	15.08.2021	396.462	0,36 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 350.000	2,65 %	01.02.2021	351.701	0,32 %
Capital One Na	\$ 350.000	2,40 %	05.09.2019	350.087	0,32 %
US Treasury Note	\$ 335.000	1,75 %	30.11.2019	334.163	0,30 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 300.000	3,20 %	15.01.2021	304.232	0,27 %
Newell Brands Inc.	\$ 300.000	3,15 %	01.04.2021	303.369	0,27 %
Bank of America Corp.	\$ 300.000	2,25 %	21.04.2020	299.936	0,27 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	\$ 300.000	2,34 %	15.11.2020	298.783	0,27 %
Daimler Finance North America LLC	\$ 300.000	2,20 %	05.05.2020	298.308	0,27 %
Wells Fargo & Co.	\$ 300.000	2,63 %	22.07.2022	298.248	0,27 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 300.000	2,91 %	24.07.2023	297.374	0,27 %
Morgan Stanley	\$ 275.000	4,88 %	01.11.2022	295.670	0,27 %
Abbott Laboratories	\$ 275.000	5,13 %	01.04.2019	284.663	0,26 %
Citigroup, Inc.	\$ 275.000	2,50 %	29.07.2019	275.615	0,25 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	\$ 275.000	2,15 %	01.02.2019	275.048	0,25 %
Citigroup, Inc.	\$ 275.000	2,40 %	18.02.2020	274.437	0,25 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 250.000	5,88 %	02.08.2021	273.847	0,25 %
JPMorgan Chase & Co.	\$ 250.000	6,30 %	23.04.2019	263.198	0,24 %
Medtronic, Inc.	\$ 250.000	3,15 %	15.03.2022	256.086	0,23 %
Synchrony Financial	\$ 250.000	3,75 %	15.08.2021	256.002	0,23 %
US Bancorp	\$ 250.000	3,00 %	15.03.2022	254.936	0,23 %
American Express Credit Corp.	\$ 250.000	2,60 %	14.09.2020	251.040	0,23 %
Wells Fargo & Co.	\$ 250.000	2,55 %	07.12.2020	250.919	0,23 %
HCP, Inc.	\$ 250.000	2,63 %	01.02.2020	250.682	0,23 %
Metropolitan Life Global Funding I	\$ 250.000	2,30 %	10.04.2019	250.454	0,23 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 250.000	2,60 %	23.04.2020	250.272	0,23 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	\$ 250.000	2,50 %	15.07.2022	247.829	0,22 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 250.000	1,95 %	15.10.2020	247.715	0,22 %
KeyBank NA	\$ 250.000	2,30 %	14.09.2022	244.830	0,22 %
Bank of America Corp.	\$ 230.000	2,60 %	15.01.2019	230.902	0,21 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 225.000	2,13 %	01.03.2019	225.465	0,20 %
HSBC USA, Inc.	\$ 225.000	2,35 %	05.03.2020	224.907	0,20 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 220.000	3,45 %	10.04.2022	222.855	0,20 %
Bank of America Corp.	\$ 196.000	5,70 %	24.01.2022	219.158	0,20 %
Goldman Sachs Group, Inc.	\$ 200.000	5,25 %	27.07.2021	216.786	0,20 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 200.000	3,90 %	15.02.2022	207.116	0,19 %
Constellation Brands, Inc.	\$ 200.000	3,88 %	15.11.2019	205.449	0,18 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 200.000	3,25 %	01.09.2022	205.095	0,18 %
Perrigo Finance Unlimited Co.	\$ 200.000	3,50 %	15.12.2021	203.437	0,18 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	\$ 200.000	3,38 %	01.02.2022	203.204	0,18 %
PepsiCo, Inc.	\$ 200.000	2,75 %	05.03.2022	202.404	0,18 %
Schlumberger Holdings Corp.	\$ 200.000	3,00 %	21.12.2020	202.331	0,18 %
Abbott Laboratories	\$ 200.000	2,90 %	30.11.2021	202.104	0,18 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 200.000	2,95 %	15.03.2022	201.186	0,18 %
Medtronic, Inc.	\$ 200.000	2,50 %	15.03.2020	201.069	0,18 %
MassMutual Global Funding II	\$ 200.000	2,35 %	09.04.2019	200.586	0,18 %
AbbVie, Inc.	\$ 200.000	2,50 %	14.05.2020	200.459	0,18 %
Oracle Corp.	\$ 200.000	2,50 %	15.05.2022	200.123	0,18 %
Wells Fargo & Co.	\$ 200.000	2,13 %	22.04.2019	199.950	0,18 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 200.000	3,15 %	30.06.2022	199.732	0,18 %
Apple, Inc.	\$ 200.000	2,25 %	23.02.2021	199.728	0,18 %
Aviation Capital Group LLC	\$ 200.000	2,88 %	20.01.2022	199.622	0,18 %
Molson Coors Brewing Co.	\$ 200.000	2,25 %	15.03.2020	199.022	0,18 %
Ford Motor Credit Co. LLC	\$ 200.000	1,90 %	12.08.2019	198.097	0,18 %
Fifth Third Bank	\$ 200.000	1,63 %	27.09.2019	197.738	0,18 %
New York Life Global Funding	\$ 200.000	2,00 %	13.04.2021	196.840	0,18 %
Cisco Systems, Inc.	\$ 200.000	1,85 %	20.09.2021	196.288	0,18 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 150.000	1,38 %	26.07.2022	186.812	0,17 %
Energy Transfer LP	\$ 175.000	5,20 %	01.02.2022	186.520	0,17 %
Bank of America Corp.^	€ 150.000	0,74 %	07.02.2022	182.850	0,16 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 175.000	3,48 %	01.06.2019	177.192	0,16 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 175.000	2,50 %	15.04.2021	175.415	0,16 %
Chevron Corp.	\$ 175.000	2,19 %	15.11.2019	175.317	0,16 %
AT&T, Inc.	\$ 175.000	2,45 %	30.06.2020	174.836	0,16 %
Bank of America Corp.^	\$ 175.000	2,82 %	21.07.2023	174.656	0,16 %
Kimberly-Clark Corp.	\$ 175.000	1,90 %	22.05.2019	174.383	0,16 %
Apple, Inc.	\$ 175.000	2,30 %	11.05.2022	173.528	0,16 %
Ford Credit Canada Co.	CAD 200.000	2,58 %	10.05.2021	158.332	0,14 %
Apple, Inc.	AUD 200.000	2,65 %	10.06.2020	156.773	0,14 %
Duke Energy Corp.	\$ 150.000	5,05 %	15.09.2019	156.416	0,14 %
CNH Industrial Capital LLC	\$ 150.000	4,38 %	05.04.2022	155.437	0,14 %
Williams Partners LP	\$ 150.000	4,00 %	15.11.2021	155.130	0,14 %
Coca-Cola Co.	\$ 150.000	3,30 %	01.09.2021	154.730	0,14 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Fluor Corp.	\$ 150.000	3,38 %	15.09.2021	153.248	0,14 %
Bunge Ltd. Finance Corp.	\$ 150.000	3,50 %	24.11.2020	152.857	0,14 %
Corporate Office Properties LP	\$ 150.000	3,70 %	15.06.2021	152.652	0,14 %
American International Group, Inc.	\$ 150.000	3,30 %	01.03.2021	152.530	0,14 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	\$ 150.000	2,90 %	15.10.2020	152.496	0,14 %
Celgene Corp.	\$ 150.000	2,88 %	15.08.2020	151.380	0,14 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	\$ 150.000	2,70 %	18.11.2019	150.947	0,14 %
Oracle Corp.	\$ 150.000	2,25 %	08.10.2019	150.611	0,14 %
AT&T, Inc.	\$ 150.000	3,00 %	30.06.2022	150.221	0,14 %
AT&T, Inc.	\$ 150.000	2,30 %	11.03.2019	150.027	0,14 %
Apple, Inc.	\$ 150.000	1,90 %	07.02.2020	149.299	0,13 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 150.000	2,00 %	21.02.2020	148.946	0,13 %
Apple, Inc.	\$ 150.000	1,50 %	12.09.2019	148.750	0,13 %
Microsoft Corp.	\$ 150.000	1,85 %	06.02.2020	148.450	0,13 %
Microsoft Corp.	\$ 150.000	1,10 %	08.08.2019	147.950	0,13 %
BB&T Corp.	\$ 150.000	2,05 %	10.05.2021	147.877	0,13 %
Bank of America Corp.	£ 100.000	5,50 %	04.12.2019	146.729	0,13 %
Microsoft Corp.	\$ 150.000	1,55 %	08.08.2021	146.062	0,13 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 140.000	1,90 %	15.12.2020	139.084	0,13 %
Goldman Sachs Group, Inc.	€ 100.000	4,75 %	12.10.2021	137.864	0,12 %
Morgan Stanley	€ 100.000	5,38 %	10.08.2020	136.508	0,12 %
Nasdaq, Inc.	€ 100.000	3,88 %	07.06.2021	134.261	0,12 %
AT&T, Inc.	\$ 125.000	5,00 %	01.03.2021	133.828	0,12 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	\$ 125.000	5,63 %	01.02.2021	133.594	0,12 %
Tyson Foods, Inc.	\$ 125.000	4,50 %	15.06.2022	133.428	0,12 %
General Electric Co.	\$ 125.000	5,50 %	08.01.2020	132.678	0,12 %
Wells Fargo & Co.	€ 100.000	2,63 %	16.08.2022	132.066	0,12 %
HP, Inc.	\$ 125.000	4,38 %	15.09.2021	131.623	0,12 %
Dell International LLC/EMC Corp.	\$ 125.000	4,42 %	15.06.2021	130.252	0,12 %
Citigroup, Inc.	€ 100.000	5,00 %	02.08.2019	129.758	0,12 %
Microsoft Corp.	€ 100.000	2,13 %	06.12.2021	129.006	0,12 %
Anthem, Inc.	\$ 125.000	3,70 %	15.08.2021	128.821	0,12 %
Wal-Mart Stores, Inc.	€ 100.000	1,90 %	08.04.2022	128.574	0,12 %
Discovery Communications LLC	€ 100.000	2,38 %	07.03.2022	128.149	0,12 %
Illinois Tool Works, Inc.	€ 100.000	1,75 %	20.05.2022	127.369	0,11 %
Oracle Corp.	\$ 125.000	2,80 %	08.07.2021	127.121	0,11 %
Wells Fargo & Co.	€ 100.000	2,25 %	03.09.2020	127.013	0,11 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	€ 100.000	2,25 %	20.07.2020	126.731	0,11 %
Dover Corp.	€ 100.000	2,13 %	01.12.2020	126.678	0,11 %
Roper Technologies, Inc.	\$ 125.000	3,00 %	15.12.2020	126.449	0,11 %
Allergan Funding SCS	\$ 125.000	3,00 %	12.03.2020	125.944	0,11 %
GE Capital European Funding Unlimited Co.	€ 100.000	2,88 %	18.06.2019	125.347	0,11 %
Actavis, Inc.	\$ 125.000	3,25 %	01.10.2022	125.189	0,11 %
Citigroup, Inc.	€ 100.000	1,38 %	27.10.2021	125.067	0,11 %
Microsoft Corp.	\$ 125.000	2,40 %	06.02.2022	124.976	0,11 %
AT&T, Inc.	€ 100.000	1,45 %	01.06.2022	124.800	0,11 %
PepsiCo, Inc.	\$ 125.000	2,15 %	14.10.2020	124.734	0,11 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 125.000	2,65 %	17.04.2020	124.697	0,11 %
Morgan Stanley	\$ 125.000	2,50 %	21.04.2021	124.635	0,11 %
JPMorgan Chase & Co.	€ 100.000	1,88 %	21.11.2019	124.613	0,11 %
Amgen, Inc.	€ 100.000	2,13 %	13.09.2019	124.539	0,11 %
Prologis LP	€ 100.000	1,38 %	13.05.2021	124.354	0,11 %
Amgen, Inc.	\$ 125.000	2,13 %	01.05.2020	124.312	0,11 %
General Motors Financial International BV	€ 100.000	1,88 %	15.10.2019	124.005	0,11 %
Hyundai Capital America	\$ 125.000	2,75 %	18.09.2020	124.000	0,11 %
Procter & Gamble Co.	\$ 125.000	2,15 %	11.08.2022	123.619	0,11 %
Philip Morris International, Inc.	€ 100.000	2,13 %	30.05.2019	123.616	0,11 %
Toyota Motor Credit Corp.	€ 100.000	1,00 %	09.03.2021	123.380	0,11 %
Johnson & Johnson	\$ 125.000	1,65 %	01.03.2021	123.081	0,11 %
John Deere Capital Corp.	\$ 125.000	1,25 %	09.10.2019	123.052	0,11 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	\$ 125.000	2,40 %	23.09.2021	122.835	0,11 %
CVS Health Corp.	\$ 125.000	2,13 %	01.06.2021	122.119	0,11 %
Southern Power Co.	€ 100.000	1,00 %	20.06.2022	122.105	0,11 %
DH Europe Finance SA	€ 100.000	1,00 %	08.07.2019	121.681	0,11 %
Priceline Group, Inc.	€ 100.000	0,80 %	10.03.2022	121.532	0,11 %
International Business Machines Corp.	€ 100.000	0,50 %	07.09.2021	121.488	0,11 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Berkshire Hathaway, Inc.	€ 100.000	0,50 %	13.03.2020	121.289	0,11 %
McDonald's Corp.	€ 100.000	0,50 %	15.01.2021	121.042	0,11 %
AbbVie, Inc.	€ 100.000	0,38 %	18.11.2019	120.803	0,11 %
Berkshire Hathaway, Inc.	€ 100.000	0,25 %	17.01.2021	120.569	0,11 %
International Lease Finance Corp.	\$ 100.000	8,63 %	15.01.2022	120.500	0,11 %
Verizon Communications, Inc.	€ 100.000	0,50 %	02.06.2022	120.235	0,11 %
Pfizer, Inc.	€ 100.000	0,25 %	06.03.2022	120.082	0,11 %
General Electric Co.	€ 100.000	0,38 %	17.05.2022	119.912	0,11 %
Fidelity National Information Services, Inc.	€ 100.000	0,40 %	15.01.2021	119.851	0,11 %
Coca-Cola Co.	€ 100.000	0,00 %	09.03.2021	119.764	0,11 %
Norfolk Southern Railway Co.	\$ 100.000	9,75 %	15.06.2020	116.657	0,11 %
Jefferies Group LLC	\$ 100.000	6,88 %	15.04.2021	111.785	0,10 %
International Lease Finance Corp.	\$ 100.000	5,88 %	15.08.2022	110.625	0,10 %
Prudential Financial, Inc.^	\$ 100.000	5,88 %	15.09.2042	109.322	0,10 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 100.000	5,80 %	01.03.2021	108.397	0,10 %
Prudential Financial, Inc.	\$ 100.000	7,38 %	15.06.2019	107.339	0,10 %
Digital Realty Trust LP	\$ 100.000	5,25 %	15.03.2021	107.271	0,10 %
Altria Group, Inc.	\$ 100.000	4,75 %	05.05.2021	107.146	0,10 %
Time Warner Cable LLC	\$ 100.000	8,75 %	14.02.2019	106.770	0,10 %
Hospitality Properties Trust	\$ 100.000	5,00 %	15.08.2022	106.670	0,10 %
Hartford Financial Services Group, Inc.	\$ 100.000	5,50 %	30.03.2020	106.409	0,10 %
Home Depot, Inc.	\$ 100.000	4,40 %	01.04.2021	105.964	0,10 %
BlackRock, Inc.	\$ 100.000	4,25 %	24.05.2021	105.539	0,09 %
Enterprise Products Operating LLC	\$ 100.000	5,25 %	31.01.2020	105.270	0,09 %
Enbridge Energy Partners LP	\$ 100.000	4,38 %	15.10.2020	104.325	0,09 %
Target Corp.	\$ 100.000	3,88 %	15.07.2020	104.183	0,09 %
Lowe's Cos, Inc.	\$ 100.000	3,75 %	15.04.2021	103.707	0,09 %
Amgen, Inc.	\$ 100.000	3,63 %	15.05.2022	103.430	0,09 %
Constellation Brands, Inc.	\$ 100.000	3,75 %	01.05.2021	103.399	0,09 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 100.000	3,45 %	15.09.2021	102.961	0,09 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 100.000	3,50 %	01.11.2021	102.908	0,09 %
Simon Property Group LP	\$ 100.000	3,38 %	15.03.2022	102.682	0,09 %
Western Union Co.	\$ 100.000	3,60 %	15.03.2022	102.528	0,09 %
Illinois Tool Works, Inc.	\$ 100.000	3,38 %	15.09.2021	102.520	0,09 %
Zoetis, Inc.	\$ 100.000	3,45 %	13.11.2020	102.274	0,09 %
Marathon Petroleum Corp.	\$ 100.000	3,40 %	15.12.2020	102.174	0,09 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 100.000	3,60 %	15.10.2020	102.101	0,09 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 100.000	3,58 %	23.07.2020	101.811	0,09 %
American Tower Corp.	\$ 100.000	3,30 %	15.02.2021	101.706	0,09 %
Express Scripts Holding Co.	\$ 100.000	3,30 %	25.02.2021	101.539	0,09 %
Delta Air Lines, Inc.	\$ 100.000	3,63 %	15.03.2022	101.479	0,09 %
Biogen, Inc.	\$ 100.000	2,90 %	15.09.2020	101.405	0,09 %
DDR Corp.	\$ 100.000	3,50 %	15.01.2021	101.396	0,09 %
TD Ameritrade Holding Corp.	\$ 100.000	2,95 %	01.04.2022	100.950	0,09 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 100.000	2,55 %	01.09.2020	100.875	0,09 %
Verizon Communications, Inc.	\$ 100.000	2,63 %	21.02.2020	100.778	0,09 %
Lockheed Martin Corp.	\$ 100.000	2,50 %	23.11.2020	100.753	0,09 %
Marriott International, Inc.	\$ 100.000	3,00 %	01.03.2019	100.597	0,09 %
John Deere Capital Corp.	\$ 100.000	2,65 %	06.01.2022	100.551	0,09 %
Altria Group, Inc.	\$ 100.000	2,85 %	09.08.2022	100.537	0,09 %
Tyson Foods, Inc.	\$ 100.000	2,65 %	15.08.2019	100.530	0,09 %
Home Depot, Inc.	\$ 100.000	2,63 %	01.06.2022	100.498	0,09 %
Delta Air Lines, Inc.	\$ 100.000	2,88 %	13.03.2020	100.498	0,09 %
CVS Health Corp.	\$ 100.000	2,80 %	20.07.2020	100.418	0,09 %
VEREIT Operating Partnership LP	\$ 100.000	3,00 %	06.02.2019	100.375	0,09 %
American Express Credit Corp.	\$ 100.000	2,70 %	03.03.2022	100.333	0,09 %
AbbVie, Inc.	\$ 100.000	2,90 %	06.11.2022	100.291	0,09 %
EOG Resources, Inc.	\$ 100.000	2,45 %	01.04.2020	100.174	0,09 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	\$ 100.000	2,70 %	01.04.2020	100.152	0,09 %
BB&T Corp.	\$ 100.000	2,25 %	01.02.2019	100.114	0,09 %
McDonald's Corp.	\$ 100.000	2,10 %	07.12.2018	100.070	0,09 %
Gilead Sciences, Inc.	\$ 100.000	2,05 %	01.04.2019	100.007	0,09 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 100.000	2,58 %	01.07.2020	99.952	0,09 %
Visa, Inc.	\$ 100.000	2,20 %	14.12.2020	99.946	0,09 %
FedEx Corp.	\$ 100.000	2,30 %	01.02.2020	99.921	0,09 %
Simon Property Group LP	\$ 100.000	2,50 %	15.07.2021	99.917	0,09 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Reliance Standard Life Global Funding II	\$ 100.000	2,50 %	15.01.2020	99.903	0,09 %
Mylan, Inc.	\$ 100.000	2,55 %	28.03.2019	99.898	0,09 %
John Deere Capital Corp.	\$ 100.000	1,95 %	08.01.2019	99.817	0,09 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	\$ 100.000	2,35 %	06.03.2020	99.790	0,09 %
Merck & Co., Inc.	\$ 100.000	2,35 %	10.02.2022	99.786	0,09 %
Amgen, Inc.	\$ 100.000	1,90 %	10.05.2019	99.783	0,09 %
Bank of New York Mellon Corp.	\$ 100.000	2,15 %	24.02.2020	99.751	0,09 %
SunTrust Banks, Inc.	\$ 100.000	2,70 %	27.01.2022	99.723	0,09 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 100.000	1,82 %	15.03.2019	99.721	0,09 %
Citigroup, Inc.	\$ 100.000	2,05 %	07.06.2019	99.701	0,09 %
Chevron Corp.	\$ 100.000	1,69 %	28.02.2019	99.662	0,09 %
McDonald's Corp.	\$ 100.000	1,88 %	29.05.2019	99.658	0,09 %
Wal-Mart Stores, Inc.	\$ 100.000	1,75 %	09.10.2019	99.648	0,09 %
American Express Credit Corp.	\$ 100.000	1,88 %	03.05.2019	99.635	0,09 %
Santander Holdings USA, Inc.	\$ 100.000	3,40 %	18.01.2023	99.608	0,09 %
Discovery Communications LLC	\$ 100.000	2,20 %	20.09.2019	99.543	0,09 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	\$ 100.000	2,00 %	27.01.2020	99.539	0,09 %
Exxon Mobil Corp.	\$ 100.000	1,91 %	06.03.2020	99.538	0,09 %
United Parcel Service, Inc.	\$ 100.000	2,35 %	16.05.2022	99.485	0,09 %
Intel Corp.	\$ 100.000	1,85 %	11.05.2020	99.430	0,09 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 100.000	2,40 %	05.06.2020	99.428	0,09 %
Georgia Power Co.	\$ 100.000	2,00 %	08.09.2020	99.406	0,09 %
Intel Corp.	\$ 100.000	2,35 %	11.05.2022	99.405	0,09 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 100.000	2,38 %	15.01.2020	99.402	0,09 %
IBM Credit LLC	\$ 100.000	1,63 %	06.09.2019	99.330	0,09 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 100.000	3,00 %	15.01.2022	99.305	0,09 %
Amazon.com, Inc.	\$ 100.000	1,90 %	21.08.2020	99.289	0,09 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	\$ 100.000	1,90 %	23.09.2019	99.128	0,09 %
Novartis Capital Corp.	\$ 100.000	1,80 %	14.02.2020	99.037	0,09 %
UnitedHealth Group, Inc.	\$ 100.000	2,38 %	15.10.2022	99.033	0,09 %
United Technologies Corp.	\$ 100.000	1,90 %	04.05.2020	98.984	0,09 %
Athene Global Funding	\$ 100.000	3,00 %	01.07.2022	98.943	0,09 %
Pfizer, Inc.	\$ 100.000	1,95 %	03.06.2021	98.905	0,09 %
PepsiCo, Inc.	\$ 100.000	1,35 %	04.10.2019	98.761	0,09 %
Philip Morris International, Inc.	\$ 100.000	2,38 %	17.08.2022	98.490	0,09 %
IBM Credit LLC	\$ 100.000	1,80 %	20.01.2021	98.407	0,09 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 100.000	1,85 %	04.09.2020	98.384	0,09 %
Crown Castle International Corp.	\$ 100.000	2,25 %	01.09.2021	98.286	0,09 %
Bristol-Myers Squibb Co.	\$ 100.000	2,00 %	01.08.2022	97.787	0,09 %
AIG Global Funding	\$ 100.000	1,90 %	06.10.2021	97.176	0,09 %
Duke Energy Corp.	\$ 100.000	1,80 %	01.09.2021	97.036	0,09 %
Branch Banking & Trust Co.	\$ 85.000	2,25 %	01.06.2020	84.904	0,08 %
Puget Energy, Inc.	\$ 75.000	6,00 %	01.09.2021	83.032	0,07 %
Wells Fargo Canada Corp.	CAD 100.000	3,04 %	29.01.2021	81.381	0,07 %
Energy Transfer LP	\$ 75.000	9,70 %	15.03.2019	81.196	0,07 %
Morgan Stanley	CAD 100.000	3,13 %	05.08.2021	81.054	0,07 %
Liberty Mutual Group, Inc.	\$ 75.000	4,95 %	01.05.2022	80.940	0,07 %
Air Lease Corp.	\$ 80.000	3,38 %	15.01.2019	80.723	0,07 %
CF Industries, Inc.	\$ 80.000	3,40 %	01.12.2021	80.393	0,07 %
General Electric Co.	\$ 75.000	4,65 %	17.10.2021	80.358	0,07 %
Anadarko Petroleum Corp.	\$ 75.000	8,70 %	15.03.2019	80.354	0,07 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 75.000	9,00 %	01.02.2019	79.947	0,07 %
NBCUniversal Media LLC	\$ 75.000	5,15 %	30.04.2020	79.724	0,07 %
NBCUniversal Media LLC	\$ 75.000	4,38 %	01.04.2021	79.367	0,07 %
General Electric Co.	\$ 75.000	6,00 %	07.08.2019	79.290	0,07 %
Entergy Corp.	\$ 75.000	5,13 %	15.09.2020	79.263	0,07 %
Boeing Co.	\$ 75.000	4,88 %	15.02.2020	79.223	0,07 %
Phillips 66	\$ 75.000	4,30 %	01.04.2022	79.209	0,07 %
Republic Services, Inc.	\$ 75.000	5,50 %	15.09.2019	78.959	0,07 %
Ecolab, Inc.	\$ 80.000	2,38 %	10.08.2022	78.933	0,07 %
Time Warner, Inc.	\$ 75.000	4,88 %	15.03.2020	78.773	0,07 %
Duke Energy Carolinas LLC	\$ 75.000	3,90 %	15.06.2021	78.387	0,07 %
Devon Energy Corp.	\$ 75.000	4,00 %	15.07.2021	78.072	0,07 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	\$ 75.000	4,46 %	23.07.2022	78.068	0,07 %
Wells Fargo & Co.	CAD 100.000	2,09 %	25.04.2022	77.843	0,07 %
Berkshire Hathaway, Inc.	\$ 75.000	3,40 %	31.01.2022	77.580	0,07 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Time Warner Cable LLC	\$ 75.000	4,13 %	15.02.2021	77.285	0,07 %
Kroger Co.	\$ 75.000	3,40 %	15.04.2022	76.788	0,07 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 75.000	3,50 %	15.07.2022	76.691	0,07 %
Laboratory Corp. of America Holdings	\$ 75.000	3,20 %	01.02.2022	76.453	0,07 %
ONEOK Partners LP	\$ 75.000	3,80 %	15.03.2020	76.428	0,07 %
Baker Hughes a GE Co. LLC	\$ 75.000	3,20 %	15.08.2021	76.374	0,07 %
Realty Income Corp.	\$ 75.000	3,25 %	15.10.2022	76.214	0,07 %
Dow Chemical Co.	\$ 70.000	8,55 %	15.05.2019	75.787	0,07 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 75.000	3,20 %	06.07.2021	75.715	0,07 %
PSEG Power LLC	\$ 75.000	3,00 %	15.06.2021	75.552	0,07 %
Georgia-Pacific LLC	\$ 70.000	5,40 %	01.11.2020	75.469	0,07 %
Flowserve Corp.	\$ 75.000	3,50 %	15.09.2022	75.403	0,07 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 75.000	3,00 %	20.05.2022	75.076	0,07 %
Caterpillar, Inc.	\$ 75.000	2,60 %	26.06.2022	75.048	0,07 %
International Business Machines Corp.	\$ 75.000	2,50 %	27.01.2022	75.043	0,07 %
Occidental Petroleum Corp.	\$ 75.000	2,60 %	15.04.2022	74.984	0,07 %
Walt Disney Co.	\$ 75.000	2,15 %	17.09.2020	74.942	0,07 %
GATX Corp.	\$ 75.000	2,60 %	30.03.2020	74.935	0,07 %
Mastercard, Inc.	\$ 75.000	2,00 %	01.04.2019	74.923	0,07 %
Walt Disney Co.	\$ 75.000	2,45 %	04.03.2022	74.896	0,07 %
Capital One Financial Corp.	\$ 75.000	2,50 %	12.05.2020	74.886	0,07 %
Wells Fargo Bank NA	\$ 75.000	2,15 %	06.12.2019	74.840	0,07 %
Procter & Gamble Co.	\$ 75.000	1,90 %	01.11.2019	74.834	0,07 %
Chevron Corp.	\$ 75.000	2,41 %	03.03.2022	74.781	0,07 %
Pfizer, Inc.	\$ 75.000	1,70 %	15.12.2019	74.653	0,07 %
Becton Dickinson & Co.	\$ 75.000	2,89 %	06.06.2022	74.596	0,07 %
Sempra Energy	\$ 75.000	2,88 %	01.10.2022	74.472	0,07 %
Costco Wholesale Corp.	\$ 75.000	1,70 %	15.12.2019	74.468	0,07 %
Coca-Cola Co.	\$ 75.000	1,38 %	30.05.2019	74.369	0,07 %
VMware, Inc.	\$ 75.000	2,30 %	21.08.2020	74.356	0,07 %
eBay, Inc.	\$ 75.000	2,60 %	15.07.2022	74.287	0,07 %
FirstEnergy Corp.	\$ 75.000	2,85 %	15.07.2022	74.104	0,07 %
Kroger Co.	\$ 75.000	1,50 %	30.09.2019	73.914	0,07 %
Fidelity National Information Services, Inc.	\$ 75.000	2,25 %	15.08.2021	73.806	0,07 %
Walt Disney Co.	\$ 75.000	0,88 %	12.07.2019	73.625	0,07 %
Honeywell International, Inc.	\$ 75.000	1,85 %	01.11.2021	73.567	0,07 %
Newmont Mining Corp.	\$ 70.000	3,50 %	15.03.2022	71.384	0,06 %
L3 Technologies, Inc.	\$ 65.000	4,75 %	15.07.2020	68.357	0,06 %
Procter & Gamble Co.	€ 50.000	4,13 %	07.12.2020	67.330	0,06 %
Dow Chemical Co.	\$ 60.000	4,13 %	15.11.2021	62.882	0,06 %
El du Pont de Nemours & Co.	\$ 60.000	5,75 %	15.03.2019	62.483	0,06 %
Bank of America Corp. ^	\$ 60.000	3,42 %	20.12.2028	59.872	0,05 %
Mosaic Co.	\$ 60.000	3,25 %	15.11.2022	59.399	0,05 %
Fortive Corp.	\$ 60.000	2,35 %	15.06.2021	59.303	0,05 %
Masco Corp.	\$ 50.000	5,95 %	15.03.2022	55.434	0,05 %
Welltower, Inc.	\$ 50.000	5,25 %	15.01.2022	54.333	0,05 %
Sempra Energy	\$ 50.000	9,80 %	15.02.2019	53.979	0,05 %
Alleghany Corp.	\$ 50.000	4,95 %	27.06.2022	53.964	0,05 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	\$ 50.000	6,50 %	01.04.2020	53.894	0,05 %
Nationwide Financial Services, Inc.	\$ 50.000	5,38 %	25.03.2021	53.841	0,05 %
ERP Operating LP	\$ 50.000	4,63 %	15.12.2021	53.515	0,05 %
Time Warner, Inc.	\$ 50.000	4,75 %	29.03.2021	53.165	0,05 %
Comcast Corp.	\$ 50.000	5,15 %	01.03.2020	53.085	0,05 %
Applied Materials, Inc.	\$ 50.000	4,30 %	15.06.2021	53.051	0,05 %
TD Ameritrade Holding Corp.	\$ 50.000	5,60 %	01.12.2019	53.025	0,05 %
Cigna Corp.	\$ 50.000	5,13 %	15.06.2020	53.015	0,05 %
General Electric Co.	\$ 50.000	4,63 %	07.01.2021	52.952	0,05 %
21st Century Fox America, Inc.	\$ 50.000	4,50 %	15.02.2021	52.910	0,05 %
Nasdaq, Inc.	\$ 50.000	5,55 %	15.01.2020	52.893	0,05 %
Omnicom Group, Inc.	\$ 50.000	6,25 %	15.07.2019	52.886	0,05 %
Motiva Enterprises LLC	\$ 50.000	5,75 %	15.01.2020	52.805	0,05 %
Western Gas Partners LP	\$ 50.000	5,38 %	01.06.2021	52.766	0,05 %
El du Pont de Nemours & Co.	\$ 50.000	4,25 %	01.04.2021	52.701	0,05 %
DR Horton, Inc.	\$ 50.000	4,38 %	15.09.2022	52.644	0,05 %
Republic Services, Inc.	\$ 50.000	5,00 %	01.03.2020	52.635	0,05 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 50.000	4,40 %	15.10.2022	52.538	0,05 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Praxair, Inc.	\$ 50.000	4,05 %	15.03.2021	52.455	0,05 %
Sherwin-Williams Co.	\$ 50.000	4,20 %	15.01.2022	52.331	0,05 %
General Dynamics Corp.	\$ 50.000	3,88 %	15.07.2021	52.320	0,05 %
CenterPoint Energy Resources Corp.	\$ 50.000	4,50 %	15.01.2021	52.255	0,05 %
O'Reilly Automotive, Inc.	\$ 50.000	3,80 %	01.09.2022	52.226	0,05 %
Xcel Energy, Inc.	\$ 50.000	4,70 %	15.05.2020	52.171	0,05 %
Noble Energy, Inc.	\$ 50.000	4,15 %	15.12.2021	52.171	0,05 %
Magellan Midstream Partners LP	\$ 50.000	4,25 %	01.02.2021	52.101	0,05 %
Pioneer Natural Resources Co.	\$ 50.000	3,95 %	15.07.2022	52.053	0,05 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	\$ 50.000	4,70 %	01.10.2019	52.019	0,05 %
Parker-Hannifin Corp.	\$ 50.000	3,50 %	15.09.2022	51.586	0,05 %
Exelon Generation Co. LLC	\$ 50.000	4,00 %	01.10.2020	51.521	0,05 %
Commonwealth Edison Co.	\$ 50.000	3,40 %	01.09.2021	51.396	0,05 %
PPL Capital Funding, Inc.	\$ 50.000	3,50 %	01.12.2022	51.329	0,05 %
Pacific Gas & Electric Co.	\$ 50.000	3,50 %	01.10.2020	51.278	0,05 %
Kraft Heinz Foods Co.	\$ 50.000	3,50 %	06.06.2022	51.164	0,05 %
Apache Corp.	\$ 50.000	3,63 %	01.02.2021	51.156	0,05 %
Raytheon Co.	\$ 50.000	3,13 %	15.10.2020	51.147	0,05 %
Total System Services, Inc.	\$ 50.000	3,80 %	01.04.2021	51.125	0,05 %
CA, Inc.	\$ 50.000	3,60 %	01.08.2020	51.076	0,05 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	\$ 50.000	3,50 %	15.09.2021	51.000	0,05 %
American Campus Communities Operating Partnership LP	\$ 50.000	3,35 %	01.10.2020	50.961	0,05 %
United Technologies Corp.	\$ 50.000	3,10 %	01.06.2022	50.920	0,05 %
Principal Financial Group, Inc.	\$ 50.000	3,30 %	15.09.2022	50.905	0,05 %
CME Group, Inc.	\$ 50.000	3,00 %	15.09.2022	50.873	0,05 %
Apple, Inc.	\$ 50.000	2,85 %	06.05.2021	50.823	0,05 %
Scripps Networks Interactive, Inc.	\$ 50.000	3,50 %	15.06.2022	50.607	0,05 %
American Tower Corp.	\$ 50.000	3,40 %	15.02.2019	50.578	0,05 %
Exelon Corp.	\$ 50.000	2,85 %	15.06.2020	50.414	0,05 %
AvalonBay Communities, Inc.	\$ 50.000	2,95 %	15.09.2022	50.405	0,05 %
Dominion Energy Gas Holdings LLC	\$ 50.000	2,80 %	15.11.2020	50.372	0,05 %
Agilent Technologies, Inc.	\$ 50.000	3,20 %	01.10.2022	50.361	0,05 %
Eastman Chemical Co.	\$ 50.000	2,70 %	15.01.2020	50.326	0,05 %
Boston Scientific Corp.	\$ 50.000	2,85 %	15.05.2020	50.320	0,05 %
General Motors Financial Co., Inc.	\$ 50.000	3,10 %	15.01.2019	50.317	0,05 %
Unum Group	\$ 50.000	3,00 %	15.05.2021	50.215	0,05 %
DXC Technology Co.	\$ 50.000	2,88 %	27.03.2020	50.199	0,05 %
Ryder System, Inc.	\$ 50.000	2,55 %	01.06.2019	50.135	0,05 %
Deere & Co.	\$ 50.000	2,60 %	08.06.2022	50.094	0,05 %
Danaher Corp.	\$ 50.000	2,40 %	15.09.2020	50.092	0,05 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	\$ 50.000	2,40 %	01.02.2020	50.091	0,05 %
Monsanto Co.	\$ 50.000	2,75 %	15.07.2021	50.076	0,05 %
Ameren Corp.	\$ 50.000	2,70 %	15.11.2020	50.042	0,05 %
Moody's Corp.	\$ 50.000	2,75 %	15.12.2021	50.028	0,05 %
Allergan Funding SCS	\$ 50.000	2,45 %	15.06.2019	50.012	0,04 %
Xerox Corp.	\$ 50.000	2,75 %	15.03.2019	49.991	0,04 %
JM Smucker Co.	\$ 50.000	2,20 %	06.12.2019	49.931	0,04 %
General Electric Co.	\$ 50.000	2,70 %	09.10.2022	49.900	0,04 %
Praxair, Inc.	\$ 50.000	2,25 %	24.09.2020	49.896	0,04 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 50.000	2,10 %	10.01.2020	49.893	0,04 %
Chubb INA Holdings, Inc.	\$ 50.000	2,30 %	03.11.2020	49.892	0,04 %
Hyundai Capital America	\$ 50.000	3,25 %	20.09.2022	49.858	0,04 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 50.000	1,85 %	20.05.2019	49.822	0,04 %
ConocoPhillips Co.	\$ 50.000	2,20 %	15.05.2020	49.820	0,04 %
Enterprise Products Operating LLC^	\$ 50.000	4,88 %	16.08.2077	49.774	0,04 %
American Electric Power Co., Inc.	\$ 50.000	2,15 %	13.11.2020	49.767	0,04 %
QUALCOMM, Inc.	\$ 50.000	2,10 %	20.05.2020	49.759	0,04 %
Southern Co.	\$ 50.000	1,85 %	01.07.2019	49.713	0,04 %
Texas Instruments, Inc.	\$ 50.000	1,65 %	03.08.2019	49.711	0,04 %
Alabama Power Co.	\$ 50.000	2,45 %	30.03.2022	49.670	0,04 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	\$ 50.000	2,60 %	15.12.2019	49.649	0,04 %
American Express Co.	\$ 50.000	2,20 %	30.10.2020	49.607	0,04 %
EQT Corp.	\$ 50.000	2,50 %	01.10.2020	49.607	0,04 %
E*TRADE Financial Corp.	\$ 50.000	2,95 %	24.08.2022	49.587	0,04 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 50.000	2,08 %	15.10.2020	49.586	0,04 %
NetApp, Inc.	\$ 50.000	2,00 %	27.09.2019	49.584	0,04 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Goldman Sachs Group, Inc.^	\$ 50.000	2,91 %	05.06.2023	49.581	0,04 %
Northrop Grumman Corp.	\$ 50.000	2,55 %	15.10.2022	49.565	0,04 %
Consolidated Edison, Inc.	\$ 50.000	2,00 %	15.03.2020	49.532	0,04 %
Southern Power Co.	\$ 50.000	2,50 %	15.12.2021	49.526	0,04 %
NVIDIA Corp.	\$ 50.000	2,20 %	16.09.2021	49.499	0,04 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 50.000	1,60 %	15.08.2019	49.468	0,04 %
Honeywell International, Inc.	\$ 50.000	1,40 %	30.10.2019	49.462	0,04 %
PACCAR Financial Corp.	\$ 50.000	1,30 %	10.05.2019	49.460	0,04 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	\$ 50.000	1,55 %	13.09.2019	49.336	0,04 %
Jackson National Life Global Funding	\$ 50.000	2,50 %	27.06.2022	49.217	0,04 %
CenterPoint Energy, Inc.	\$ 50.000	2,50 %	01.09.2022	49.144	0,04 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	\$ 50.000	2,20 %	15.01.2021	48.909	0,04 %
Xerox Corp.	\$ 50.000	3,63 %	15.03.2023	48.677	0,04 %
American Tower Corp.	\$ 50.000	2,25 %	15.01.2022	48.669	0,04 %
Caterpillar Financial Services Corp.	\$ 50.000	1,70 %	09.08.2021	48.656	0,04 %
Comcast Corp.	\$ 50.000	1,63 %	15.01.2022	48.285	0,04 %
Sherwin-Williams Co.	\$ 45.000	2,25 %	15.05.2020	44.856	0,04 %
Weyerhaeuser Co.	\$ 40.000	7,38 %	01.10.2019	43.261	0,04 %
Chubb INA Holdings, Inc.	\$ 40.000	2,88 %	03.11.2022	40.378	0,04 %
Williams Partners LP	\$ 40.000	3,35 %	15.08.2022	40.349	0,04 %
Dow Chemical Co.	\$ 40.000	3,00 %	15.11.2022	40.225	0,04 %
Rockwell Collins, Inc.	\$ 40.000	2,80 %	15.03.2022	40.039	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	CAD 50.000	2,43 %	26.04.2023	39.149	0,04 %
US Treasury Note	\$ 39.000	2,00 %	30.11.2022	38.653	0,03 %
Kohl's Corp.	\$ 35.000	4,00 %	01.11.2021	35.994	0,03 %
Marathon Oil Corp.	\$ 35.000	2,80 %	01.11.2022	34.478	0,03 %
International Paper Co.	\$ 28.000	7,50 %	15.08.2021	32.574	0,03 %
United Technologies Corp.	\$ 30.000	4,50 %	15.04.2020	31.460	0,03 %
El du Pont de Nemours & Co.	\$ 30.000	4,63 %	15.01.2020	31.354	0,03 %
GE Capital UK Funding Unlimited Co.	£ 20.000	5,88 %	04.11.2020	30.567	0,03 %
WestRock RKT Co.	\$ 30.000	3,50 %	01.03.2020	30.538	0,03 %
Marathon Oil Corp.	\$ 30.000	2,70 %	01.06.2020	29.979	0,03 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	\$ 25.000	7,00 %	01.09.2022	29.504	0,03 %
CMS Energy Corp.	\$ 25.000	5,05 %	15.03.2022	27.104	0,02 %
Bemis Co., Inc.	\$ 25.000	4,50 %	15.10.2021	26.354	0,02 %
Dover Corp.	\$ 25.000	4,30 %	01.03.2021	26.347	0,02 %
Adobe Systems, Inc.	\$ 25.000	4,75 %	01.02.2020	26.314	0,02 %
Travelers Cos, Inc.	\$ 25.000	5,90 %	02.06.2019	26.265	0,02 %
CA, Inc.	\$ 25.000	5,38 %	01.12.2019	26.226	0,02 %
Exelon Generation Co. LLC	\$ 25.000	4,25 %	15.06.2022	26.224	0,02 %
Entergy Corp.	\$ 25.000	4,00 %	15.07.2022	26.112	0,02 %
KLA-Tencor Corp.	\$ 25.000	4,13 %	01.11.2021	26.088	0,02 %
Verisk Analytics, Inc.	\$ 25.000	4,13 %	12.09.2022	26.071	0,02 %
Nordstrom, Inc.	\$ 25.000	4,75 %	01.05.2020	26.045	0,02 %
Aetna, Inc.	\$ 25.000	4,13 %	01.06.2021	25.983	0,02 %
SCANA Corp.	\$ 25.000	4,75 %	15.05.2021	25.883	0,02 %
Omnicom Group, Inc.	\$ 25.000	3,63 %	01.05.2022	25.809	0,02 %
Virginia Electric & Power Co.	\$ 25.000	3,45 %	01.09.2022	25.791	0,02 %
Electronic Arts, Inc.	\$ 25.000	3,70 %	01.03.2021	25.725	0,02 %
Tyco Electronics Group SA	\$ 25.000	3,50 %	03.02.2022	25.715	0,02 %
Nordstrom, Inc.	\$ 25.000	4,00 %	15.10.2021	25.711	0,02 %
DTE Electric Co.	\$ 25.000	3,45 %	01.10.2020	25.707	0,02 %
Comcast Corp.	\$ 25.000	3,13 %	15.07.2022	25.563	0,02 %
Motorola Solutions, Inc.	\$ 25.000	3,50 %	01.09.2021	25.426	0,02 %
CBS Corp.	\$ 25.000	3,38 %	01.03.2022	25.398	0,02 %
Exelon Corp.	\$ 25.000	3,50 %	01.06.2022	25.391	0,02 %
PacifiCorp	\$ 25.000	2,95 %	01.02.2022	25.390	0,02 %
Avnet, Inc.	\$ 25.000	3,75 %	01.12.2021	25.341	0,02 %
Texas Instruments, Inc.	\$ 25.000	2,75 %	12.03.2021	25.325	0,02 %
TJX Cos, Inc.	\$ 25.000	2,75 %	15.06.2021	25.301	0,02 %
Duke Energy Corp.	\$ 25.000	3,05 %	15.08.2022	25.263	0,02 %
Emerson Electric Co.	\$ 25.000	2,63 %	01.12.2021	25.232	0,02 %
Discovery Communications LLC	\$ 25.000	3,30 %	15.05.2022	25.218	0,02 %
Xilinx, Inc.	\$ 25.000	3,00 %	15.03.2021	25.194	0,02 %
Seagate HDD Cayman	\$ 25.000	4,25 %	01.03.2022	25.188	0,02 %
Precision Castparts Corp.	\$ 25.000	2,25 %	15.06.2020	25.042	0,02 %

	Kapital	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Tech Data Corp.	\$ 25.000	3,70 %	15.02.2022	25.023	0,02 %
Dominion Energy, Inc.	\$ 25.000	2,75 %	15.01.2022	25.014	0,02 %
VMware, Inc.	\$ 25.000	2,95 %	21.08.2022	24.951	0,02 %
Eversource Energy	\$ 25.000	2,75 %	15.03.2022	24.946	0,02 %
Xilinx, Inc.	\$ 25.000	2,13 %	15.03.2019	24.944	0,02 %
ITC Holdings Corp.	\$ 25.000	2,70 %	15.11.2022	24.915	0,02 %
3M Co.	\$ 25.000	1,63 %	15.06.2019	24.887	0,02 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	\$ 25.000	2,10 %	04.10.2019	24.819	0,02 %
Analog Devices, Inc.	\$ 25.000	2,50 %	05.12.2021	24.792	0,02 %
Edison International	\$ 25.000	2,13 %	15.04.2020	24.771	0,02 %
Activision Blizzard, Inc.	\$ 25.000	2,60 %	15.06.2022	24.725	0,02 %
Activision Blizzard, Inc.	\$ 25.000	2,30 %	15.09.2021	24.698	0,02 %
ConocoPhillips Co.	\$ 25.000	2,40 %	15.12.2022	24.661	0,02 %
AEP Texas, Inc.	\$ 25.000	2,40 %	01.10.2022	24.542	0,02 %
Northern States Power Co.	\$ 25.000	2,15 %	15.08.2022	24.423	0,02 %
Packaging Corp. of America	\$ 20.000	2,45 %	15.12.2020	20.029	0,02 %
PPG Industries, Inc.	\$ 20.000	2,30 %	15.11.2019	19.995	0,02 %
Wyndham Worldwide Corp.	\$ 15.000	4,25 %	01.03.2022	15.260	0,01 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	\$ 15.000	3,88 %	15.01.2022	15.106	0,01 %
Humana, Inc.	\$ 10.000	2,90 %	15.12.2022	9.953	0,01 %
CMS Energy Corp.	\$ 9.000	8,75 %	15.06.2019	9.775	0,01 %
				52.697.366	47,45 %
Summe Anleihen				109.112.192	98,25 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				109.112.192	98,25 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures 0,00 %				
US 10-Year Note März 2018	(2)	(248.750)	657	0,00 %
US 2-Year Note März 2018	(6)	(1.285.188)	531	0,00 %
US 5-Year Note März 2018	3	348.539	(47)	(0,00 %)
			1.141	0,00 %

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte (0,24 %)							
USD	2.686.006	JPY	(300.000.000)	BNP Paribas	05.01.2018	22.611	0,02 %
USD	3.998.457	GBP	(2.950.000)	BNP Paribas	03.01.2018	7.845	0,01 %
JPY	310.000.000	USD	(2.751.886)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	287	0,00 %
USD	67.774	GBP	(50.000)	BNP Paribas	03.01.2018	137	0,00 %
GBP	100.000	USD	(135.396)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	23	0,00 %
USD	860.360	AUD	(1.100.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(22)	(0,00 %)
USD	421.020	EUR	(350.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(60)	(0,00 %)
USD	4.152.028	CAD	(5.200.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(133)	(0,00 %)
USD	88.410	JPY	(10.000.000)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	(370)	(0,00 %)
USD	2.755.531	JPY	(310.000.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(514)	(0,00 %)
USD	4.061.970	GBP	(3.000.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(582)	(0,00 %)
USD	238.991	EUR	(200.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(1.169)	(0,00 %)
USD	30.193.167	EUR	(25.100.000)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(4.284)	(0,01 %)
USD	475.031	EUR	(400.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(5.289)	(0,01 %)
USD	834.946	AUD	(1.100.000)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(25.419)	(0,02 %)
USD	4.038.537	CAD	(5.200.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(111.668)	(0,10 %)
USD	29.276.765	EUR	(24.500.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(142.841)	(0,13 %)
						(261.448)	(0,24 %)

Offene Devisenterminkontrakte zu Absicherungszwecken auf Ebene der Anteilsklasse (0,18 %)							
GBP	82.206.114	USD	(111.306.256)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	15.961	0,01 %
GBP	740.176	USD	(1.000.000)	BNP Paribas	03.01.2018	1.273	0,00 %
GBP	539.189	USD	(730.000)	BNP Paribas	02.02.2018	161	0,00 %
USD	111.306.256	GBP	(82.281.468)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	16	0,00 %

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf- betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
GBP	159.141	USD	(215.278)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	—	0,00 %
USD	901.954	GBP	(666.160)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(149)	(0,00 %)
GBP	1.955.014	USD	(2.650.000)	BNP Paribas	03.01.2018	(5.355)	(0,00 %)
GBP	79.427.137	USD	(107.656.256)	BNP Paribas	03.01.2018	(211.212)	(0,19 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente						(199.305)	(0,18 %)
						(459.612)	(0,42 %)
Sonstige Aktiva und Passiva						2.398.000	2,17 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)						111.050.580	100,00 %
Analyse des Gesamtvermögens							% des Gesamt- US-Dollar (\$) nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind						78.071.704	70,30 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						26.541.873	23,90 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						4.498.615	4,05 %
(d) Derivative Finanzinstrumente						(459.612)	(0,42 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva						2.398.000	2,17 %
Gesamt Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)						111.050.580	100,00 %

^ Zinsvariable Anleihe (FRN). Der Effektivzins zum 31. Dezember 2017.

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017¹

	Kapital	Kosten US-Dollar (\$)		Kapital	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
Japan Government Bond 0,10 % 15.9.2019	¥ 150.000.000	1.321.204	US Treasury Note 1,75 % 15.11.2020	\$ 1.289.000	1.282.212
US Treasury Note 1,75 % 15.11.2020	\$ 1.289.000	1.283.647	US Treasury Note 2,00 % 30.11.2022	\$ 339.000	336.644
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,75 % 4.7.2022	€ 700.000	917.715	Macquarie Group Ltd. 6,00 % 14.1.2020	\$ 300.000	320.934
Goldman Sachs Group, Inc. 2,63 % 31.1.2019	\$ 800.000	806.488	Citibank NA 1,85 % 18.9.2019	\$ 275.000	273.578
Bank of America Corp. 2,60 % 15.1.2019	\$ 750.000	755.100	Morgan Stanley 2,50 % 21.4.2021	\$ 275.000	273.477
Morgan Stanley 5,75 % 25.1.2021	\$ 500.000	550.870	Cooperative Rabobank UA 2,25 % 14.1.2020	\$ 250.000	249.635
JPMorgan Chase & Co. 4,50 % 24.01.2022	\$ 500.000	539.620	UBS AG 2,20 % 8.6.2020	\$ 250.000	249.250
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 2,09 % 18.10.2019	\$ 500.000	500.123	Santander UK plc 2,50 % 14.03.2019	\$ 200.000	200.718
PNC Bank NA 2,00 % 19.5.2020	\$ 500.000	499.100	Protective Life Global Funding 1,72 % 15.4.2019	\$ 200.000	199.186
US Treasury Note 1,75 % 30.11.2019	\$ 475.000	474.368	Goldman Sachs Group, Inc. 2,60 % 23.4.2020	\$ 150.000	150.251
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. 2,65 % 1.2.2021	\$ 450.000	455.954	Commonwealth Bank of Australia 2,25 % 10.3.2020	\$ 150.000	149.889
Japan Government Bond 0,10 % 20.9.2022	¥ 50.000.000	442.622	US Treasury Note 1,75 % 30.11.2019	\$ 140.000	139.829
Shinkin Central Bank 0,03 % 25.6.2021	¥ 50.000.000	437.383	BP Capital Markets plc 4,33 % 10.12.2018	£ 100.000	138.265
Goldman Sachs Group, Inc. 2,60 % 23.4.2020	\$ 400.000	402.952	Standard Chartered plc 0,75 % 3.10.2023	€ 100.000	116.717
Morgan Stanley 2,45 % 1.2.2019	\$ 400.000	402.244	HSBC Bank plc 4,13 % 12.08.2020	\$ 100.000	104.329
Citigroup, Inc. 2,75 % 25.4.2022	\$ 400.000	401.204	JB Hunt Transport Services, Inc. 3,30 % 15.8.2022	\$ 100.000	101.849
Morgan Stanley 2,50 % 21.4.2021	\$ 400.000	400.348	Santander Holdings USA, Inc. 3,70 % 28.3.2022	\$ 100.000	101.452
JPMorgan Chase & Co. 2,30 % 15.08.2021	\$ 400.000	398.800	Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. 2,65 % 1.2.2021	\$ 100.000	100.647
CK Hutchison International 17 II Ltd. 2,25 % 29.9.2020	\$ 400.000	398.400	Caterpillar Financial Services Corp. 2,10 % 9.6.2019	\$ 100.000	100.142
US Treasury Note 2,00 % 30.11.2022	\$ 378.000	375.695	Gilead Sciences, Inc. 2,05 % 1.4.2019	\$ 100.000	100.007
			eBay, Inc. 2,20 % 1.8.2019	\$ 100.000	99.854
			Amgen, Inc. 1,90 % 10.5.2019	\$ 100.000	99.783
			Westpac Banking Corp. 2,50 % 28.6.2022	\$ 100.000	99.700
			Commonwealth Bank of Australia 1,75 % 7.11.2019	\$ 100.000	98.998
			Johnson & Johnson 1,65 % 1.3.2021	\$ 100.000	98.465
			AT&T, Inc. 5,00 % 1.3.2021	\$ 75.000	80.374
			CSX Corp. 4,25 % 1.6.2021	\$ 75.000	79.139
			Precision Castparts Corp. 2,25 % 15.6.2020	\$ 75.000	75.206
			United Kingdom Gilt 2,00 % 07.09.2025	£ 53.000	74.229

¹ Der Fonds wurde am 2. November 2017 aufgelegt.

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Berichtszeitraums. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden.

Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Berichtszeitraum ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017
Umlaufvermögen	
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	109.112.192
Derivative Finanzinstrumente	49.502
Barmittel und liquide Vermögenswerte	1.764.726
Forderungen:	
Zinsen und Dividenden	1.009.389
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	338
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	1.009.881
Summe Umlaufvermögen	112.946.028
Kurzfristige Passiva	
Derivative Finanzinstrumente	509.114
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	127
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:	
Erworbene Kapitalanlagen	1.372.543
An Broker zu zahlende Bareinschüsse	2.430
Zahlbare Verwaltungsgebühren	11.234
Summe kurzfristige Passiva	1.895.448
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken) („Nettovermögen“)	111.050.580

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹
Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in USD (\$)	
Nettovermögen	4.988
Anzahl der umlaufenden Anteile	50
Nettoinventarwert je Anteil	99,76
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP (£)	
Gegenwert in US (\$)	110.962.940
Nettovermögen	82.027.680
Anzahl der umlaufenden Anteile	821.702
Nettoinventarwert je Anteil	99,83
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in GBP (£)	
Gegenwert in US (\$)	82.652
Nettovermögen	61.099
Anzahl der umlaufenden Anteile	612
Nettoinventarwert je Anteil	99,83

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Berichtszeitraum bis zum 31. Dezember 2017 ¹
Anlageerträge/(-verluste)	
Zinserträge	278.728
Verschiedene Erträge	8.149
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	3.066.823
Summe Anlageerträge/(-verluste)	3.353.700
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühren	21.189
Transaktionsgebühren und Provisionen	571
Sonstige Aufwendungen	46
Summe Aufwendungen	21.806
Finanzierungskosten	
Zinsaufwand	744
Summe Finanzierungskosten	744
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3.331.150
Ausländische Quellensteuer	(5.422)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	3.325.728

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Berichtszeitraum bis zum 31. Dezember 2017 ¹
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens	
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	3.325.728
Kapitalgeschäfte	
Zeichnungen	107.724.852
Summe Kapitalgeschäfte	107.724.852
Gesamtsteigerung/(-minderung) für den Zeitraum	111.050.580
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	
Zu Beginn des Berichtszeitraums	—
Ende des Berichtszeitraums	111.050.580

¹ Der Fonds wurde am 2. November 2017 aufgelegt.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Berichtszeitraums verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für den Berichtszeitraum beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Japan Government Bond Index Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Investments Australia Ltd.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds strebt eine Rendite an, die der Wertentwicklung des Bloomberg Barclays Japan Government Float Adjusted Bond Index entspricht, eines marktgewichteten Index, der das gesamte Spektrum der auf japanische Yen lautenden japanischen Schatztitel und regierungsnahen Wertpapiere mit Laufzeiten von mehr als einem Jahr widerspiegeln soll.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	425	941
Rendite auf Endfälligkeit	0,2 % ³	0,2 %
Durchschnittlicher Kupon	0,9 %	1,2 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	10,9 Jahre	11,1 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	A1	A1
Durchschnittliche Duration	9,8 Jahre	9,8 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,20 %	
Anlegeranteile	0,25 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,25 %	
Thesaurierende Anteile	0,25 %	
Kurzfristige Reserven	0,3 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
R ²	1,00	1,00
Beta	1,00	1,00

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

Treasury-Titel	91,3 %
Agency-Titel	5,7
Lokale Behörde	3,0

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

A	93,8 %
nicht eingestuft	6,2

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	38,4 %
5-10 Jahre	20,2
Mehr als 10 Jahre	41,4

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit	Kurz	Mittel	Lang
Kreditqualität Staats-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays Japan Government Float Adjusted Bond Index.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

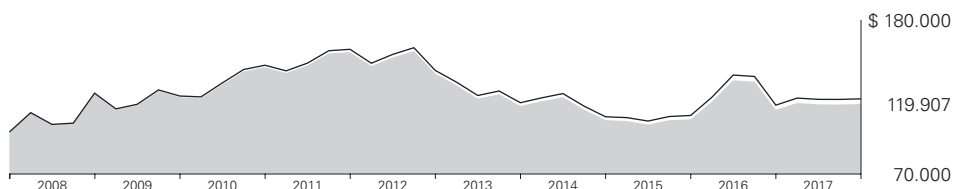
Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

Japan Government Bond Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays Japan Government Float Adjusted Bond Index

In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. \$ 100.000

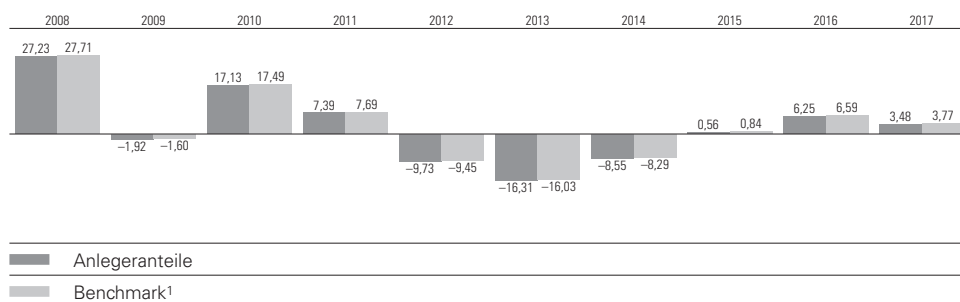


	Durchschnittliche jährliche Gesamrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Anlegeranteile	3,48 %	-3,29 %	1,83 %	\$ 119.907
— Benchmark ¹	3,77	-3,00	2,15	123.650

	Ein Jahr	Seit Auflegung ²	Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
Institutionelle Anteile	3,54 %	4,65 %	\$ 5.680.860
Benchmark	3,77	4,90	5.720.379

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,29 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,23 Prozentpunkte für institutionelle Anteile.³

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



1 Bloomberg Barclays Japan Government Bond Index bis 30. Juni 2010; und danach Bloomberg Barclays Japan Government Float Adjusted Bond Index.

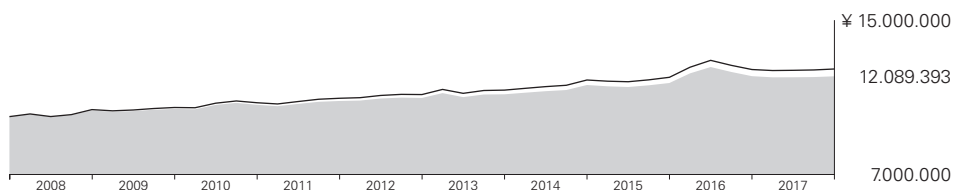
2 10. März 2015.

3 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Japan Government Bond Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays Japan Government Float Adjusted Bond Index

In japanischen Yen

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. ¥ 10.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtrrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ²	¥ 10.000.000
■ Anlegeranteile	-0,06 %	1,97 %	1,92 %	¥ 12.089.393
— Benchmark ¹	0,22	2,27	2,23	12.468.430

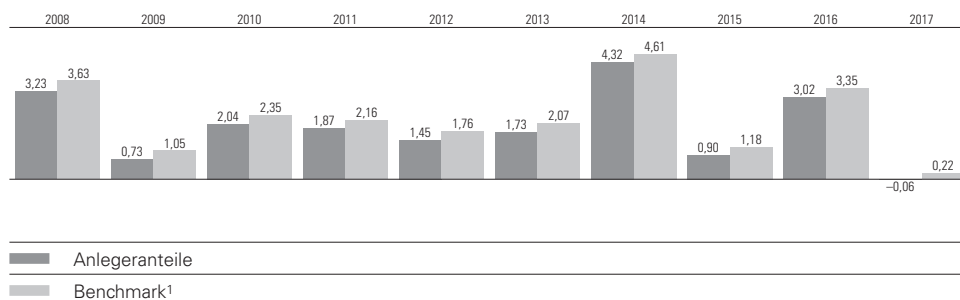
	Durchschnittliche jährliche Gesamtrrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ²	¥ 500.000.000
Institutionelle Anteile	-0,01 %	2,03 %	2,00 %	¥ 609.284.607
Benchmark ¹	0,22	2,27	2,23	623.421.518

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von
	Ein Jahr	Seit Auflegung ²		¥ 20.000.000.000
Institutionelle Plus-Anteile	0,08 %	2,02 %		¥ 21.374.304.578
Benchmark	0,22	2,18		21.485.660.330

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von
	Ein Jahr	Seit Auflegung ²		¥ 20.000.000.000
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,09 %	1,83 %		¥ 20.838.642.000
Benchmark	0,22	1,98		20.910.772.000

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,28 Prozentpunkte für Anlegeranteile, 0,23 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,14 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile und 0,13 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Ertragsanteile.³

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017

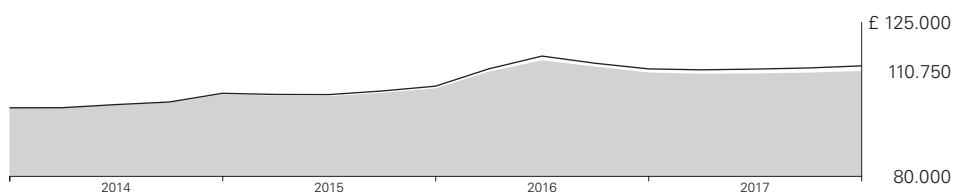


1 Bloomberg Barclays Japan Government Bond Index bis 30. Juni 2010; und danach Bloomberg Barclays Japan Government Float Adjusted Bond Index.
 2 Für institutionelle Anteile, 11. Oktober 2007; für institutionelle Plus-Anteile, 2. September 2014; für institutionelle Plus-Ertragsanteile, 24. September 2015.
 3 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Japan Government Bond Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays Japan Government Float Adjusted Bond Index GBP-Hedged

Abgesichert in GBP

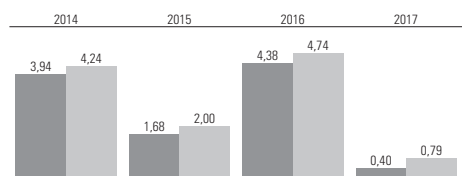
Kumulative Wertentwicklung: 31. Januar 2014–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP	0,40 %	2,64 %	£ 110.750
Benchmark	0,79	2,99	112.241

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,39 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte Thesaurierungsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Januar 2014–31. Dezember 2017



Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP
Benchmark

¹ 31. Januar 2014.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital Japanischer Yen (¥)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Japanischer Yen (¥)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 99,67 % (2016: 99,69 %)					
Banken 0,56 % (2016 %) 0,59 %)					
Shoko Chukin Bank Ltd.	300.000.000	0,07 %	27.08.2020	299.580.000	0,21 %
Shoko Chukin Bank Ltd.	200.000.000	0,02 %	27.02.2019	199.835.400	0,14 %
Shoko Chukin Bank Ltd.	200.000.000	0,02 %	27.12.2019	199.653.000	0,14 %
Shoko Chukin Bank Ltd.	100.000.000	0,23 %	27.10.2020	100.297.000	0,07 %
				799.365.400	0,56 %
Geschäftsdienstleistungen 0,47 % (2016: 0,34 %)					
Central Nippon Expressway Co., Ltd.	150.000.000	0,26 %	02.06.2020	150.596.850	0,10 %
West Nippon Expressway Co., Ltd.	100.000.000	0,09 %	20.09.2022	99.920.300	0,06 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	100.000.000	0,01 %	20.06.2019	99.895.700	0,07 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	100.000.000	0,09 %	20.06.2022	99.886.600	0,07 %
Central Nippon Expressway Co., Ltd.	50.000.000	0,29 %	20.03.2019	50.144.400	0,04 %
Metropolitan Expressway Co., Ltd.	50.000.000	0,03 %	17.09.2021	49.862.700	0,04 %
Metropolitan Expressway Co., Ltd.	40.000.000	0,21 %	18.09.2020	40.128.440	0,03 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	30.000.000	0,26 %	19.06.2020	30.128.010	0,02 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	30.000.000	0,18 %	19.03.2020	30.061.200	0,02 %
East Nippon Expressway Co., Ltd.	10.000.000	0,06 %	18.06.2021	9.986.250	0,01 %
West Nippon Expressway Co., Ltd.	10.000.000	0,17 %	22.05.2026	9.942.430	0,01 %
				670.552.880	0,47 %
Kommunal 2,88 % (2016: 2,83 %)					
Major Joint Local Government Bond	250.000.000	0,69 %	25.04.2024	259.412.250	0,19 %
Major Joint Local Government Bond	200.000.000	0,68 %	25.10.2023	206.883.600	0,16 %
Major Joint Local Government Bond	200.000.000	0,51 %	25.09.2025	205.727.000	0,16 %
Major Joint Local Government Bond	200.000.000	0,15 %	25.12.2026	199.417.400	0,15 %
Tokyo Metropolitan Government	140.000.000	0,44 %	19.03.2025	143.303.580	0,11 %
Tokyo Metropolitan Government	140.000.000	0,43 %	20.12.2024	143.199.840	0,10 %
Major Joint Local Government Bond	130.000.000	0,47 %	25.12.2025	133.391.180	0,09 %
Tokyo Metropolitan Government	115.000.000	0,99 %	20.12.2021	119.325.725	0,08 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	0,82 %	25.08.2023	104.198.600	0,07 %
Tokyo Metropolitan Government	100.000.000	1,35 %	18.12.2020	103.909.300	0,07 %
Tokyo Metropolitan Government	100.000.000	0,69 %	19.03.2024	103.775.600	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	0,71 %	25.12.2023	103.763.000	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	0,82 %	22.09.2022	103.590.200	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	0,55 %	25.07.2025	103.180.000	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	0,55 %	25.06.2025	103.138.600	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	0,55 %	23.05.2025	103.134.500	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	1,12 %	25.09.2020	102.943.300	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	0,47 %	24.10.2025	102.545.500	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	0,47 %	25.03.2025	102.535.400	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	1,57 %	24.05.2019	102.136.600	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	1,55 %	25.09.2018	101.099.500	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	1,55 %	25.04.2018	100.456.600	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	0,22 %	25.10.2027	100.102.000	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	0,18 %	25.01.2027	100.015.100	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	90.000.000	1,40 %	25.07.2019	91.914.570	0,06 %
Major Joint Local Government Bond	87.000.000	1,44 %	24.04.2020	89.815.233	0,06 %
Tokyo Metropolitan Government	80.000.000	0,72 %	20.12.2023	83.066.880	0,06 %
Tokyo Metropolitan Government	50.000.000	1,29 %	20.06.2035	56.127.150	0,04 %
Major Joint Local Government Bond	50.000.000	0,87 %	23.06.2023	52.193.250	0,04 %
Major Joint Local Government Bond	50.000.000	0,81 %	25.09.2023	52.099.700	0,04 %
Tokyo Metropolitan Government	50.000.000	0,44 %	19.12.2025	51.247.250	0,04 %
Tokyo Metropolitan Government	50.000.000	1,38 %	20.09.2019	51.167.650	0,04 %
Tokyo Metropolitan Government	50.000.000	1,38 %	20.09.2019	51.166.450	0,04 %
Major Joint Local Government Bond	50.000.000	1,74 %	25.05.2018	50.330.000	0,04 %
Major Joint Local Government Bond	40.000.000	1,05 %	25.08.2021	41.473.600	0,03 %
Major Joint Local Government Bond	40.000.000	0,80 %	25.10.2022	41.423.320	0,03 %
Major Joint Local Government Bond	40.000.000	0,41 %	25.04.2025	40.827.000	0,03 %
Major Joint Local Government Bond	35.000.000	0,91 %	25.07.2023	36.629.880	0,03 %

	Kapital Japanischer Yen (¥)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Japanischer Yen (¥)	% des Gesamt- nettovermögens
Tokyo Metropolitan Government	33.000.000	1,30 %	19.06.2020	34.033.956	0,02 %
Major Joint Local Government Bond	30.000.000	0,77 %	25.08.2022	30.993.750	0,02 %
Major Joint Local Government Bond	27.000.000	1,54 %	23.08.2019	27.668.304	0,02 %
Tokyo Metropolitan Government	20.000.000	0,84 %	20.06.2023	20.848.900	0,01 %
Major Joint Local Government Bond	20.000.000	1,01 %	25.03.2022	20.809.680	0,01 %
Tokyo Metropolitan Government	20.000.000	0,96 %	18.03.2022	20.769.940	0,01 %
Major Joint Local Government Bond	20.000.000	0,57 %	25.04.2023	20.534.680	0,01 %
Major Joint Local Government Bond	15.000.000	1,01 %	25.02.2022	15.595.485	0,01 %
Tokyo Metropolitan Government	15.000.000	0,76 %	20.12.2022	15.528.510	0,01 %
Osaka Prefecture	10.000.000	1,45 %	26.09.2034	11.433.420	0,01 %
Tokyo Metropolitan Government	10.000.000	0,94 %	18.09.2020	10.246.210	0,01 %
Major Joint Local Government Bond	2.500.000	1,62 %	24.08.2018	2.525.178	0,00 %
				4.071.654.321	2,88 %

Staatlich 95,76 % (2016: 95,93 %)

Japanische Staatsanleihe	3.338.000.000	0,10 %	20.09.2022	3.370.411.980	2,39 %
Japanische Staatsanleihe	3.075.000.000	0,10 %	20.06.2021	3.097.509.000	2,20 %
Japanische Staatsanleihe	2.640.000.000	0,10 %	20.06.2022	2.664.156.000	1,89 %
Japanische Staatsanleihe	2.240.000.000	0,10 %	20.06.2020	2.252.096.000	1,60 %
Japanische Staatsanleihe	2.090.000.000	0,20 %	20.06.2019	2.100.052.900	1,49 %
Japanische Staatsanleihe	2.002.400.000	0,10 %	20.09.2027	2.013.953.848	1,43 %
Japanische Staatsanleihe	1.950.000.000	0,10 %	20.03.2021	1.963.611.000	1,40 %
Japanische Staatsanleihe	1.900.000.000	0,10 %	20.09.2021	1.914.725.000	1,35 %
Japanische Staatsanleihe	1.661.550.000	1,00 %	20.03.2022	1.739.077.923	1,23 %
Japanische Staatsanleihe	1.700.000.000	0,10 %	20.06.2027	1.711.186.000	1,21 %
Japanische Staatsanleihe	1.475.000.000	1,30 %	20.06.2035	1.687.488.500	1,19 %
Japanische Staatsanleihe	1.650.000.000	0,10 %	20.12.2026	1.661.913.000	1,17 %
Japanische Staatsanleihe	1.560.000.000	0,50 %	20.09.2036	1.558.362.000	1,10 %
Japanische Staatsanleihe	1.515.000.000	0,10 %	20.03.2026	1.528.528.950	1,08 %
Japanische Staatsanleihe	1.464.500.000	0,20 %	20.03.2019	1.470.270.130	1,04 %
Japanische Staatsanleihe	1.386.500.000	0,80 %	20.12.2022	1.448.282.440	1,02 %
Japanische Staatsanleihe	1.351.000.000	0,90 %	20.03.2022	1.408.322.930	1,00 %
Japanische Staatsanleihe	1.400.000.000	0,10 %	20.03.2020	1.406.902.000	0,99 %
Japanische Staatsanleihe	1.365.000.000	0,10 %	20.06.2026	1.376.288.550	0,97 %
Japanische Staatsanleihe	1.056.600.000	1,90 %	20.09.2042	1.341.205.776	0,95 %
Japanische Staatsanleihe	1.285.000.000	0,10 %	20.12.2019	1.290.654.000	0,91 %
Japanische Staatsanleihe	1.225.000.000	0,10 %	15.11.2019	1.230.475.750	0,87 %
Japanische Staatsanleihe	1.000.000.000	1,80 %	20.12.2031	1.211.700.000	0,86 %
Japanische Staatsanleihe	1.225.000.000	0,40 %	20.03.2036	1.207.556.000	0,85 %
Japanische Staatsanleihe	997.000.000	1,60 %	20.12.2033	1.189.151.810	0,84 %
Japanische Staatsanleihe	1.150.000.000	0,10 %	15.05.2019	1.153.749.000	0,82 %
Japanische Staatsanleihe	1.135.000.000	0,10 %	20.03.2027	1.142.899.600	0,81 %
Japanische Staatsanleihe	1.112.000.000	0,60 %	20.06.2037	1.122.341.600	0,79 %
Japanische Staatsanleihe	1.079.000.000	0,60 %	20.12.2023	1.122.257.110	0,79 %
Japanische Staatsanleihe	1.100.000.000	0,10 %	20.03.2022	1.109.614.000	0,78 %
Japanische Staatsanleihe	1.100.000.000	0,10 %	15.09.2019	1.104.510.000	0,78 %
Japanische Staatsanleihe	900.000.000	2,10 %	20.03.2027	1.072.341.000	0,76 %
Japanische Staatsanleihe	910.000.000	1,40 %	20.09.2034	1.057.165.200	0,75 %
Japanische Staatsanleihe	924.000.000	1,20 %	20.12.2034	1.043.547.120	0,74 %
Japanische Staatsanleihe	923.800.000	1,20 %	20.03.2035	1.042.591.442	0,74 %
Japanische Staatsanleihe	1.000.350.000	0,60 %	20.09.2037	1.007.252.415	0,71 %
Japanische Staatsanleihe	980.000.000	0,30 %	20.12.2025	1.004.745.000	0,71 %
Japanische Staatsanleihe	832.000.000	1,70 %	20.09.2033	1.004.498.560	0,71 %
Japanische Staatsanleihe	1.040.000.000	0,20 %	20.06.2036	985.753.600	0,70 %
Japanische Staatsanleihe	950.000.000	0,10 %	15.02.2019	952.536.500	0,67 %
Japanische Staatsanleihe	689.800.000	2,20 %	20.03.2041	916.668.322	0,65 %
Japanische Staatsanleihe	745.750.000	1,80 %	20.12.2032	909.031.963	0,64 %
Japanische Staatsanleihe	895.000.000	0,60 %	20.12.2036	907.655.300	0,64 %
Japanische Staatsanleihe	745.200.000	1,90 %	20.09.2030	904.926.168	0,64 %
Japanische Staatsanleihe	703.150.000	2,00 %	20.09.2040	902.422.710	0,64 %
Japanische Staatsanleihe	693.850.000	2,00 %	20.03.2042	895.940.751	0,63 %
Japanische Staatsanleihe	890.000.000	0,10 %	20.12.2020	895.785.000	0,63 %
Japanische Staatsanleihe	865.000.000	0,40 %	20.03.2025	892.757.850	0,63 %
Japanische Staatsanleihe	847.400.000	0,80 %	20.09.2022	883.422.974	0,62 %
Japanische Staatsanleihe	841.150.000	1,00 %	20.12.2021	877.950.313	0,62 %
Japanische Staatsanleihe	649.000.000	2,30 %	20.03.2040	871.340.910	0,62 %
Japanische Staatsanleihe	842.000.000	0,80 %	20.06.2047	840.972.760	0,59 %

	Kapital Japanischer Yen (¥)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Japanischer Yen (¥)	% des Gesamt- nettovermögens
Japanische Staatsanleihe	807.950.000	0,60 %	20.03.2023	837.157.393	0,59 %
Japanische Staatsanleihe	646.900.000	2,00 %	20.09.2041	833.323.642	0,59 %
Japanische Staatsanleihe	824.300.000	0,80 %	20.09.2047	822.296.951	0,58 %
Japanische Staatsanleihe	665.700.000	2,10 %	20.03.2030	821.214.177	0,58 %
Japanische Staatsanleihe	745.000.000	1,00 %	20.12.2035	813.078.100	0,57 %
Japanische Staatsanleihe	657.000.000	1,70 %	20.03.2044	808.201.980	0,57 %
Japanische Staatsanleihe	587.350.000	2,20 %	20.09.2039	774.702.903	0,55 %
Japanische Staatsanleihe	608.000.000	1,70 %	20.12.2043	747.134.720	0,53 %
Japanische Staatsanleihe	712.000.000	0,80 %	20.06.2023	746.809.680	0,53 %
Japanische Staatsanleihe	595.150.000	2,10 %	20.12.2029	732.457.057	0,52 %
Japanische Staatsanleihe	592.700.000	1,70 %	20.09.2032	712.520.232	0,50 %
Japanische Staatsanleihe	725.200.000	0,90 %	20.03.2057	709.949.044	0,50 %
Japanische Staatsanleihe	700.000.000	0,10 %	20.12.2022	706.839.000	0,50 %
Japanische Staatsanleihe	700.000.000	0,10 %	15.10.2019	702.996.000	0,50 %
Japanische Staatsanleihe	700.000.000	0,10 %	15.03.2019	702.002.000	0,50 %
Japanische Staatsanleihe	554.000.000	1,80 %	20.03.2043	693.020.760	0,49 %
Japanische Staatsanleihe	567.400.000	1,70 %	20.12.2032	683.478.692	0,48 %
Japanische Staatsanleihe	556.000.000	1,70 %	20.09.2031	665.165.040	0,47 %
Japanische Staatsanleihe	650.000.000	0,10 %	20.09.2020	653.815.500	0,46 %
Japanische Staatsanleihe	626.000.000	0,60 %	20.06.2024	652.930.520	0,46 %
Japanische Staatsanleihe	517.000.000	2,10 %	20.12.2030	642.636.170	0,45 %
Japanische Staatsanleihe	515.000.000	2,00 %	20.12.2030	633.630.250	0,45 %
Japanische Staatsanleihe	530.000.000	1,50 %	20.03.2045	626.889.300	0,44 %
Japanische Staatsanleihe	610.000.000	0,20 %	20.09.2019	613.422.100	0,43 %
Japanische Staatsanleihe	497.000.000	1,70 %	20.09.2044	611.717.540	0,43 %
Japanische Staatsanleihe	496.750.000	2,10 %	20.09.2029	609.710.950	0,43 %
Japanische Staatsanleihe	605.000.000	0,10 %	20.09.2019	607.353.450	0,43 %
Japanische Staatsanleihe	600.000.000	0,10 %	15.12.2019	602.802.000	0,43 %
Japanische Staatsanleihe	486.000.000	1,90 %	20.06.2031	593.503.200	0,42 %
Japanische Staatsanleihe	503.000.000	1,50 %	20.06.2034	592.277.470	0,42 %
Japanische Staatsanleihe	592.000.000	0,80 %	20.03.2047	592.260.480	0,42 %
Japanische Staatsanleihe	714.500.000	0,40 %	20.03.2056	589.283.875	0,42 %
Japanische Staatsanleihe	557.000.000	0,80 %	20.09.2023	585.078.370	0,41 %
Japanische Staatsanleihe	482.250.000	1,80 %	20.09.2031	583.353.713	0,41 %
Japanische Staatsanleihe	529.000.000	1,90 %	20.06.2022	576.371.950	0,41 %
Japanische Staatsanleihe	475.050.000	1,70 %	20.06.2033	573.133.574	0,41 %
Japanische Staatsanleihe	545.000.000	0,40 %	20.06.2025	562.636.200	0,40 %
Japanische Staatsanleihe	512.600.000	1,30 %	20.03.2021	535.866.914	0,38 %
Japanische Staatsanleihe	524.000.000	0,10 %	20.06.2019	525.755.400	0,37 %
Japanische Staatsanleihe	500.000.000	0,10 %	20.12.2027	502.260.000	0,35 %
Japanische Staatsanleihe	500.000.000	0,10 %	15.08.2019	501.950.000	0,35 %
Japanische Staatsanleihe	500.000.000	0,10 %	15.04.2019	501.530.000	0,35 %
Japanische Staatsanleihe	392.000.000	1,90 %	20.06.2043	499.353.120	0,35 %
Japanische Staatsanleihe	405.500.000	1,90 %	20.03.2031	494.645.120	0,35 %
Japanische Staatsanleihe	467.000.000	0,70 %	20.03.2037	480.827.870	0,34 %
Japanische Staatsanleihe	454.950.000	0,50 %	20.09.2024	472.028.823	0,33 %
Japanische Staatsanleihe	505.000.000	0,50 %	20.09.2046	467.645.150	0,33 %
Japanische Staatsanleihe	384.000.000	1,80 %	20.03.2032	466.298.880	0,33 %
Japanische Staatsanleihe	386.950.000	1,70 %	20.06.2032	465.048.119	0,33 %
Japanische Staatsanleihe	460.000.000	0,10 %	15.07.2019	461.702.000	0,33 %
Japanische Staatsanleihe	388.000.000	1,60 %	20.03.2033	461.688.960	0,33 %
Japanische Staatsanleihe	375.000.000	1,70 %	20.06.2044	461.591.250	0,33 %
Japanische Staatsanleihe	330.550.000	2,20 %	20.03.2051	456.991.986	0,32 %
Japanische Staatsanleihe	427.000.000	1,10 %	20.06.2020	439.831.350	0,31 %
Japanische Staatsanleihe	371.500.000	1,50 %	20.03.2034	437.288.935	0,31 %
Japanische Staatsanleihe	347.000.000	2,20 %	20.03.2031	436.692.560	0,31 %
Japanische Staatsanleihe	364.500.000	1,70 %	20.12.2031	436.678.290	0,31 %
Japanische Staatsanleihe	427.000.000	0,80 %	20.03.2046	429.557.730	0,30 %
Japanische Staatsanleihe	400.000.000	1,10 %	20.12.2021	419.104.000	0,30 %
Japanische Staatsanleihe	398.150.000	1,20 %	20.12.2020	413.741.554	0,29 %
Japanische Staatsanleihe	360.000.000	1,20 %	20.09.2035	405.280.800	0,29 %
Japanische Staatsanleihe	344.000.000	1,60 %	20.06.2030	404.609.360	0,29 %
Japanische Staatsanleihe	385.000.000	0,40 %	20.09.2025	397.604.900	0,28 %
Japanische Staatsanleihe	381.000.000	1,30 %	20.06.2020	394.327.380	0,28 %
Japanische Staatsanleihe	292.000.000	2,40 %	20.03.2037	391.069.760	0,28 %
Japanische Staatsanleihe	380.000.000	0,30 %	20.12.2024	389.351.800	0,28 %

	Kapital Japanischer Yen (¥)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Japanischer Yen (¥)	% des Gesamt- nettovermögens
Japanische Staatsanleihe	374.000.000	0,50 %	20.12.2024	388.481.280	0,27 %
Japanische Staatsanleihe	405.000.000	0,60 %	20.12.2046	384.677.100	0,27 %
Japanische Staatsanleihe	380.000.000	0,10 %	20.12.2021	383.036.200	0,27 %
Japanische Staatsanleihe	309.000.000	2,00 %	20.03.2031	380.910.480	0,27 %
Japanische Staatsanleihe	310.000.000	2,10 %	20.06.2029	379.641.500	0,27 %
Japanische Staatsanleihe	355.700.000	1,00 %	20.09.2021	370.415.309	0,26 %
Japanische Staatsanleihe	303.900.000	2,30 %	20.06.2027	369.007.536	0,26 %
Japanische Staatsanleihe	294.000.000	1,80 %	20.09.2043	368.067.420	0,26 %
Japanische Staatsanleihe	294.000.000	2,20 %	20.12.2029	365.289.120	0,26 %
Japanische Staatsanleihe	314.000.000	2,20 %	20.06.2024	360.098.340	0,25 %
Japanische Staatsanleihe	299.000.000	1,50 %	20.12.2044	353.722.980	0,25 %
Japanische Staatsanleihe	337.000.000	0,90 %	20.06.2022	352.144.780	0,25 %
Japanische Staatsanleihe	350.000.000	0,60 %	20.12.2037	351.683.500	0,25 %
Japanische Staatsanleihe	317.000.000	2,00 %	21.03.2022	345.206.660	0,24 %
Japanische Staatsanleihe	277.000.000	1,70 %	20.03.2032	332.195.020	0,23 %
Japanische Staatsanleihe	266.000.000	2,20 %	20.03.2030	331.329.600	0,23 %
Japanische Staatsanleihe	272.000.000	1,80 %	20.06.2031	328.605.920	0,23 %
Japanische Staatsanleihe	305.000.000	0,60 %	20.03.2024	317.724.600	0,22 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	300.000.000	0,91 %	31.07.2023	314.719.500	0,22 %
Japanische Staatsanleihe	355.000.000	0,30 %	20.06.2046	311.530.250	0,22 %
Japanische Staatsanleihe	302.000.000	1,00 %	20.09.2020	311.144.560	0,22 %
Japanische Staatsanleihe	258.000.000	1,80 %	20.09.2030	310.092.780	0,22 %
Japanische Staatsanleihe	260.550.000	1,60 %	20.03.2032	308.892.447	0,22 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	300.000.000	0,13 %	30.06.2027	299.782.500	0,21 %
Japanische Staatsanleihe	300.000.000	0,80 %	20.12.2047	298.908.000	0,21 %
Japanische Staatsanleihe	223.550.000	2,00 %	20.03.2052	297.104.657	0,21 %
Japanische Staatsanleihe	212.500.000	2,30 %	20.03.2039	283.606.750	0,20 %
Japanische Staatsanleihe	236.450.000	1,60 %	20.06.2032	280.640.141	0,20 %
Japanische Staatsanleihe	206.350.000	2,40 %	20.09.2038	278.622.024	0,20 %
Japanische Staatsanleihe	224.000.000	2,20 %	20.06.2026	265.643.840	0,19 %
Japanische Staatsanleihe	256.150.000	1,40 %	20.09.2019	262.861.130	0,19 %
Japan Finance Organization for Municipalities	250.000.000	1,00 %	14.09.2021	259.065.250	0,18 %
Japanische Staatsanleihe	194.000.000	1,70 %	20.03.2054	240.847.120	0,17 %
Japanische Staatsanleihe	223.200.000	1,40 %	20.03.2020	230.710.680	0,16 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	200.000.000	1,43 %	31.07.2034	230.313.200	0,16 %
Japanische Staatsanleihe	200.000.000	1,40 %	20.03.2055	229.336.000	0,16 %
Japanische Staatsanleihe	195.000.000	2,00 %	20.09.2025	225.480.450	0,16 %
Japanische Staatsanleihe	189.550.000	1,50 %	20.06.2032	222.332.673	0,16 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	200.000.000	0,97 %	31.01.2035	215.374.400	0,15 %
Japanische Staatsanleihe	174.000.000	2,00 %	20.06.2030	213.188.280	0,15 %
Japanische Staatsanleihe	162.350.000	1,90 %	20.03.2053	211.285.537	0,15 %
Japanische Staatsanleihe	176.100.000	1,90 %	20.12.2028	210.626.166	0,15 %
Japanische Staatsanleihe	155.000.000	2,50 %	20.09.2036	210.017.250	0,15 %
Japanische Staatsanleihe	168.000.000	2,40 %	20.06.2028	208.645.920	0,15 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	200.000.000	1,20 %	28.12.2020	207.072.000	0,15 %
Japanische Staatsanleihe	198.000.000	0,60 %	20.09.2023	205.696.260	0,15 %
Japan Finance Organization for Municipalities	200.000.000	0,43 %	12.09.2025	205.221.600	0,15 %
Deposit Insurance Corp. of Japan	200.000.000	0,10 %	19.10.2021	200.591.000	0,14 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	200.000.000	0,17 %	29.10.2027	200.364.800	0,14 %
Japanische Staatsanleihe	191.600.000	0,70 %	20.12.2022	199.181.612	0,14 %
Japanische Staatsanleihe	165.000.000	1,40 %	20.12.2045	190.975.950	0,13 %
Japanische Staatsanleihe	135.000.000	2,20 %	20.03.2050	185.919.300	0,13 %
Japanische Staatsanleihe	155.000.000	1,40 %	20.09.2045	179.344.300	0,13 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	175.000.000	1,50 %	31.05.2019	178.670.975	0,13 %
Japanische Staatsanleihe	171.000.000	1,10 %	20.03.2021	177.660.450	0,13 %
Japanische Staatsanleihe	145.000.000	1,80 %	20.06.2030	174.113.100	0,12 %
Japanische Staatsanleihe	168.700.000	1,30 %	20.12.2019	173.423.600	0,12 %
Japanische Staatsanleihe	158.000.000	1,90 %	20.09.2022	172.943.640	0,12 %
Japanische Staatsanleihe	166.750.000	1,30 %	20.03.2019	169.633.108	0,12 %
Japanische Staatsanleihe	157.750.000	1,50 %	20.03.2019	160.859.253	0,11 %
Japan Finance Organization for Municipalities	150.000.000	1,40 %	12.07.2019	153.176.400	0,11 %
Japanische Staatsanleihe	145.800.000	1,20 %	20.06.2021	152.433.900	0,11 %
Japanische Staatsanleihe	125.000.000	1,60 %	20.06.2045	150.977.500	0,11 %
Japanische Staatsanleihe	123.000.000	2,10 %	20.12.2028	149.784.480	0,11 %
Japanische Staatsanleihe	107.000.000	2,50 %	20.03.2038	146.005.780	0,10 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	135.000.000	0,84 %	29.07.2022	140.009.310	0,10 %
Japanische Staatsanleihe	133.000.000	1,30 %	20.09.2019	136.257.170	0,10 %

	Kapital Japanischer Yen (¥)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Japanischer Yen (¥)	% des Gesamt- nettovermögens
Japanische Staatsanleihe	106.150.000	2,20 %	20.09.2027	128.331.104	0,09 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	100.000.000	2,37 %	20.09.2028	122.003.500	0,09 %
Japanische Staatsanleihe	112.000.000	2,00 %	21.06.2021	120.210.720	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	96.000.000	2,20 %	20.09.2028	117.601.920	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	112.600.000	0,80 %	20.06.2022	117.155.796	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	114.000.000	1,50 %	20.06.2019	116.716.620	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	95.000.000	2,10 %	20.03.2029	116.019.700	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	96.100.000	2,30 %	20.06.2026	114.778.957	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	99.000.000	2,00 %	20.06.2025	114.053.940	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	82.150.000	2,20 %	20.03.2049	112.811.666	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	93.050.000	2,10 %	20.12.2027	111.989.397	0,08 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	100.000.000	1,24 %	31.07.2035	111.895.900	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	88.350.000	2,20 %	20.05.2031	111.381.078	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	97.000.000	1,10 %	20.03.2033	108.205.440	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	104.950.000	0,80 %	20.09.2020	107.556.958	0,08 %
Japanische Staatsanleihe	87.000.000	2,20 %	20.06.2029	107.528.520	0,08 %
Japan Finance Organization for Municipalities	100.000.000	0,92 %	28.07.2023	104.524.500	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	87.500.000	2,20 %	20.09.2026	104.160.875	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	99.400.000	1,10 %	20.09.2021	103.882.940	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	103.400.000	0,10 %	15.06.2019	103.762.934	0,07 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	100.000.000	0,79 %	31.10.2022	103.678.400	0,07 %
Japan Finance Organization for Municipalities	100.000.000	1,47 %	28.04.2020	103.267.700	0,07 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	100.000.000	0,51 %	30.05.2025	103.232.300	0,07 %
Japan Finance Organization for Municipalities	100.000.000	0,68 %	28.03.2023	103.053.200	0,07 %
Japan Finance Organization for Municipalities	100.000.000	0,48 %	13.06.2025	103.037.000	0,07 %
Major Joint Local Government Bond	100.000.000	0,50 %	25.08.2025	102.792.100	0,07 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	100.000.000	0,54 %	28.04.2023	102.730.200	0,07 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	100.000.000	0,90 %	30.10.2020	102.501.000	0,07 %
Japan Finance Organization for Municipalities	101.200.000	1,70 %	22.05.2018	101.864.378	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	85.850.000	2,10 %	20.12.2026	101.831.836	0,07 %
Japan Finance Organization for Municipalities	100.000.000	0,32 %	19.01.2026	101.828.600	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	83.150.000	2,20 %	20.03.2028	101.151.144	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	76.350.000	2,30 %	20.12.2036	100.760.622	0,07 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	100.000.000	0,15 %	27.02.2026	100.412.400	0,07 %
Japan Finance Organization for Municipalities	100.000.000	0,15 %	16.02.2026	100.401.300	0,07 %
Development Bank of Japan, Inc.	100.000.000	0,16 %	18.12.2020	100.298.000	0,07 %
Deposit Insurance Corp. of Japan	100.000.000	0,10 %	17.01.2020	100.171.100	0,07 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	100.000.000	0,16 %	31.08.2027	100.114.900	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	74.000.000	2,50 %	20.06.2036	100.093.140	0,07 %
Japan Finance Organization for Municipalities	100.000.000	0,14 %	16.04.2027	100.084.800	0,07 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	100.000.000	0,14 %	30.04.2027	100.059.700	0,07 %
Japan Finance Organization for Municipalities	100.000.000	0,00 %	30.06.2020	99.965.800	0,07 %
Japan Finance Organization for Municipalities	100.000.000	0,02 %	13.03.2026	99.384.600	0,07 %
Development Bank of Japan, Inc.	100.000.000	0,02 %	16.03.2026	99.348.600	0,07 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	97.000.000	1,40 %	31.07.2019	99.145.155	0,07 %
Japanische Staatsanleihe	71.650.000	2,50 %	20.09.2035	96.567.721	0,07 %
Japan Finance Organization for Municipalities	88.000.000	0,66 %	21.05.2024	91.448.280	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	79.000.000	2,10 %	20.12.2024	90.866.590	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	67.350.000	2,30 %	20.03.2035	88.220.418	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	63.750.000	2,50 %	20.09.2037	86.766.300	0,06 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	85.000.000	1,70 %	30.05.2018	85.587.095	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	65.000.000	2,30 %	20.06.2035	85.251.400	0,06 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	82.000.000	0,81 %	30.11.2022	85.122.068	0,06 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	80.000.000	0,75 %	31.01.2024	83.448.000	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	69.000.000	2,00 %	20.03.2027	81.586.290	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	70.000.000	2,00 %	20.12.2025	81.205.600	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	76.000.000	1,10 %	20.06.2021	79.196.560	0,06 %
Japanische Staatsanleihe	58.050.000	2,50 %	20.06.2034	77.533.322	0,05 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	72.000.000	0,65 %	29.03.2024	74.708.568	0,05 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	71.000.000	0,82 %	28.02.2023	73.889.274	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	64.500.000	1,90 %	20.06.2025	73.825.410	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	59.250.000	2,30 %	20.06.2028	72.969.338	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	59.350.000	2,10 %	20.09.2028	72.074.640	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	62.000.000	2,00 %	20.12.2024	70.879.640	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	60.000.000	2,10 %	20.03.2025	69.258.000	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	60.000.000	2,10 %	20.09.2024	68.721.000	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	57.000.000	1,90 %	20.03.2029	68.340.720	0,05 %

	Kapital Japanischer Yen (¥)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Japanischer Yen (¥)	% des Gesamt- nettovermögens
Japanische Staatsanleihe	59.000.000	2,20 %	20.12.2021	64.412.070	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	54.000.000	2,30 %	20.03.2026	64.237.860	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	54.500.000	1,50 %	20.03.2033	64.057.665	0,05 %
Japanische Staatsanleihe	60.000.000	1,30 %	20.03.2020	61.886.400	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	49.000.000	2,00 %	20.12.2033	61.425.420	0,04 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	57.000.000	0,73 %	28.12.2022	59.005.032	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	41.350.000	2,90 %	20.11.2030	55.548.763	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	42.000.000	2,40 %	20.03.2034	55.349.280	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	52.000.000	2,20 %	21.09.2020	55.284.320	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	54.000.000	1,40 %	20.06.2019	55.207.980	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	46.000.000	2,10 %	20.12.2025	53.730.300	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	44.000.000	2,10 %	20.06.2028	53.274.320	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	43.000.000	2,40 %	20.03.2028	53.181.110	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	45.700.000	2,40 %	20.06.2024	53.001.946	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	39.200.000	2,50 %	20.03.2036	52.954.496	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	41.000.000	2,30 %	20.05.2032	52.698.940	0,04 %
Japan Finance Organization for Municipalities	50.000.000	0,80 %	15.09.2023	52.178.800	0,04 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	50.000.000	0,69 %	28.12.2023	51.960.000	0,04 %
Japan Finance Organization for Municipalities	50.000.000	0,67 %	12.04.2024	51.950.850	0,04 %
Japan Finance Organization for Municipalities	50.000.000	1,00 %	15.11.2021	51.887.300	0,04 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	50.000.000	0,67 %	30.11.2023	51.870.000	0,04 %
Japan Finance Organization for Municipalities	50.000.000	0,80 %	28.10.2022	51.709.950	0,04 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	50.000.000	1,00 %	30.09.2020	51.349.250	0,04 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	50.000.000	1,71 %	20.03.2019	50.999.350	0,04 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	50.000.000	0,32 %	30.01.2026	50.920.150	0,04 %
Japan Finance Organization for Municipalities	50.000.000	1,90 %	22.06.2018	50.421.700	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	38.000.000	2,30 %	20.12.2035	49.938.840	0,04 %
Japanische Staatsanleihe	42.000.000	2,10 %	20.09.2025	48.889.680	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	33.900.000	2,40 %	20.03.2048	48.208.512	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	40.000.000	2,10 %	20.09.2027	47.980.800	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	36.000.000	2,40 %	20.12.2034	47.708.280	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	43.000.000	1,70 %	20.12.2022	46.847.210	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	38.000.000	2,10 %	20.03.2026	44.576.280	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	42.000.000	2,50 %	20.03.2020	44.432.220	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	36.000.000	2,10 %	20.03.2024	40.869.000	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	34.000.000	2,10 %	20.06.2027	40.642.580	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	35.000.000	1,40 %	20.12.2032	40.604.900	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	38.000.000	2,60 %	20.03.2019	39.257.800	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	29.000.000	2,50 %	20.09.2034	38.831.290	0,03 %
Japanische Staatsanleihe	33.200.000	1,90 %	20.12.2023	37.115.940	0,03 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	33.000.000	1,10 %	28.12.2021	34.410.123	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	30.000.000	2,10 %	20.12.2021	32.632.800	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	27.000.000	2,20 %	20.03.2026	31.896.990	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	26.000.000	2,30 %	20.09.2026	31.179.720	0,02 %
Japan Finance Organization for Municipalities	30.000.000	0,80 %	28.11.2022	31.037.370	0,02 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	30.000.000	1,35 %	19.03.2020	30.853.530	0,02 %
Japan Finance Organization for Municipalities	30.000.000	1,30 %	20.01.2020	30.791.250	0,02 %
Japan Finance Organization for Municipalities	30.000.000	0,31 %	28.07.2023	30.462.270	0,02 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	20.000.000	2,87 %	20.12.2046	29.486.320	0,02 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	27.000.000	1,00 %	30.11.2021	28.030.023	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	23.000.000	1,70 %	20.06.2033	27.748.810	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	24.000.000	1,90 %	20.03.2024	26.946.720	0,02 %
Development Bank of Japan, Inc.	26.000.000	1,40 %	17.02.2020	26.765.284	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	21.000.000	2,10 %	20.09.2033	26.611.410	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	25.000.000	2,20 %	22.06.2020	26.431.000	0,02 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	25.000.000	0,88 %	30.06.2023	26.169.125	0,02 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	25.000.000	1,30 %	29.05.2020	25.772.150	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	20.000.000	2,40 %	20.02.2030	25.388.400	0,02 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	25.000.000	1,30 %	30.01.2019	25.351.100	0,02 %
Japan Finance Organization for Municipalities	20.000.000	2,29 %	27.04.2029	24.447.600	0,02 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	23.000.000	0,83 %	31.01.2023	23.942.218	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	19.000.000	1,80 %	22.11.2032	23.129.650	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	20.000.000	2,50 %	21.12.2020	21.561.400	0,02 %
Japanische Staatsanleihe	20.300.000	1,00 %	20.03.2023	21.457.709	0,02 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	20.000.000	1,30 %	30.04.2021	20.851.380	0,01 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	20.000.000	0,64 %	28.06.2024	20.774.700	0,01 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	20.000.000	0,90 %	18.03.2022	20.734.680	0,01 %

	Kapital Japanischer Yen (¥)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Japanischer Yen (¥)	% des Gesamt- nettovermögens
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	20.000.000	1,60 %	31.10.2018	20.265.020	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	18.100.000	1,80 %	20.06.2023	19.975.884	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	16.000.000	2,10 %	20.06.2025	18.552.480	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	16.200.000	1,90 %	20.03.2025	18.465.408	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	17.100.000	1,40 %	20.12.2022	18.374.292	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	17.000.000	2,90 %	20.09.2019	17.882.130	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	17.000.000	0,80 %	20.06.2023	17.829.090	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	15.050.000	2,00 %	20.06.2022	16.465.152	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	14.700.000	1,90 %	20.09.2023	16.365.951	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	14.850.000	2,40 %	20.03.2020	15.677.145	0,01 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	15.000.000	0,41 %	28.02.2025	15.378.165	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	13.300.000	2,00 %	20.03.2025	15.256.031	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	12.000.000	2,30 %	20.05.2030	15.128.880	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	13.000.000	2,20 %	20.03.2024	14.839.240	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	13.100.000	1,80 %	20.12.2023	14.566.283	0,01 %
Development Bank of Japan, Inc.	14.000.000	0,82 %	20.09.2022	14.518.602	0,01 %
Japan Finance Organization for Municipalities	13.700.000	0,67 %	17.03.2023	14.155.415	0,01 %
Japan Finance Corp.	13.000.000	1,30 %	17.09.2019	13.285.727	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	10.000.000	2,40 %	20.11.2031	12.918.400	0,01 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	10.000.000	2,42 %	20.06.2028	12.214.990	0,01 %
Japan Finance Organization for Municipalities	10.000.000	2,29 %	25.04.2028	12.075.600	0,01 %
Japanische Staatsanleihe	7.000.000	1,50 %	20.03.2019	7.138.460	0,01 %
Development Bank of Japan, Inc.	5.000.000	1,70 %	20.09.2022	5.391.720	0,00 %
Japan Expressway Holding & Debt Repayment Agency	4.700.000	1,40 %	25.12.2018	4.764.113	0,00 %
Japanische Staatsanleihe	3.000.000	2,10 %	22.03.2021	3.214.230	0,00 %
				135.506.574.385	95,76 %
Summe Anleihen				141.048.146.986	99,67 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				141.048.146.986	99,67 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Japanischer Yen (¥)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures 0,00 % (2016: 0,00 %)				
Japan 10 Year Bond März 2018	(1)	(150.930.000)	150.000	0,00 %
			150.000	0,00 %

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Japanischer Yen (¥)	% des Gesamt- nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte (0,00 % (2016: 0,00 %))							
JPY	43.327.721	GBP	(284.322)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	5.731	0,00 %
JPY	7.567	GBP	(50)	BNP Paribas	04.01.2018	(33)	(0,00 %)
GBP	952.109	JPY	(145.089.274)	Brown Brothers Harriman & Co.	05.01.2018	(17.071)	(0,00 %)
JPY	101.643.804	GBP	(667.787)	UBS	05.01.2018	(106.408)	(0,00 %)
						(117.781)	(0,00 %)

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Japanischer Yen (¥)	% des Gesamt- nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte zu Absicherungszwecken auf Ebene der Anteilsklasse 0,10 % (2016: 0,17 %)							
GBP	139.988.216	JPY	(21.194.075.963)	BNP Paribas	05.01.2018	135.836.626	0,10 %
JPY	21.860.646.006	GBP	(143.446.148)	JP Morgan Chase	05.01.2018	3.850.627	0,00 %
GBP	2.480.078	JPY	(374.067.735)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	3.820.171	0,00 %
GBP	789.576	JPY	(119.542.546)	BNP Paribas	05.01.2018	764.582	0,00 %
GBP	485.690	JPY	(73.600.864)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	403.338	0,00 %
GBP	280.563	JPY	(42.583.449)	BNP Paribas	05.01.2018	165.769	0,00 %
GBP	64.886	JPY	(9.734.464)	BNP Paribas	05.01.2018	152.187	0,00 %
GBP	134.563	JPY	(20.417.418)	BNP Paribas	05.01.2018	85.870	0,00 %
GBP	243.640	JPY	(37.069.123)	BNP Paribas	05.01.2018	54.171	0,00 %
GBP	185.358	JPY	(28.201.941)	UBS	02.02.2018	32.386	0,00 %
JPY	145.089.274	GBP	(952.109)	Brown Brothers Harriman & Co.	05.01.2018	17.071	0,00 %
GBP	8.694	JPY	(1.314.401)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	10.311	0,00 %
GBP	6.398	JPY	(968.806)	BNP Paribas	05.01.2018	6.080	0,00 %
GBP	6.196	JPY	(940.956)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	3.064	0,00 %
GBP	1.001	JPY	(150.769)	BNP Paribas	05.01.2018	1.754	0,00 %

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf- betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Japanischer Yen (¥)	% des Gesamt- nettovermögens
GBP	566	JPY	(85.872)	BNP Paribas	05.01.2018	363	0,00 %
GBP	319	JPY	(48.267)	BNP Paribas	05.01.2018	308	0,00 %
GBP	50	JPY	(7.570)	BNP Paribas	05.01.2018	30	0,00 %
GBP	26	JPY	(3.886)	BNP Paribas	05.01.2018	19	0,00 %
JPY	1.514	GBP	(10)	BNP Paribas	05.01.2018	(7)	(0,00 %)
JPY	144.748	GBP	(956)	Barclays Bank Plc	05.01.2018	(850)	(0,00 %)
GBP	855.955	JPY	(130.385.780)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(4.216)	(0,00 %)
JPY	5.291.615	GBP	(34.910)	BNP Paribas	05.01.2018	(27.664)	(0,00 %)
JPY	8.528.206	GBP	(56.329)	BNP Paribas	05.01.2018	(54.546)	(0,00 %)
GBP	143.493.629	JPY	(21.860.646.006)	JP Morgan Chase	02.02.2018	(3.276.734)	(0,00 %)
						141.840.710	0,10 %
Summe Derivative Finanzinstrumente						141.872.929	0,10 %
						Marktwert Japanischer Yen (¥)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva						322.413.033	0,23 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)						141.512.432.948	100,00 %
						% des Gesamt- Japanischer Yen (¥) nettovermögens	
Analyse des Gesamtvermögens							
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind						132.835.935.075	93,87 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						—	0,00 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						8.212.211.911	5,80 %
(d) Derivative Finanzinstrumente						141.872.929	0,10 %
(e) Sonstige Aktiva und Passiva						322.413.033	0,23 %
Gesamt Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)						141.512.432.948	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Kapital Japanischer Yen (¥)	Kosten Japanischer Yen (¥)		Kapital Japanischer Yen (¥)	Erlöse Japanischer Yen (¥)
Käufe			Verkäufe		
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.6.2022	3.740.000.000	3.775.551.700	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.6.2018	2.350.000.000	2.359.165.000
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.9.2022	3.338.000.000	3.370.760.370	Japanische Staatsanleihe 1,80 % 20.12.2031	1.644.800.000	2.005.728.408
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.12.2021	2.330.000.000	2.356.291.400	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.12.2021	1.950.000.000	1.974.516.724
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.5.2019	2.150.000.000	2.160.978.000	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.9.2026	1.875.000.000	1.892.812.500
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.6.2027	2.050.000.000	2.060.840.500	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.12.2018	1.350.000.000	1.354.339.000
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.3.2022	2.000.000.000	2.023.138.829	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.6.2022	1.100.000.000	1.111.198.000
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.9.2027	2.002.400.000	2.011.989.722	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.1.2019	1.100.000.000	1.105.192.000
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.9.2019	1.800.000.000	1.807.794.000	Japanische Staatsanleihe 0,70 % 20.3.2037	1.055.000.000	1.085.546.200
Japanische Staatsanleihe 1,80 % 20.12.2031	1.315.000.000	1.600.847.100	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.5.2019	1.000.000.000	1.004.400.000
Japanische Staatsanleihe 0,70 % 20.3.2037	1.522.000.000	1.554.250.190	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.3.2022	900.000.000	910.026.000
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.6.2020	1.400.000.000	1.409.464.000	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.4.2018	850.000.000	852.483.500
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.3.2027	1.355.000.000	1.361.704.250	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.8.2018	850.000.000	851.935.500
Japanische Staatsanleihe 0,60 % 20.12.2036	1.260.000.000	1.254.267.150	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.11.2018	800.000.000	801.899.000
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.11.2019	1.225.000.000	1.232.348.000	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.7.2018	780.000.000	781.919.400
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.12.2026	1.200.000.000	1.204.435.000	Japanische Staatsanleihe 0,60 % 20.6.2024	725.000.000	758.107.750
Japanische Staatsanleihe 0,60 % 20.6.2037	1.112.000.000	1.121.939.660	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.12.2019	750.000.000	755.580.000
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.1.2019	1.100.000.000	1.107.721.000	Japanische Staatsanleihe 0,20 % 20.12.2018	738.000.000	740.405.880
Japanische Staatsanleihe 1,30 % 20.6.2035	900.000.000	1.027.836.000	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.5.2018	730.000.000	732.285.800
Japanische Staatsanleihe 0,20 % 20.6.2019	1.000.000.000	1.009.860.000	Japanische Staatsanleihe 1,50 % 20.9.2018	714.850.000	726.237.560
Japanische Staatsanleihe 0,60 % 20.9.2037	1.000.350.000	1.003.369.720	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.9.2019	700.000.000	703.005.000
Japanische Staatsanleihe 0,80 % 20.6.2047	972.000.000	963.137.160	Japanische Staatsanleihe 1,70 % 20.3.2044	550.000.000	676.616.500
Japanische Staatsanleihe 2,10 % 20.3.2027	800.000.000	959.056.000	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.12.2026	600.000.000	604.980.000
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.2.2019	950.000.000	953.640.000	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.3.2018	600.000.000	602.446.200
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.12.2019	845.000.000	851.869.550	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.3.2021	500.000.000	503.435.000
Japanische Staatsanleihe 2,30 % 20.3.2040	630.000.000	844.958.600	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.3.2018	500.000.000	502.145.000
Japanische Staatsanleihe 0,80 % 20.9.2047	824.300.000	815.018.172	Japanische Staatsanleihe 1,80 % 20.12.2032	390.250.000	473.953.870
Japanische Staatsanleihe 0,90 % 20.3.2057	779.200.000	750.213.308	Japanische Staatsanleihe 0,20 % 20.9.2018	445.000.000	446.472.950
Japanische Staatsanleihe 1,90 % 20.9.2030	600.000.000	732.822.000	Japanische Staatsanleihe 0,60 % 20.3.2024	400.000.000	419.814.000
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.12.2022	700.000.000	707.021.000	Japanische Staatsanleihe 0,30 % 20.12.2025	400.000.000	411.464.000
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.12.2018	700.000.000	704.683.000	Japanische Staatsanleihe 0,30 % 20.6.2018	409.000.000	410.987.740
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.3.2019	700.000.000	704.298.000	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 20.9.2021	400.000.000	404.968.000
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.10.2019	700.000.000	703.435.000	Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.10.2018	400.000.000	401.012.000
Japanische Staatsanleihe 0,10 % 15.8.2019	700.000.000	703.398.500	Japanische Staatsanleihe 0,60 % 20.12.2036	365.000.000	367.786.450
			Japanische Staatsanleihe 0,50 % 20.12.2024	350.000.000	365.823.500

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 größten Käufe und die 20 größten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	Japanischer Yen (¥) Zum 31. Dezember 2017	Japanischer Yen (¥) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	141.048.146.986	110.005.301.346
Derivative Finanzinstrumente	145.360.458	189.525.970
Barmittel und liquide Vermögenswerte	634.083.039	611.239.064
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	213.132.166	168.790.962
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	1.852.585.012	5.883.963.639
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	1.943.830.013	420.996.721
Bareinschüsse für Futures	8.647	—
Summe Umlaufvermögen	145.837.146.321	117.279.817.702
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	3.487.529	27.527
Überziehungskredit	2.109.456	432.824
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	—	96.308
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	3.977.414.564	6.662.647.702
Zahlbare Dividenden	1.483.126	1.702.555
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	315.881.456	246.724.179
Zahlbare Verwaltungsgebühren	24.337.242	17.759.943
Summe kurzfristige Passiva	4.324.713.373	6.929.391.038
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	141.512.432.948	110.350.426.664

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle JPY-Anteile (¥)			
Nettovermögen	115.116.446.153	83.140.508.720	43.115.126.571
Anzahl der umlaufenden Anteile	7.081.269	5.114.008	2.733.396
Nettoinventarwert je Anteil	16.256,47	16.257,41	15.773,47
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Gegenwert in JPY (¥)	567.376	8.991.837.445	550.469
Nettovermögen	5.037	77.093.819	4.576
Anzahl der umlaufenden Anteile	44	702.588	44
Nettoinventarwert je Anteil	114,48	109,73	103,23
JPY-Anlegeranteile (¥)			
Nettovermögen	938.704.547	414.764.820	700.803.025
Anzahl der umlaufenden Anteile	58.249	25.723	44.772
Nettoinventarwert je Anteil	16.115,38	16.124,28	15.652,71
USD-Anlegeranteile (\$)			
Gegenwert in JPY (¥)	352.081.146	410.996.834	720.102.331
Nettovermögen	3.125.443	3.523.787	5.986.137
Anzahl der umlaufenden Anteile	21.868	25.513	46.048
Nettoinventarwert je Anteil	142,92	138,12	130,00
Institutionelle Plus JPY-Anteile (¥)			
Nettovermögen	936.081	935.369	906.744
Anzahl der umlaufenden Anteile	88	88	88
Nettoinventarwert je Anteil	10.637,28	10.629,19	10.352,14
Institutionelle Plus JPY-Ertragsanteile (¥)			
Nettovermögen	3.090.551.776	3.116.316.579	4.792.882.174
Anzahl der umlaufenden Anteile	298.500	300.700	475.641
Nettoinventarwert je Anteil	10.353,61	10.363,54	10.076,68
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in JPY (¥)	22.013.145.869	14.275.066.897	9.401.125.538
Nettovermögen	144.455.278	99.049.850	53.022.997
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.304.343	897.928	501.706
Nettoinventarwert je Anteil	110,75	110,31	105,69

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	Japanischer Yen (¥) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Japanischer Yen (¥) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	359.810.666	322.959.138
Verschiedene Erträge	1.276	2.661.045
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	1.340.956.027	(875.312.111)
Summe Anlageerträge/(-verluste)	1.700.767.969	(549.691.928)
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	253.881.149	165.186.612
Transaktionsgebühren und Provisionen	38.132	21.257
Sonstige Aufwendungen	—	202.778
Summe Aufwendungen	253.919.281	165.410.647
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	843.495	660.714
Ausgezahlte Ausschüttungen	5.894.859	9.952.265
Ertragsausgleich	7.975	701.074
Summe Finanzierungskosten	6.746.329	11.314.053
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1.440.102.359	(726.416.628)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	1.440.102.359	(726.416.628)

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	Japanischer Yen (¥) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	Japanischer Yen (¥) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	1.440.102.359	(726.416.628)
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	53.771.405.064	67.903.587.546
Rücknahmen	(24.049.501.139)	(15.558.241.106)
Summe Kapitalgeschäfte ¹	29.721.903.925	52.345.346.440
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	31.162.006.284	51.618.929.812
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	110.350.426.664	58.731.496.852
Zum Jahresende	141.512.432.948	110.350.426.664

1 Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund

Verwaltet durch The Vanguard Group, Inc.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds strebt eine Rendite an, die der Wertentwicklung des Bloomberg Barclays EUR Non-Government Float Adjusted Bond Index entspricht, eines marktgewichteten Index für auf Euro lautende festverzinsliche Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating und Laufzeiten von mehr als einem Jahr, ausgenommen Schatztitel und regierungsnahe Wertpapiere aus der Eurozone.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	1.016	3.432
Rendite auf Endfälligkeit	0,5 % ³	0,5 %
Durchschnittlicher Kupon	2,0 %	2,1 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	5,9 Jahre	6,0 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	A1	A1
Durchschnittliche Duration	5,5 Jahre	5,5 % Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,25 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,15 %	
Kurzfristige Reserven	1,5 %	—

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

	Fonds
Industriegüter	24,9 %
Forderungsbesicherte Wertpapiere	24,8
Finanzinstitute	21,6
Supranationale Anleihen	15,5
Versorger	4,2
Staatlich	3,4
Behörden	2,1
Treasury/Federal	1,7
Barmittel	1,1
Lokale Behörde	0,7

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	28,3 %
Aa	17,0
A	24,3
Baa	29,2
nicht eingestuft	1,2

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	48,5 %
5-10 Jahre	37,7
Mehr als 10 Jahre	13,8

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit

Durchschnittliche Fälligkeit	Kurz	Mittel	Lang
Kreditqualität Staats-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays EUR Non-Government Float Adjusted Bond Index.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays EUR Non-Government Float Adjusted Bond Index

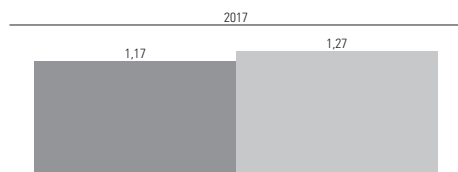
Abgesichert in Euro

	Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017 Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von € 5.000.000
Institutionelle Anteile, abgesichert in Euro	1,17 %	€ 5.058.610
Benchmark	1,27	5.063.456

	Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017 Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von € 200.000.000
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in Euro	-0,77 %	€ 198.455.615
Benchmark	-0,49	199.024.591

Der Tracking-Unterschied für den Zeitraum betrug 0,10 Prozentpunkte für in Euro abgesicherte institutionelle Anteile und 0,28 Prozentpunkte für in Euro abgesicherte institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 18. Juli 2017–31. Dezember 2017



■ Institutionelle Anteile, abgesichert in Euro
■ Benchmark

¹ 18. Juli 2017.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 97,91 %					
Australien 2,19 %					
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	150.000	0,38 %	19.11.2019	151.809	0,11 %
Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd.	100.000	3,13 %	26.09.2023	113.562	0,08 %
National Australia Bank Ltd.	100.000	2,25 %	06.06.2025	111.739	0,08 %
Wesfarmers Ltd.	100.000	2,75 %	02.08.2022	110.482	0,08 %
Telstra Corp., Ltd.	100.000	2,50 %	15.09.2023	110.313	0,08 %
National Australia Bank Ltd.	100.000	4,00 %	13.07.2020	110.008	0,08 %
Commonwealth Bank of Australia	100.000	4,38 %	25.02.2020	109.415	0,08 %
Optus Finance Pty Ltd.	100.000	3,50 %	15.09.2020	109.033	0,08 %
SGSP Australia Assets Pty Ltd.	100.000	2,00 %	30.06.2022	106.524	0,08 %
Aurizon Network Pty Ltd.	100.000	2,00 %	18.09.2024	105.574	0,08 %
Commonwealth Bank of Australia	100.000	1,63 %	10.02.2031	105.295	0,08 %
Origin Energy Finance Ltd.	100.000	2,88 %	11.10.2019	104.937	0,08 %
Westpac Banking Corp.	100.000	1,50 %	24.03.2021	104.882	0,08 %
Rio Tinto Finance plc	100.000	2,00 %	11.05.2020	104.494	0,08 %
Scentre Group Trust 1/Scentre Group Trust 2	100.000	1,38 %	22.03.2023	103.360	0,08 %
APT Pipelines Ltd.	100.000	2,00 %	22.03.2027	103.300	0,08 %
Commonwealth Bank of Australia [^]	100.000	2,00 %	22.04.2027	103.297	0,08 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	100.000	1,13 %	13.05.2020	103.047	0,08 %
Macquarie Bank Ltd.	100.000	1,13 %	20.01.2022	102.887	0,08 %
National Australia Bank Ltd.	100.000	1,25 %	18.05.2026	102.762	0,08 %
National Australia Bank Ltd.	100.000	0,88 %	20.01.2022	102.196	0,07 %
Westpac Banking Corp.	100.000	0,63 %	14.01.2022	102.029	0,07 %
Macquarie Bank Ltd.	100.000	1,00 %	16.09.2019	101.729	0,07 %
National Australia Bank Ltd.	100.000	0,88 %	19.02.2027	100.261	0,07 %
Westpac Banking Corp.	100.000	0,50 %	17.05.2024	100.146	0,07 %
Westpac Banking Corp.	100.000	0,25 %	17.01.2022	99.766	0,07 %
Commonwealth Bank of Australia	100.000	0,38 %	11.04.2024	99.323	0,07 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	100.000	0,75 %	29.09.2026	98.576	0,07 %
				2.980.746	2,19 %
Österreich 0,96 %					
Erste Group Bank AG	200.000	0,63 %	19.01.2023	204.094	0,15 %
Telekom Finanzmanagement GmbH	100.000	3,50 %	04.07.2023	115.330	0,09 %
OMV AG	100.000	4,25 %	12.10.2021	115.160	0,08 %
UniCredit Bank Austria AG	100.000	1,88 %	29.10.2020	105.515	0,08 %
KA Finanz AG	100.000	1,63 %	19.02.2021	104.711	0,08 %
BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG	100.000	1,88 %	18.09.2019	103.649	0,08 %
JAB Holdings BV	100.000	1,25 %	22.05.2024	101.639	0,08 %
Raiffeisen-Landesbank Steiermark AG	100.000	0,63 %	20.01.2023	101.618	0,07 %
Hypoe NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG	100.000	0,50 %	11.09.2020	101.445	0,07 %
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	100.000	0,38 %	13.09.2024	99.474	0,07 %
OMV AG	100.000	1,00 %	14.12.2026	98.631	0,07 %
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG	50.000	1,75 %	02.10.2020	52.553	0,04 %
				1.303.819	0,96 %
Belgien 1,58 %					
Anheuser-Busch InBev SA	250.000	2,70 %	31.03.2026	282.799	0,21 %
Belfius Bank SA	200.000	0,75 %	10.02.2025	203.430	0,15 %
KBC Bank NV	200.000	1,00 %	25.02.2019	203.172	0,15 %
Elia System Operator SA	100.000	3,00 %	07.04.2029	115.303	0,08 %
Anheuser-Busch InBev SA	100.000	4,00 %	02.06.2021	112.975	0,08 %
Anheuser-Busch InBev SA	100.000	2,75 %	17.03.2036	109.745	0,08 %
Argenta Spaarbank NV [^]	100.000	3,88 %	24.05.2026	108.480	0,08 %
Anheuser-Busch InBev SA	100.000	1,95 %	30.09.2021	106.372	0,08 %
Anheuser-Busch InBev SA	100.000	1,88 %	20.01.2020	103.857	0,08 %
KBC Group NV [^]	100.000	2,38 %	25.11.2024	103.826	0,08 %
KBC Group NV [^]	100.000	1,88 %	11.03.2027	103.324	0,08 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Anheuser-Busch InBev SA	100.000	0,88 %	17.03.2022	102.418	0,08 %
KBC Bank NV	100.000	0,45 %	22.01.2022	101.822	0,07 %
Brussels Airport Co. NV	100.000	1,00 %	03.05.2024	100.553	0,07 %
Belfius Bank SA	100.000	0,75 %	12.09.2022	100.241	0,07 %
KBC Bank NV	100.000	0,75 %	24.10.2027	99.613	0,07 %
Anheuser-Busch InBev SA	100.000	1,50 %	18.04.2030	99.575	0,07 %
				2.157.505	1,58 %
Bulgarien 0,25 %					
Bulgaria Government International Bond	100.000	2,95 %	03.09.2024	115.168	0,09 %
Bulgaria Government International Bond	100.000	3,00 %	21.03.2028	115.150	0,08 %
Bulgaria Government International Bond	100.000	2,00 %	26.03.2022	108.500	0,08 %
				338.818	0,25 %
Kanada 2,19 %					
Province Ontario Kanada	200.000	1,88 %	21.05.2024	217.568	0,16 %
Province Ontario Kanada	200.000	4,00 %	03.12.2019	216.665	0,16 %
Bank of Montreal	200.000	1,00 %	07.05.2019	203.617	0,15 %
Bank of Nova Scotia	200.000	1,00 %	02.04.2019	203.359	0,15 %
Bank of Montreal	200.000	0,13 %	19.04.2021	200.947	0,15 %
Provinz Quebec (Kanada)	200.000	0,88 %	04.05.2027	200.413	0,15 %
Provinz Quebec (Kanada)	100.000	2,38 %	22.01.2024	111.638	0,08 %
CDP Financial, Inc.	100.000	3,50 %	23.06.2020	108.106	0,08 %
Canada Government International Bond	100.000	3,50 %	13.01.2020	107.989	0,08 %
Provinz Quebec (Kanada)	100.000	5,00 %	29.04.2019	107.141	0,08 %
Bank of Nova Scotia	100.000	0,75 %	17.09.2021	102.603	0,08 %
Bank of Montreal	100.000	0,75 %	21.09.2022	102.560	0,08 %
Royal Bank of Canada	100.000	0,50 %	16.12.2020	101.704	0,08 %
Toronto-Dominion Bank	100.000	0,50 %	15.06.2020	101.684	0,08 %
Royal Bank of Canada	100.000	0,75 %	19.06.2019	101.630	0,07 %
Toronto-Dominion Bank	100.000	0,63 %	29.07.2019	101.505	0,07 %
Caisse Centrale Desjardins	100.000	0,38 %	25.11.2020	101.284	0,07 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	100.000	0,25 %	28.01.2020	101.042	0,07 %
Toronto-Dominion Bank	100.000	0,38 %	27.04.2023	100.598	0,07 %
Bank of Nova Scotia	100.000	0,38 %	06.04.2022	99.939	0,07 %
Bank of Montreal	100.000	0,20 %	26.01.2023	99.644	0,07 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	100.000	0,00 %	25.07.2022	99.110	0,07 %
National Bank of Canada	100.000	0,00 %	29.09.2023	97.991	0,07 %
				2.988.737	2,19 %
Kaimaninseln 0,09 %					
IPIC GMTN Ltd.	100.000	5,88 %	14.03.2021	117.584	0,09 %
				117.584	0,09 %
Chile 0,15 %					
Chile Government International Bond	100.000	1,75 %	20.01.2026	106.330	0,08 %
Chile Government International Bond	100.000	1,88 %	27.05.2030	104.155	0,07 %
				210.485	0,15 %
China 0,66 %					
Export-Import Bank von China	200.000	0,75 %	28.05.2023	197.900	0,15 %
State Grid Europe Development 2014 plc	100.000	1,50 %	26.01.2022	102.921	0,08 %
China Development Bank	100.000	0,50 %	01.06.2021	99.982	0,08 %
Export-Import Bank von China	100.000	0,25 %	14.03.2020	99.950	0,07 %
Bank of China Ltd.	100.000	0,75 %	12.07.2021	99.947	0,07 %
Export-Import Bank von China	100.000	0,25 %	02.12.2019	99.946	0,07 %
China Development Bank Corp.	100.000	0,13 %	03.11.2019	99.788	0,07 %
China Development Bank	100.000	0,38 %	16.11.2021	99.270	0,07 %
				899.704	0,66 %
Kolumbien 0,09 %					
Colombia Government International Bond	100.000	3,88 %	22.03.2026	116.489	0,09 %
				116.489	0,09 %
Tschechische Republik 0,25 %					
Tschechische Republik Internationale	100.000	3,88 %	24.05.2022	117.000	0,09 %
CEZ A.S.	100.000	3,00 %	05.06.2028	111.794	0,08 %
Tschechische Republik Internationale	100.000	4,13 %	18.03.2020	109.772	0,08 %
				338.566	0,25 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Dänemark 1,09 %					
Danske Bank A/S	200.000	0,13 %	14.02.2022	200.454	0,15 %
Carlsberg Breweries A/S	100.000	2,50 %	28.05.2024	109.820	0,08 %
ISS Global A/S	100.000	2,13 %	02.12.2024	106.719	0,08 %
Jyske Bank A/S^	100.000	2,25 %	05.04.2029	102.541	0,08 %
Danske Bank A/S	100.000	0,38 %	08.09.2020	101.432	0,08 %
Jyske Bank A/S	100.000	0,63 %	14.04.2021	101.221	0,08 %
Nykredit Realkredit A/S	100.000	0,75 %	14.07.2021	101.215	0,07 %
Danske Bank A/S	100.000	0,25 %	04.06.2020	101.090	0,07 %
TDC A/S	100.000	1,75 %	27.02.2027	101.090	0,07 %
Kommunekredit	100.000	0,63 %	11.05.2026	99.944	0,07 %
BRFkredit A/S	100.000	0,25 %	01.07.2023	99.651	0,07 %
Danske Bank A/S	100.000	0,75 %	22.11.2027	99.201	0,07 %
Danske Bank A/S	100.000	0,25 %	28.11.2022	98.936	0,07 %
Orsted A/S^	50.000	6,25 %	26.06.3013	61.009	0,05 %
				1.484.323	1,09 %
Finnland 1,05 %					
Nordea Mortgage Bank plc	200.000	1,25 %	14.01.2019	203.357	0,15 %
OP Mortgage Bank	200.000	0,05 %	22.02.2023	198.442	0,15 %
Citycon Treasury BV	100.000	2,38 %	16.09.2022	107.020	0,08 %
OP Corporate Bank plc	100.000	2,00 %	03.03.2021	106.032	0,08 %
Sampo OYJ	100.000	1,50 %	16.09.2021	104.470	0,08 %
Danske Kiinnitysluottopankki OYJ	100.000	1,63 %	27.09.2019	103.375	0,08 %
Nordea Mortgage Bank plc	100.000	0,63 %	19.10.2022	102.282	0,08 %
OP Mortgage Bank	100.000	0,75 %	11.06.2019	101.601	0,07 %
Nordea Mortgage Bank plc	100.000	0,13 %	17.06.2020	100.828	0,07 %
SP-Mortgage Bank plc	100.000	0,13 %	24.10.2022	99.538	0,07 %
OP Mortgage Bank	100.000	0,25 %	13.03.2024	99.459	0,07 %
Nordea Mortgage Bank plc	100.000	0,63 %	17.03.2027	99.153	0,07 %
				1.425.557	1,05 %
Frankreich 16,56 %					
Caisse Francaise de Financement Local	400.000	3,50 %	24.09.2020	440.740	0,32 %
BNP Paribas SA	300.000	4,13 %	14.01.2022	347.567	0,26 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	300.000	4,38 %	17.03.2021	343.734	0,25 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	300.000	3,00 %	28.11.2023	342.114	0,25 %
Cie de Financement Foncier SA	300.000	2,00 %	07.05.2024	331.448	0,24 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	200.000	4,00 %	17.06.2022	235.750	0,17 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	200.000	3,30 %	23.09.2022	230.892	0,17 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	200.000	3,90 %	18.01.2021	225.280	0,17 %
BPCE SFH SA	200.000	2,38 %	29.11.2023	224.667	0,17 %
Credit Agricole SA	200.000	3,90 %	19.04.2021	223.581	0,16 %
Societe Generale SFH SA	200.000	2,00 %	29.04.2024	221.221	0,16 %
Cie de Financement Foncier SA	200.000	3,50 %	05.11.2020	221.103	0,16 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	200.000	4,13 %	20.07.2020	220.890	0,16 %
BPCE SA^	200.000	2,75 %	30.11.2027	215.969	0,16 %
Societe Generale SA	200.000	2,63 %	27.02.2025	215.662	0,16 %
Sanofi	200.000	4,13 %	11.10.2019	215.367	0,16 %
Societe Generale SFH SA	200.000	1,63 %	05.01.2021	211.016	0,16 %
GELF Bond Issuer I SA	200.000	1,75 %	22.11.2021	208.811	0,15 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	200.000	1,38 %	22.04.2020	207.810	0,15 %
BNP Paribas SA	200.000	1,50 %	25.05.2028	207.363	0,15 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	200.000	0,38 %	21.10.2021	203.561	0,15 %
Cie de Financement Foncier SA	200.000	0,38 %	29.10.2020	203.426	0,15 %
Caisse Francaise de Financement Local	200.000	0,38 %	16.09.2019	202.546	0,15 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	200.000	0,25 %	02.09.2021	202.527	0,15 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	200.000	0,13 %	28.08.2020	202.073	0,15 %
Caisse Francaise de Financement Local	200.000	0,63 %	13.04.2026	200.449	0,15 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	200.000	0,38 %	30.09.2024	199.959	0,15 %
Cie de Saint-Gobain	200.000	0,00 %	27.03.2020	199.698	0,15 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	200.000	0,75 %	15.09.2027	199.503	0,15 %
Engie SA	200.000	0,38 %	28.02.2023	199.320	0,15 %
Total Capital International SA	200.000	0,25 %	12.07.2023	198.016	0,15 %
Veolia Environnement SA	100.000	6,13 %	25.11.2033	161.180	0,12 %
Caisse Francaise de Financement Local	100.000	5,38 %	08.07.2024	132.146	0,10 %
Cie de Financement Foncier SA	100.000	4,00 %	24.10.2025	126.411	0,09 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Autoroutes du Sud de la France SA	100.000	5,63 %	04.07.2022	123.498	0,09 %
Cie de Financement Foncier SA	100.000	5,75 %	04.10.2021	121.818	0,09 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	100.000	3,90 %	20.10.2023	121.393	0,09 %
Societe Generale SCF SA	100.000	4,25 %	03.02.2023	120.868	0,09 %
AXA SA^	100.000	5,13 %	04.07.2043	120.029	0,09 %
BPCE SA	100.000	4,63 %	18.07.2023	119.238	0,09 %
Credit Agricole Assurances SA^	100.000	4,75 %	27.09.2048	118.750	0,09 %
Orange SA^	100.000	5,00 %	01.10.2166	118.588	0,09 %
CNP Assurances^	100.000	4,50 %	10.06.2047	118.270	0,09 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	100.000	4,00 %	17.01.2022	116.344	0,09 %
Societe Generale SA	100.000	4,75 %	02.03.2021	114.632	0,08 %
BPCE SFH SA	100.000	3,75 %	13.09.2021	114.084	0,08 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	100.000	3,60 %	13.09.2021	113.796	0,08 %
Groupama SA^	100.000	7,88 %	27.10.2039	113.500	0,08 %
AXA SA^	100.000	3,88 %	08.10.2166	113.211	0,08 %
Total Capital International SA	100.000	2,50 %	25.03.2026	113.162	0,08 %
Credit Mutuel Arkea SA	100.000	3,50 %	09.02.2029	113.132	0,08 %
Engie SA^	100.000	4,75 %	10.07.2166	113.120	0,08 %
BNP Paribas SA	100.000	2,88 %	26.09.2023	113.028	0,08 %
Sogecap SA^	100.000	4,13 %	18.02.2166	112.685	0,08 %
La Banque Postale Home Loan SFH SA	100.000	2,38 %	15.01.2024	112.474	0,08 %
CNP Assurances^	100.000	4,00 %	18.11.2166	112.248	0,08 %
Carrefour SA	100.000	3,88 %	25.04.2021	112.096	0,08 %
TOTAL SA^	100.000	3,88 %	18.05.2166	112.000	0,08 %
Credit Agricole Assurances SA^	100.000	4,25 %	13.01.2167	111.708	0,08 %
Unibail-Rodamco SE	100.000	2,50 %	26.02.2024	111.395	0,08 %
Orange SA	100.000	3,88 %	14.01.2021	111.291	0,08 %
AXA SA^	100.000	5,25 %	16.04.2040	110.820	0,08 %
BNP Paribas SA	100.000	2,38 %	20.05.2024	110.737	0,08 %
BNP Paribas SA	100.000	2,88 %	01.10.2026	110.680	0,08 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	100.000	4,00 %	22.10.2020	110.643	0,08 %
Orange SA^	100.000	4,00 %	01.10.2166	110.550	0,08 %
Credit Agricole SA	100.000	2,38 %	20.05.2024	110.491	0,08 %
Orange SA	100.000	2,50 %	01.03.2023	110.382	0,08 %
HSBC SFH France SA	100.000	2,00 %	16.10.2023	110.177	0,08 %
SCOR SE^	100.000	3,00 %	08.06.2046	109.740	0,08 %
TOTAL SA^	100.000	3,37 %	06.10.2166	109.625	0,08 %
Air Liquide Finance SA	100.000	3,89 %	09.06.2020	109.584	0,08 %
CIF Euromortgage SA	100.000	3,50 %	17.06.2020	109.109	0,08 %
Credit Agricole Public Sector SCF SA	100.000	1,88 %	07.06.2023	108.977	0,08 %
Total Capital International SA	100.000	2,13 %	15.03.2023	108.976	0,08 %
Orange SA	100.000	3,88 %	09.04.2020	108.728	0,08 %
Auchan Holding SA	100.000	2,25 %	06.04.2023	108.521	0,08 %
Credit Agricole SA	100.000	5,88 %	11.06.2019	108.410	0,08 %
Schneider Electric SE	100.000	2,50 %	06.09.2021	108.380	0,08 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	100.000	2,63 %	31.03.2027	108.081	0,08 %
Credit Agricole SA	100.000	2,63 %	17.03.2027	108.053	0,08 %
Suez	100.000	6,25 %	08.04.2019	107.974	0,08 %
Carmila SAS	100.000	2,38 %	16.09.2024	107.100	0,08 %
Holding d'Infrastructures de Transport SAS	100.000	2,25 %	24.03.2025	107.082	0,08 %
BNP Paribas SA^	100.000	2,88 %	20.03.2026	106.811	0,08 %
Credit Agricole SA	100.000	2,38 %	27.11.2020	106.797	0,08 %
Suez	100.000	1,75 %	10.09.2025	106.574	0,08 %
Sanofi	100.000	1,50 %	22.09.2025	106.544	0,08 %
Engie SA	100.000	3,13 %	21.01.2020	106.458	0,08 %
ICADE	100.000	1,88 %	14.09.2022	106.192	0,08 %
RCI Banque SA	100.000	2,25 %	29.03.2021	106.049	0,08 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	100.000	1,63 %	19.01.2026	105.596	0,08 %
Sodexo SA	100.000	1,75 %	24.01.2022	105.460	0,08 %
Suez^	100.000	2,50 %	30.03.2166	105.439	0,08 %
TOTAL SA^	100.000	2,63 %	26.02.2166	105.200	0,08 %
Caisse Francaise de Financement Local	100.000	1,75 %	16.07.2020	105.117	0,08 %
Essilor International Cie Generale d'Optique SA	100.000	1,75 %	09.04.2021	104.885	0,08 %
Total Capital Canada Ltd.	100.000	1,88 %	09.07.2020	104.752	0,08 %
APRR SA	100.000	1,50 %	15.01.2024	104.658	0,08 %
Caisse Francaise de Financement Local	100.000	1,50 %	13.01.2031	104.581	0,08 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Societe Generale SFH SA	100.000	1,75 %	05.03.2020	104.531	0,08 %
Eutelsat SA	100.000	2,63 %	13.01.2020	104.490	0,08 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	100.000	1,38 %	17.06.2020	104.146	0,08 %
BPCE SFH SA	100.000	1,50 %	30.01.2020	103.795	0,08 %
Pernod Ricard SA	100.000	1,50 %	18.05.2026	103.777	0,08 %
Air Liquide Finance SA	100.000	1,25 %	03.06.2025	103.736	0,08 %
Capgemini SE	100.000	1,75 %	01.07.2020	103.679	0,08 %
Sanofi	100.000	1,13 %	10.03.2022	103.595	0,08 %
RCI Banque SA	100.000	1,38 %	17.11.2020	103.384	0,08 %
BNP Paribas SA	100.000	1,13 %	15.01.2023	103.369	0,08 %
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	100.000	1,38 %	25.10.2019	103.166	0,08 %
Cie de Financement Foncier SA	100.000	1,00 %	02.02.2026	103.151	0,08 %
Unibail-Rodamco SE	100.000	1,38 %	09.03.2026	103.070	0,08 %
Accor SA	100.000	2,50 %	21.03.2019	103.029	0,08 %
RCI Banque SA	100.000	1,38 %	08.03.2024	102.660	0,08 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	100.000	1,25 %	04.11.2019	102.657	0,08 %
Credit Agricole SA	100.000	1,25 %	14.04.2026	102.572	0,08 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	100.000	1,25 %	24.03.2031	102.570	0,08 %
Unibail-Rodamco SE	100.000	2,00 %	28.04.2036	102.529	0,08 %
Bouygues SA	100.000	1,38 %	07.06.2027	102.386	0,08 %
Klepierre SA	100.000	1,00 %	17.04.2023	102.377	0,08 %
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH SA	100.000	0,88 %	07.04.2026	102.359	0,08 %
Arkea Home Loans SFH SA	100.000	0,63 %	30.09.2022	102.328	0,08 %
Kering	100.000	1,25 %	10.05.2026	102.284	0,08 %
Arkema SA	100.000	1,50 %	20.04.2027	102.173	0,08 %
Danone SA	100.000	1,38 %	10.06.2019	102.162	0,08 %
BPCE SA	100.000	1,38 %	22.05.2019	102.119	0,08 %
Caisse Francaise de Financement Local	100.000	0,50 %	13.04.2022	101.987	0,08 %
Societe Generale SA	100.000	0,75 %	19.02.2021	101.952	0,07 %
Total Capital International SA	100.000	1,38 %	04.10.2029	101.774	0,07 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	100.000	1,00 %	25.02.2019	101.637	0,07 %
Credit Mutuel Arkea SA	100.000	1,25 %	31.05.2024	101.540	0,07 %
Gecina SA	100.000	1,38 %	30.06.2027	101.532	0,07 %
Autoroutes du Sud de la France SA	100.000	1,13 %	20.04.2026	101.481	0,07 %
Vivendi SA	100.000	0,75 %	26.05.2021	101.411	0,07 %
Imerys SA	100.000	1,50 %	15.01.2027	101.284	0,07 %
Cie de Financement Foncier SA	100.000	0,38 %	17.09.2019	101.277	0,07 %
Orange SA	100.000	1,00 %	12.05.2025	101.116	0,07 %
Credit Agricole Home Loan SFH SA	100.000	0,38 %	24.03.2023	101.109	0,07 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	100.000	0,75 %	26.05.2024	101.090	0,07 %
Cie de Financement Foncier SA	100.000	0,25 %	16.03.2022	101.087	0,07 %
RCI Banque SA	100.000	0,63 %	04.03.2020	101.053	0,07 %
Valeo SA	100.000	0,63 %	11.01.2023	100.839	0,07 %
Sanofi	100.000	0,63 %	05.04.2024	100.835	0,07 %
Engie SA	100.000	1,38 %	28.02.2029	100.785	0,07 %
Capgemini SE	100.000	0,50 %	09.11.2021	100.765	0,07 %
RCI Banque SA	100.000	0,75 %	26.09.2022	100.646	0,07 %
Caisse Francaise de Financement Local	100.000	1,25 %	11.05.2032	100.584	0,07 %
Cie de Financement Foncier SA	100.000	0,33 %	12.09.2023	100.565	0,07 %
Schneider Electric SE	100.000	0,88 %	11.03.2025	100.543	0,07 %
BPCE SFH SA	100.000	0,88 %	13.04.2028	100.521	0,07 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	100.000	0,25 %	14.06.2019	100.515	0,07 %
Gecina SA	100.000	1,38 %	26.01.2028	100.395	0,07 %
Danone SA	100.000	0,17 %	03.11.2020	100.379	0,07 %
BNP Paribas SA	100.000	1,50 %	23.05.2028	100.339	0,07 %
AXA Bank Europe SCF	100.000	0,13 %	14.03.2022	100.295	0,07 %
Danone SA	100.000	0,42 %	03.11.2022	100.188	0,07 %
Cie Financiere et Industrielle des Autoroutes SA	100.000	1,13 %	13.10.2027	100.177	0,07 %
Danone SA	100.000	1,21 %	03.11.2028	100.028	0,07 %
Cie de Financement Foncier SA	100.000	0,38 %	11.12.2024	99.902	0,07 %
Arkea Home Loans SFH SA	100.000	0,75 %	05.10.2027	99.708	0,07 %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	100.000	0,38 %	07.05.2025	99.678	0,07 %
ICADE	100.000	1,13 %	17.11.2025	99.673	0,07 %
Holding d'Infrastructures de Transport SAS	100.000	0,63 %	27.03.2023	99.658	0,07 %
Carrefour SA	100.000	0,75 %	26.04.2024	99.630	0,07 %
Legrand SA	100.000	0,50 %	09.10.2023	99.611	0,07 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Vivendi SA	100.000	0,88 %	18.09.2024	99.437	0,07 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	100.000	1,63 %	15.11.2027	98.859	0,07 %
Renault SA	100.000	1,00 %	28.11.2025	98.648	0,07 %
Veolia Environnement SA	100.000	0,31 %	04.10.2023	98.130	0,07 %
APRR SA	100.000	1,50 %	17.01.2033	97.528	0,07 %
Orange SA	50.000	8,13 %	28.01.2033	93.220	0,07 %
Cie de Financement Foncier SA	50.000	3,88 %	25.04.2055	72.891	0,05 %
Societe Generale SCF SA	50.000	4,13 %	15.02.2022	58.552	0,04 %
Veolia Environnement SA	50.000	4,38 %	11.12.2020	56.224	0,04 %
BNP Paribas Public Sector SCF SA	50.000	3,75 %	26.02.2020	54.405	0,04 %
				22.579.668	16,56 %
Deutschland 11,13 %					
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.500.000	2,50 %	04.01.2021	1.636.326	1,20 %
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	600.000	1,00 %	15.08.2024	638.004	0,47 %
Allianz SE^	200.000	4,75 %	24.10.2166	237.537	0,17 %
BASF SE	200.000	2,00 %	05.12.2022	217.362	0,16 %
Deutsche Bank AG	200.000	2,38 %	11.01.2023	214.953	0,16 %
Deutsche Bank AG	200.000	1,38 %	07.09.2020	208.079	0,15 %
HeidelbergCement Finance Luxembourg SA	200.000	1,63 %	07.04.2026	205.709	0,15 %
BMW Finance NV	200.000	1,63 %	17.07.2019	205.512	0,15 %
Daimler AG	200.000	0,88 %	12.01.2021	204.290	0,15 %
innogy Finance BV	200.000	1,00 %	13.04.2025	201.665	0,15 %
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale	200.000	0,00 %	23.11.2020	201.198	0,15 %
Deutsche Telekom International Finance BV	200.000	0,25 %	19.04.2021	200.798	0,15 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	200.000	0,88 %	18.01.2030	196.880	0,14 %
innogy Finance BV	130.000	1,88 %	30.01.2020	134.961	0,10 %
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen^	100.000	6,25 %	26.05.2042	123.255	0,09 %
Allianz SE^	100.000	5,63 %	17.10.2042	121.710	0,09 %
Deutsche Telekom International Finance BV	100.000	4,25 %	13.07.2022	117.649	0,09 %
Allianz Finance II BV^	100.000	5,75 %	08.07.2041	117.219	0,09 %
Muenchener Hypothekenbank eG	100.000	2,50 %	04.07.2028	116.476	0,09 %
Vier Gas Transport GmbH	100.000	3,13 %	10.07.2023	113.988	0,08 %
Talanx AG	100.000	3,13 %	13.02.2023	113.767	0,08 %
E.ON International Finance BV	100.000	5,75 %	07.05.2020	113.700	0,08 %
Commerzbank AG	100.000	4,00 %	23.03.2026	113.468	0,08 %
Vonovia Finance BV	100.000	3,63 %	08.10.2021	112.187	0,08 %
Deutsche Postbank AG	100.000	3,63 %	15.02.2021	111.621	0,08 %
UniCredit Bank AG	100.000	1,88 %	09.04.2024	109.797	0,08 %
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale	100.000	1,88 %	26.06.2023	109.207	0,08 %
Bayerische Landesbank	100.000	1,75 %	08.04.2024	109.067	0,08 %
Linde Finance BV	100.000	1,88 %	22.05.2024	108.967	0,08 %
Continental AG	100.000	3,13 %	09.09.2020	108.149	0,08 %
Deutsche Börse AG	100.000	1,63 %	08.10.2025	108.074	0,08 %
Robert Bosch GmbH	100.000	1,75 %	08.07.2024	107.825	0,08 %
Bertelsmann SE & Co. KGaA	100.000	1,75 %	14.10.2024	106.930	0,08 %
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH	100.000	2,38 %	10.02.2021	106.758	0,08 %
Eurogrid GmbH	100.000	1,88 %	10.06.2025	106.653	0,08 %
Berlin Hyp AG	100.000	4,50 %	03.05.2019	106.489	0,08 %
Bertelsmann SE & Co. KGaA^	100.000	3,00 %	23.04.2075	105.483	0,08 %
Fresenius Finance Ireland plc	100.000	2,13 %	01.02.2027	105.133	0,08 %
Bayer AG^	100.000	3,00 %	01.07.2075	104.875	0,08 %
SAP SE	100.000	1,13 %	20.02.2023	104.401	0,08 %
SAP SE	100.000	2,13 %	13.11.2019	104.354	0,08 %
Evonik Industries AG	100.000	1,88 %	08.04.2020	104.227	0,08 %
Vonovia Finance BV	100.000	1,63 %	15.12.2020	104.179	0,08 %
Deutsche Telekom International Finance BV	100.000	2,00 %	30.10.2019	103.939	0,08 %
Deutsche Hypothekenbank AG	100.000	1,38 %	10.06.2020	103.936	0,08 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	100.000	1,50 %	10.03.2020	103.493	0,08 %
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	100.000	1,50 %	05.12.2019	103.480	0,08 %
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	100.000	0,88 %	21.07.2021	103.380	0,08 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	100.000	1,13 %	29.05.2020	103.306	0,08 %
Deutsche Bank AG	100.000	1,50 %	20.01.2022	103.268	0,08 %
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale	100.000	2,00 %	26.04.2019	103.128	0,08 %
Deutsche Post AG	100.000	1,25 %	01.04.2026	103.066	0,08 %
Commerzbank AG	100.000	0,88 %	08.09.2025	103.041	0,08 %
Bayer AG^	100.000	2,38 %	02.04.2075	103.004	0,08 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
UniCredit Bank AG	100.000	0,75 %	24.07.2023	102.976	0,08 %
Vonovia Finance BV	100.000	1,50 %	31.03.2025	102.730	0,08 %
BMW Finance NV	100.000	0,88 %	17.11.2020	102.401	0,08 %
Aroundtown SA	100.000	1,88 %	19.01.2026	102.110	0,08 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg	100.000	0,50 %	04.08.2022	102.039	0,08 %
Deutsche Genossenschafts-Hypothekenbank AG	100.000	0,63 %	05.06.2024	101.940	0,08 %
Deutsche Bank SA Espanola	100.000	0,63 %	15.12.2021	101.917	0,08 %
Berlin Hyp AG	100.000	1,63 %	29.01.2019	101.827	0,08 %
Deutsche Telekom International Finance BV	100.000	1,50 %	03.04.2028	101.821	0,08 %
E.ON SE	100.000	1,63 %	22.05.2029	101.735	0,08 %
Fresenius Finance Ireland plc	100.000	0,88 %	31.01.2022	101.641	0,08 %
Muenchener Hypothekenbank eG	100.000	0,38 %	10.11.2021	101.618	0,07 %
Merck KGaA^	96.000	2,63 %	12.12.2074	101.520	0,07 %
Deutsche Kreditbank AG	100.000	0,63 %	08.06.2021	101.346	0,07 %
Commerzbank AG	100.000	0,38 %	30.09.2019	101.264	0,07 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg	100.000	0,25 %	21.07.2020	101.252	0,07 %
Deutsche Telekom International Finance BV	100.000	1,13 %	22.05.2026	101.025	0,07 %
Daimler AG	100.000	1,38 %	11.05.2028	101.024	0,07 %
BMW Finance NV	100.000	0,75 %	15.04.2024	101.022	0,07 %
Commerzbank AG	100.000	0,25 %	26.01.2022	101.006	0,07 %
BMW Finance NV	100.000	0,75 %	12.07.2024	100.931	0,07 %
Dexia Kommunalbank Deutschland AG	100.000	0,38 %	03.03.2022	100.765	0,07 %
Continental Rubber of America Corp.	100.000	0,50 %	19.02.2019	100.711	0,07 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	100.000	0,20 %	01.03.2022	100.587	0,07 %
Berlin Hyp AG	100.000	0,25 %	22.02.2023	100.553	0,07 %
Landesbank Baden-Wuerttemberg	100.000	0,13 %	21.02.2022	100.550	0,07 %
Linde Finance BV	100.000	1,00 %	20.04.2028	100.519	0,07 %
Deutsche Apotheker-und Aerztebank eG	100.000	0,75 %	05.10.2027	100.492	0,07 %
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	100.000	0,03 %	31.01.2019	100.427	0,07 %
Allianz Finance II BV	100.000	0,00 %	21.04.2020	100.300	0,07 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	100.000	0,20 %	24.03.2023	100.230	0,07 %
Daimler International Finance BV	100.000	0,00 %	15.03.2019	100.143	0,07 %
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale	100.000	0,13 %	21.11.2022	100.100	0,07 %
Daimler AG	100.000	0,85 %	28.02.2025	100.080	0,07 %
Santander Consumer Bank AG	100.000	0,75 %	17.10.2022	100.064	0,07 %
BMW US Capital LLC	100.000	1,00 %	20.04.2027	100.055	0,07 %
Daimler International Finance BV	100.000	0,20 %	13.09.2021	99.968	0,07 %
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	100.000	0,38 %	09.10.2024	99.805	0,07 %
Dexia Kommunalbank Deutschland AG	100.000	0,05 %	08.09.2021	99.794	0,07 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	100.000	0,05 %	05.09.2022	99.711	0,07 %
Deutsche Bank AG	100.000	1,13 %	17.03.2025	99.612	0,07 %
TLG Immobilien AG	100.000	1,38 %	27.11.2024	99.607	0,07 %
Grand City Properties SA	100.000	1,38 %	03.08.2026	99.463	0,07 %
Evonik Finance BV	100.000	0,00 %	08.03.2021	99.449	0,07 %
Commerzbank AG	100.000	0,63 %	24.08.2027	99.398	0,07 %
WL BANK AG Westfaelische Landschaft Bodenkreditbank	100.000	0,63 %	30.08.2027	99.385	0,07 %
HSH Nordbank AG	100.000	0,38 %	27.04.2023	99.361	0,07 %
DVB Bank SE	100.000	1,00 %	25.04.2022	99.315	0,07 %
Brenntag Finance BV	100.000	1,13 %	27.09.2025	99.195	0,07 %
Deutsche Hypothekenbank AG	100.000	0,13 %	23.11.2023	99.122	0,07 %
Commerzbank AG	100.000	0,50 %	13.09.2023	98.955	0,07 %
BASF SE	100.000	0,88 %	15.11.2027	98.607	0,07 %
Allianz Finance II BV	100.000	0,88 %	06.12.2027	98.391	0,07 %
Daimler AG	100.000	1,00 %	15.11.2027	98.360	0,07 %
Deutsche Kreditbank AG	100.000	0,50 %	19.03.2027	98.204	0,07 %
Evonik Finance BV	100.000	0,75 %	07.09.2028	93.422	0,07 %
Bayer AG	50.000	1,88 %	25.01.2021	52.635	0,04 %
Commerzbank AG	50.000	1,50 %	21.09.2022	52.483	0,04 %
Daimler AG	50.000	2,00 %	07.04.2020	52.214	0,04 %
Deutsche Telekom International Finance BV	30.000	7,50 %	24.01.2033	52.010	0,04 %
Daimler AG	50.000	2,13 %	03.07.2037	51.058	0,04 %
Deutsche Telekom International Finance BV	50.000	0,88 %	30.01.2024	50.671	0,04 %
Deutsche Bank AG	50.000	0,25 %	08.03.2024	49.704	0,04 %
Bayerische Landesbank	40.000	1,00 %	09.07.2021	41.538	0,03 %
innogy Finance BV	40.000	1,25 %	19.10.2027	40.041	0,03 %
HSH Nordbank AG	30.000	0,63 %	17.07.2019	30.340	0,02 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Fresenius Finance Ireland plc	20.000	1,50 %	30.01.2024	20.661	0,02 %
Bayer Capital Corp. BV	10.000	1,25 %	13.11.2023	10.497	0,01 %
Deutsche Hypothekenbank AG	10.000	0,63 %	29.07.2019	10.154	0,01 %
				15.169.774	11,13 %
Hongkong 0,22 %					
CK Hutchison Finance 16 Ltd.	100.000	2,00 %	06.04.2028	103.870	0,08 %
CK Hutchison Finance 16 Ltd.	100.000	1,25 %	06.04.2023	102.287	0,07 %
Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd.	100.000	1,00 %	12.12.2024	98.876	0,07 %
				305.033	0,22 %
Ungarn 0,16 %					
Hungary Government International Bond	200.000	6,00 %	11.01.2019	212.591	0,16 %
				212.591	0,16 %
Indien 0,08 %					
ONGC Videsh Ltd.	100.000	2,75 %	15.07.2021	106.622	0,08 %
				106.622	0,08 %
Indonesien 0,16 %					
Indonesia Government International Bond	100.000	3,75 %	14.06.2028	115.250	0,08 %
Indonesia Government International Bond	100.000	2,15 %	18.07.2024	104.810	0,08 %
				220.060	0,16 %
Irland 0,30 %					
CRH Funding BV	100.000	1,88 %	09.01.2024	105.984	0,08 %
AIB Mortgage Bank	100.000	0,88 %	04.02.2023	103.346	0,08 %
Bank of Ireland Mortgage Bank	100.000	1,75 %	19.03.2019	102.530	0,07 %
Bank of Ireland Mortgage Bank	100.000	0,50 %	20.01.2020	101.549	0,07 %
				413.409	0,30 %
Israel 0,22 %					
Israel Government International Bond	100.000	2,88 %	29.01.2024	113.500	0,08 %
Israel Government International Bond	100.000	1,50 %	18.01.2027	103.000	0,08 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	100.000	1,88 %	31.03.2027	86.394	0,06 %
				302.894	0,22 %
Italien 4,24 %					
Intesa Sanpaolo SpA	300.000	0,63 %	23.03.2023	304.868	0,22 %
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	240.000	2,88 %	16.07.2024	269.264	0,20 %
Enel SpA	200.000	5,25 %	20.05.2024	256.570	0,19 %
Unione di Banche Italiane SpA	200.000	4,00 %	16.12.2019	216.382	0,16 %
UniCredit SpA	200.000	2,00 %	04.03.2023	212.151	0,16 %
Enel SpA	150.000	5,63 %	21.06.2027	207.079	0,15 %
Intesa Sanpaolo SpA	200.000	1,13 %	14.01.2020	204.159	0,15 %
Snam SpA	200.000	0,00 %	25.10.2020	199.594	0,15 %
Assicurazioni Generali SpA^	100.000	7,75 %	12.12.2042	128.875	0,09 %
Autostrade per l'Italia SpA	100.000	4,38 %	16.09.2025	124.288	0,09 %
Assicurazioni Generali SpA^	100.000	5,50 %	27.10.2047	119.901	0,09 %
UniCredit SpA	100.000	4,38 %	31.01.2022	117.235	0,09 %
Intesa Sanpaolo SpA	100.000	3,63 %	05.12.2022	116.499	0,09 %
Assicurazioni Generali SpA	100.000	4,13 %	04.05.2026	116.223	0,09 %
Intesa Sanpaolo SpA	100.000	3,50 %	17.01.2022	111.823	0,08 %
Aeroporti di Roma SpA	100.000	3,25 %	20.02.2021	109.537	0,08 %
UniCredit SpA	100.000	2,75 %	31.01.2020	106.106	0,08 %
Intesa Sanpaolo SpA	100.000	2,00 %	18.06.2021	105.590	0,08 %
Autostrade per l'Italia SpA	100.000	4,50 %	08.02.2019	105.011	0,08 %
Luxtotta Group SpA	100.000	3,63 %	19.03.2019	104.418	0,08 %
Autostrade per l'Italia SpA	100.000	1,75 %	26.06.2026	103.508	0,08 %
Intesa Sanpaolo SpA	100.000	3,00 %	28.01.2019	103.277	0,08 %
Unione di Banche Italiane SpA	100.000	2,88 %	18.02.2019	103.164	0,08 %
Unione di Banche Italiane SpA	100.000	1,00 %	27.01.2023	102.962	0,08 %
Mediobanca SpA	100.000	2,25 %	18.03.2019	102.630	0,08 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	100.000	0,88 %	02.02.2022	102.354	0,08 %
Credito Emiliano SpA	100.000	0,88 %	05.11.2021	102.287	0,08 %
Credit Agricole Cariparma SpA	100.000	0,88 %	16.06.2023	102.212	0,07 %
Snam SpA	100.000	1,25 %	25.01.2025	102.156	0,07 %
FCA Bank SpA	100.000	1,00 %	15.11.2021	102.113	0,07 %
Banco di Desio e della Brianza SpA	100.000	0,88 %	12.09.2024	102.086	0,07 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Autostrade per l'Italia SpA	100.000	1,88 %	26.09.2029	102.069	0,07 %
Mediobanca SpA	100.000	1,13 %	17.06.2019	101.927	0,07 %
Italgas SpA	100.000	1,13 %	14.03.2024	101.853	0,07 %
BPER Banca	100.000	0,50 %	22.07.2020	101.295	0,07 %
Unione di Banche Italiane SpA	100.000	1,13 %	04.10.2027	101.026	0,07 %
Esselunga SpA	100.000	0,88 %	25.10.2023	100.142	0,07 %
FCA Bank SpA	100.000	0,25 %	12.10.2020	100.014	0,07 %
2i Rete Gas SpA	100.000	1,61 %	31.10.2027	99.869	0,07 %
Unione di Banche Italiane SpA	100.000	0,75 %	17.10.2022	99.574	0,07 %
Mediobanca SpA	100.000	1,25 %	24.11.2029	99.361	0,07 %
Iren SpA	100.000	0,88 %	04.11.2024	98.437	0,07 %
Credit Agricole Cariparma SpA	100.000	0,63 %	13.01.2026	97.922	0,07 %
Credit Agricole Cariparma SpA	100.000	0,25 %	30.09.2024	97.274	0,07 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	50.000	4,90 %	28.10.2024	64.328	0,05 %
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	50.000	4,88 %	03.10.2019	54.320	0,04 %
				5.783.733	4,24 %
Japan 0,67 %					
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	200.000	1,55 %	15.06.2026	205.788	0,15 %
Toyota Motor Credit Corp.	100.000	1,80 %	23.07.2020	104.455	0,08 %
American Honda Finance Corp.	100.000	1,38 %	10.11.2022	104.454	0,08 %
Nomura Europe Finance NV	100.000	1,50 %	12.05.2021	103.821	0,08 %
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.	100.000	0,88 %	11.03.2022	101.884	0,07 %
Mizuho Financial Group Inc	100.000	0,96 %	16.10.2024	99.925	0,07 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	100.000	0,93 %	11.10.2024	99.834	0,07 %
Asahi Group Holdings Ltd	100.000	0,32 %	19.09.2021	99.824	0,07 %
				919.985	0,67 %
Luxemburg 0,31 %					
SES SA	100.000	4,75 %	11.03.2021	114.253	0,09 %
SES SA	100.000	4,63 %	09.03.2020	109.805	0,08 %
NORD/LB Luxembourg SA Covered Bond Bank	100.000	0,38 %	15.06.2023	99.465	0,07 %
Aroundtown SA	100.000	1,00 %	07.01.2025	97.303	0,07 %
				420.826	0,31 %
Mexiko 0,60 %					
America Movil SAB de CV	100.000	4,75 %	28.06.2022	118.924	0,09 %
Mexico Government International Bond	100.000	3,63 %	09.04.2029	117.801	0,08 %
America Movil SAB de CV	100.000	4,13 %	25.10.2019	107.411	0,08 %
Mexico Government International Bond	100.000	2,38 %	09.04.2021	106.852	0,08 %
America Movil SAB de CV	100.000	2,13 %	10.03.2028	105.501	0,08 %
Mexico Government International Bond	100.000	1,63 %	06.03.2024	104.310	0,08 %
Mexico Government International Bond	100.000	3,00 %	06.03.2045	97.125	0,07 %
Mexico Government International Bond	50.000	5,50 %	17.02.2020	55.725	0,04 %
				813.649	0,60 %
Marokko 0,08 %					
Internationale Staatsanleihe von Marokko	100.000	3,50 %	19.06.2024	111.754	0,08 %
				111.754	0,08 %
Niederlande 4,65 %					
Koninklijke KPN NV	200.000	4,25 %	01.03.2022	231.599	0,17 %
Cooperatieve Rabobank UA	200.000	4,38 %	07.06.2021	229.247	0,17 %
ING Bank NV	200.000	3,63 %	31.08.2021	227.050	0,17 %
ABN AMRO Bank NV	200.000	2,13 %	26.11.2020	211.840	0,16 %
Cooperatieve Rabobank UA	200.000	1,38 %	03.02.2027	206.874	0,15 %
ING Bank NV	200.000	0,70 %	16.04.2020	203.266	0,15 %
ABN AMRO Bank NV	200.000	1,00 %	13.04.2031	196.928	0,14 %
Cooperatieve Rabobank UA	150.000	3,75 %	09.11.2020	164.894	0,12 %
Cooperatieve Rabobank UA	100.000	4,75 %	06.06.2022	119.799	0,09 %
ABN AMRO Bank NV	100.000	6,38 %	27.04.2021	119.064	0,09 %
Achmea BV^	100.000	6,00 %	04.04.2043	118.500	0,09 %
ING Bank NV	100.000	4,50 %	21.02.2022	117.222	0,09 %
Cooperatieve Rabobank UA	100.000	4,13 %	14.09.2022	116.071	0,09 %
ABN AMRO Bank NV	100.000	4,13 %	28.03.2022	116.060	0,09 %
NN Group NV^	100.000	4,63 %	08.04.2044	115.886	0,09 %
Cooperatieve Rabobank UA	100.000	4,00 %	11.01.2022	115.234	0,08 %
ABN AMRO Bank NV	100.000	3,50 %	18.01.2022	114.137	0,08 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
NN Group NV^	100.000	4,50 %	15.07.2166	112.682	0,08 %
ABN AMRO Bank NV	100.000	2,38 %	23.01.2024	112.554	0,08 %
Aegon NV^	100.000	4,00 %	25.04.2044	112.290	0,08 %
Cooperatieve Rabobank UA	100.000	4,13 %	12.01.2021	112.212	0,08 %
Koninklijke DSM NV	100.000	2,38 %	03.04.2024	110.605	0,08 %
ABN AMRO Bank NV	100.000	3,63 %	22.06.2020	109.596	0,08 %
ING Bank NV^	100.000	3,63 %	25.02.2026	109.270	0,08 %
ING Bank NV	100.000	4,00 %	17.01.2020	108.855	0,08 %
Cooperatieve Rabobank UA	100.000	5,88 %	20.05.2019	108.041	0,08 %
JAB Holdings BV	100.000	2,13 %	16.09.2022	107.227	0,08 %
ING Groep NV^	100.000	2,50 %	15.02.2029	106.298	0,08 %
ABN AMRO Bank NV^	100.000	2,88 %	30.06.2025	105.839	0,08 %
Heineken NV	100.000	2,13 %	04.08.2020	105.264	0,08 %
JAB Holdings BV	100.000	1,75 %	25.05.2023	105.101	0,08 %
Heineken NV	100.000	1,50 %	07.12.2024	104.631	0,08 %
ABN AMRO Bank NV	100.000	1,88 %	31.07.2019	103.571	0,08 %
ASML Holding NV	100.000	1,63 %	28.05.2027	103.536	0,08 %
NIBC Bank NV	100.000	1,50 %	31.01.2022	102.856	0,08 %
ING Bank NV	100.000	0,75 %	22.02.2021	101.995	0,08 %
Unilever NV	100.000	1,38 %	31.07.2029	101.988	0,08 %
LeasePlan Corp.NV	100.000	1,00 %	08.04.2020	101.934	0,07 %
Schlumberger Finance BV	100.000	1,50 %	04.03.2019	101.827	0,07 %
Koninklijke DSM NV	100.000	1,00 %	09.04.2025	101.674	0,07 %
ING Groep NV	100.000	0,75 %	09.03.2022	101.325	0,07 %
F van Lanschot Bankiers NV	100.000	0,38 %	31.03.2023	100.530	0,07 %
ABN AMRO Bank NV	100.000	1,38 %	12.01.2037	100.334	0,07 %
Heineken NV	100.000	1,50 %	03.10.2029	100.169	0,07 %
Stedin Holding NV	100.000	0,88 %	24.10.2025	100.151	0,07 %
Nationale-Nederlanden Bank NV	100.000	0,50 %	10.10.2024	100.130	0,07 %
LeasePlan Corp.NV	100.000	0,75 %	03.10.2022	100.072	0,07 %
PostNL NV	100.000	1,00 %	21.11.2024	99.961	0,07 %
Cooperatieve Rabobank UA	100.000	0,25 %	31.05.2024	99.632	0,07 %
ABN AMRO Bank NV	100.000	1,13 %	12.01.2032	99.399	0,07 %
Aegon Bank NV	100.000	0,38 %	21.11.2024	99.231	0,07 %
NIBC Bank NV	65.000	0,25 %	22.04.2022	65.317	0,05 %
				6.339.768	4,65 %
Neuseeland 0,37 %					
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	100.000	0,63 %	01.06.2021	101.394	0,08 %
Westpac Securities NZ Ltd.	100.000	0,25 %	06.04.2022	100.221	0,08 %
ASB Finance Ltd.	100.000	0,63 %	18.10.2024	100.213	0,07 %
BNZ International Funding Ltd.	100.000	0,50 %	13.05.2023	99.140	0,07 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	100.000	0,13 %	22.09.2023	98.295	0,07 %
				499.263	0,37 %
Norwegen 2,32 %					
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	250.000	0,38 %	09.03.2023	251.640	0,19 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	200.000	3,38 %	07.09.2021	224.711	0,17 %
DNB Boligkreditt A.S.	200.000	1,88 %	18.06.2019	206.519	0,15 %
SpareBank 1 SR-Bank A.S.A	200.000	2,13 %	27.02.2019	205.042	0,15 %
DNB Bank A.S.A^	200.000	1,25 %	01.03.2027	203.278	0,15 %
DNB Boligkreditt A.S.	200.000	0,38 %	14.01.2021	202.876	0,15 %
Storebrand Livsforsikring A.S.^	100.000	6,88 %	04.04.2043	123.811	0,09 %
Telenor A.S.A	100.000	2,50 %	22.05.2025	111.592	0,08 %
DNB Boligkreditt A.S.	100.000	2,75 %	21.03.2022	111.203	0,08 %
Eika Boligkreditt A.S.	100.000	2,13 %	30.01.2023	109.435	0,08 %
SpareBank 1 SR-Bank A.S.A.	100.000	2,13 %	14.04.2021	106.060	0,08 %
Eika Boligkreditt A.S.	100.000	2,00 %	19.06.2019	103.394	0,08 %
Sparebanken Vest Boligkreditt A.S.	100.000	1,25 %	16.01.2019	101.663	0,08 %
Kommunalbanken A.S.	100.000	0,88 %	08.04.2019	101.614	0,08 %
SpareBank 1 SMN	100.000	0,75 %	08.06.2021	101.524	0,08 %
Avinor A.S.	100.000	1,00 %	29.04.2025	101.070	0,07 %
Eika Boligkreditt A.S.	100.000	0,38 %	20.04.2023	100.534	0,07 %
Statkraft A.S.	100.000	1,50 %	26.03.2030	100.098	0,07 %
DNB Boligkreditt A.S.	100.000	0,05 %	11.01.2022	99.982	0,07 %
Kommunalbanken A.S.	100.000	0,63 %	20.04.2026	99.703	0,07 %
SR-Boligkreditt A.S.	100.000	0,38 %	03.10.2024	99.305	0,07 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Statoil A.S.A	100.000	1,63 %	17.02.2035	99.223	0,07 %
Statoil A.S.A	100.000	0,75 %	09.11.2026	98.677	0,07 %
DNB Boligkreditt A.S.	100.000	0,25 %	07.09.2026	96.365	0,07 %
				3.159.319	2,32 %
Peru 0,09 %					
Peruanischen Regierung International Bond	100.000	3,75 %	01.03.2030	121.750	0,09 %
				121.750	0,09 %
Polen 1,13 %					
Republic of Poland Government International Bond	200.000	4,50 %	18.01.2022	236.200	0,17 %
Republic of Poland Government International Bond	200.000	3,00 %	15.01.2024	230.300	0,17 %
Republic of Poland Government International Bond	100.000	3,75 %	19.01.2023	117.544	0,09 %
Republic of Poland Government International Bond	100.000	4,20 %	15.04.2020	109.672	0,08 %
ORLEN Capital AB	100.000	2,50 %	30.06.2021	107.038	0,08 %
mFinance France SA	100.000	2,00 %	26.11.2021	105.974	0,08 %
Republic of Poland Government International Bond	100.000	1,50 %	19.01.2026	105.725	0,08 %
Republic of Poland Government International Bond	100.000	1,63 %	15.01.2019	101.855	0,07 %
Republic of Poland Government International Bond	100.000	0,50 %	20.12.2021	101.750	0,07 %
Republic of Poland Government International Bond	100.000	0,88 %	10.05.2027	98.878	0,07 %
Republic of Poland Government International Bond	50.000	5,25 %	20.01.2025	65.500	0,05 %
Republic of Poland Government International Bond	50.000	2,38 %	18.01.2036	54.000	0,04 %
Republic of Poland Government International Bond	50.000	1,38 %	22.10.2027	51.642	0,04 %
Republic of Poland Government International Bond	50.000	2,00 %	25.10.2046	50.860	0,04 %
				1.536.938	1,13 %
Portugal 0,53 %					
EDP Finance BV	200.000	2,00 %	22.04.2025	211.266	0,16 %
EDP Finance BV	100.000	4,13 %	29.06.2020	110.116	0,08 %
Banco Santander Totta SA	100.000	0,88 %	27.10.2020	102.278	0,08 %
Banco Santander Totta SA	100.000	1,25 %	26.09.2027	101.265	0,07 %
Banco Comercial Portugues SA	100.000	0,75 %	31.05.2022	101.152	0,07 %
EDP Finance BV	100.000	1,13 %	12.02.2024	101.044	0,07 %
				727.121	0,53 %
Rumänien 0,49 %					
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	400.000	3,63 %	24.04.2024	461.680	0,34 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	100.000	2,88 %	28.10.2024	110.575	0,08 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	100.000	2,38 %	19.04.2027	102.457	0,07 %
				674.712	0,49 %
Singapur 0,07 %					
DBS Bank Ltd.	100.000	0,38 %	23.01.2024	99.530	0,07 %
				99.530	0,07 %
Slowakei 0,08 %					
Granvia A.S.	88.480	4,78 %	30.09.2039	113.106	0,08 %
				113.106	0,08 %
Südkorea 0,08 %					
Export-Import Bank von Korea	100.000	2,00 %	30.04.2020	104.043	0,08 %
				104.043	0,08 %
Spanien 6,36 %					
Programa Cedulas TDA Fondo de Titulizacion de Activos	200.000	4,25 %	10.04.2031	258.083	0,19 %
Iberdrola International BV	200.000	3,00 %	31.01.2022	221.802	0,16 %
Gas Natural Capital Markets SA	200.000	5,38 %	24.05.2019	214.956	0,16 %
CaixaBank SA	200.000	4,63 %	04.06.2019	213.661	0,16 %
Banco Santander SA	200.000	1,50 %	25.01.2026	213.569	0,16 %
Banco Popular Espanol SA	200.000	1,00 %	03.03.2022	206.052	0,15 %
Criteria Caixa SAU	200.000	2,38 %	09.05.2019	205.753	0,15 %
Bankia SA	200.000	0,88 %	21.01.2021	204.876	0,15 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	200.000	0,63 %	17.05.2021	204.306	0,15 %
Telefonica Emisiones SAU	200.000	1,46 %	13.04.2026	202.939	0,15 %
Telefonica Emisiones SAU	200.000	0,75 %	13.04.2022	202.634	0,15 %
CaixaBank SA	150.000	4,50 %	26.01.2022	176.179	0,13 %
Ayt Cedulas Cajas Global	100.000	4,75 %	25.05.2027	131.159	0,10 %
Bankia SA	100.000	4,13 %	24.03.2036	128.915	0,09 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	100.000	4,00 %	25.02.2025	124.269	0,09 %
Cedulas TDA 6 Fondo de Titulizacion de Activos	100.000	3,88 %	23.05.2025	122.314	0,09 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
CaixaBank SA	100.000	3,88 %	17.02.2025	122.141	0,09 %
Ayt Cedulas Cajas Global	100.000	4,25 %	25.10.2023	121.195	0,09 %
IM Cedulas 10 Fondo de Titulazion de Activos	100.000	4,50 %	21.02.2022	117.410	0,09 %
Ayt Cedulas Cajas Global	100.000	3,75 %	14.12.2022	116.315	0,09 %
Gas Natural Fenosa Finance BV	100.000	3,88 %	11.04.2022	114.913	0,08 %
CaixaBank SA	100.000	2,63 %	21.03.2024	113.234	0,08 %
Ayt Cedulas Cajas Global	100.000	4,00 %	24.03.2021	112.565	0,08 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	100.000	3,50 %	10.02.2027	112.495	0,08 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	100.000	2,25 %	12.06.2024	111.701	0,08 %
Telefonica Emisiones SAU	100.000	2,93 %	17.10.2029	111.012	0,08 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	100.000	3,50 %	07.10.2020	110.025	0,08 %
Telefonica Emisiones SAU	100.000	4,71 %	20.01.2020	109.560	0,08 %
Enagas Financiaciones SAU	100.000	2,50 %	11.04.2022	109.531	0,08 %
Santander Issuances SAU	100.000	3,13 %	19.01.2027	109.030	0,08 %
Ayt Cedulas Cajas Global	100.000	4,50 %	02.12.2019	108.933	0,08 %
IM Cedulas 5 Fondo de Titulazion de Activos	100.000	3,50 %	15.06.2020	108.629	0,08 %
Red Electrica Financiaciones SAU	100.000	2,13 %	01.07.2023	108.566	0,08 %
Bankia SA	100.000	5,00 %	28.06.2019	107.710	0,08 %
Banco Santander SA	100.000	2,00 %	27.11.2034	107.709	0,08 %
Merlin Properties Socimi SA	100.000	2,38 %	23.05.2022	106.142	0,08 %
Repsol International Finance BV	100.000	2,63 %	28.05.2020	105.955	0,08 %
Santander Issuances SAU	100.000	2,50 %	18.03.2025	104.884	0,08 %
Santander International Debt SA	100.000	1,38 %	14.12.2022	104.286	0,08 %
Banco Popular Espanol SA	100.000	3,75 %	22.01.2019	104.171	0,08 %
BBVA Subordinated Capital SAU^	100.000	3,50 %	11.04.2024	104.057	0,08 %
Telefonica Emisiones SAU	100.000	2,74 %	29.05.2019	103.884	0,08 %
Bankia SA	100.000	1,13 %	05.08.2022	103.654	0,08 %
Banco Mare Nostrum SA	100.000	3,13 %	21.01.2019	103.493	0,08 %
Kutxabank SA	100.000	1,25 %	22.09.2025	103.486	0,08 %
Cajamar Caja Rural SCC	100.000	1,25 %	26.01.2022	102.696	0,08 %
Banco de Sabadell SA	100.000	0,88 %	12.11.2021	102.632	0,08 %
Inmobiliaria Colonial Socimi SA	100.000	1,86 %	05.06.2019	102.482	0,08 %
CaixaBank SA	100.000	1,25 %	11.01.2027	102.433	0,08 %
Mapfre SA	100.000	1,63 %	19.05.2026	102.222	0,08 %
Cajamar Caja Rural SCC	100.000	1,00 %	22.10.2020	102.194	0,07 %
Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	100.000	1,00 %	28.04.2021	101.957	0,07 %
Banco de Sabadell SA	100.000	0,63 %	03.11.2020	101.775	0,07 %
Santander Consumer Finance SA	100.000	0,90 %	18.02.2020	101.665	0,07 %
Bankinter SA	100.000	1,00 %	05.02.2025	101.610	0,07 %
Santander Consumer Finance SA	100.000	0,88 %	24.01.2022	101.371	0,07 %
NorteGas Energia Distribucion SAU	100.000	0,92 %	28.09.2022	100.540	0,07 %
Telefonica Emisiones SAU	100.000	0,32 %	17.10.2020	100.506	0,07 %
Santander Consumer Finance SA	100.000	0,50 %	04.10.2021	100.406	0,07 %
Repsol International Finance BV	100.000	0,50 %	23.05.2022	100.389	0,07 %
Gas Natural Fenosa Finance BV	100.000	1,25 %	19.04.2026	100.206	0,07 %
Iberdrola International BV^	100.000	1,88 %	22.05.2166	100.189	0,07 %
Merlin Properties Socimi SA	100.000	1,88 %	02.11.2026	99.838	0,07 %
Iberdrola Finanzas SA	100.000	1,62 %	29.11.2029	99.802	0,07 %
Banco de Sabadell SA	100.000	0,88 %	05.03.2023	99.006	0,07 %
Inmobiliaria Colonial Socimi SA	100.000	1,63 %	28.11.2025	98.968	0,07 %
Banco de Sabadell SA	100.000	0,13 %	20.10.2023	98.090	0,07 %
Enagas Financiaciones SAU	100.000	0,75 %	27.10.2026	97.410	0,07 %
Abertis Infraestructuras SA	100.000	1,00 %	27.02.2027	95.490	0,07 %
Iberdrola Finanzas SA	50.000	4,13 %	23.03.2020	54.539	0,04 %
				8.676.569	6,36 %
Supranational 15,39 %					
Europäische Investitionsbank	600.000	1,38 %	15.09.2021	636.284	0,47 %
Europäische Investitionsbank	500.000	2,25 %	14.10.2022	557.681	0,41 %
Europäische Investitionsbank	500.000	1,63 %	15.03.2023	541.884	0,40 %
European Financial Stability Facility	400.000	3,00 %	04.09.2034	514.187	0,38 %
Europäische Investitionsbank	500.000	0,13 %	15.06.2020	507.040	0,37 %
Europäische Investitionsbank	500.000	1,00 %	14.03.2031	506.846	0,37 %
Europäische Investitionsbank	500.000	0,13 %	15.04.2025	494.379	0,36 %
Europäische Investitionsbank	450.000	0,50 %	15.01.2027	448.785	0,33 %
Europäische Investitionsbank	400.000	4,63 %	15.04.2020	446.644	0,33 %
European Financial Stability Facility	400.000	1,50 %	22.01.2020	415.920	0,31 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Europäische Investitionsbank	400.000	2,50 %	15.03.2019	414.546	0,30 %
Europäische Investitionsbank	400.000	0,25 %	15.10.2020	407.341	0,30 %
European Financial Stability Facility	400.000	0,38 %	11.10.2024	402.933	0,30 %
European Stability Mechanism	400.000	0,50 %	02.03.2026	402.013	0,30 %
Europäische Investitionsbank	400.000	0,38 %	14.04.2026	397.547	0,29 %
Europäische Union	300.000	2,50 %	04.11.2027	356.214	0,26 %
European Financial Stability Facility	300.000	1,75 %	27.06.2024	330.330	0,24 %
European Financial Stability Facility	300.000	0,13 %	04.11.2019	303.209	0,22 %
European Financial Stability Facility	300.000	0,00 %	29.03.2021	302.728	0,22 %
European Financial Stability Facility	300.000	0,13 %	17.10.2023	300.089	0,22 %
European Stability Mechanism	300.000	0,13 %	22.04.2024	298.715	0,22 %
European Financial Stability Facility	250.000	2,25 %	05.09.2022	277.319	0,20 %
European Financial Stability Facility	200.000	3,88 %	30.03.2032	277.163	0,20 %
European Stability Mechanism	250.000	1,80 %	02.11.2046	273.339	0,20 %
Europäische Investitionsbank	246.000	1,75 %	15.09.2045	266.415	0,20 %
European Financial Stability Facility	280.000	1,20 %	17.02.2045	263.386	0,19 %
European Stability Mechanism	280.000	0,88 %	18.07.2042	254.621	0,19 %
Europäische Investitionsbank	200.000	2,63 %	15.03.2035	251.256	0,18 %
European Financial Stability Facility	200.000	2,75 %	03.12.2029	243.079	0,18 %
Europäische Investitionsbank	200.000	3,00 %	28.09.2022	229.734	0,17 %
Europäische Union	150.000	3,75 %	04.04.2042	227.247	0,17 %
European Financial Stability Facility	200.000	3,38 %	05.07.2021	225.587	0,17 %
Europäische Union	200.000	2,75 %	04.04.2022	224.951	0,17 %
Europäische Investitionsbank	200.000	2,13 %	15.01.2024	224.003	0,16 %
European Financial Stability Facility	230.000	1,38 %	31.05.2047	223.619	0,16 %
Europäische Investitionsbank	200.000	2,00 %	14.04.2023	222.311	0,16 %
European Financial Stability Facility	200.000	1,88 %	23.05.2023	219.628	0,16 %
European Financial Stability Facility	200.000	2,00 %	28.02.2056	218.964	0,16 %
Europäische Investitionsbank	200.000	1,25 %	13.11.2026	214.145	0,16 %
European Financial Stability Facility	200.000	1,75 %	29.10.2020	211.789	0,16 %
European Financial Stability Facility	200.000	1,38 %	07.06.2021	211.268	0,16 %
European Stability Mechanism	200.000	1,38 %	04.03.2021	211.069	0,16 %
Europäische Union	200.000	3,38 %	10.05.2019	210.570	0,15 %
Europäische Investitionsbank	200.000	2,50 %	16.09.2019	210.272	0,15 %
Europäische Investitionsbank	200.000	1,50 %	15.07.2020	209.844	0,15 %
Europäische Investitionsbank	200.000	0,88 %	13.09.2024	208.848	0,15 %
Europäische Union	200.000	0,63 %	04.11.2023	206.079	0,15 %
European Financial Stability Facility	200.000	0,50 %	20.01.2023	205.229	0,15 %
European Stability Mechanism	200.000	0,88 %	15.10.2019	204.958	0,15 %
European Financial Stability Facility	200.000	1,25 %	22.01.2019	203.724	0,15 %
European Stability Mechanism	200.000	0,75 %	15.03.2027	203.048	0,15 %
European Stability Mechanism	200.000	0,10 %	03.11.2020	202.827	0,15 %
European Financial Stability Facility	200.000	0,10 %	19.01.2021	202.436	0,15 %
European Financial Stability Facility	200.000	0,75 %	03.05.2027	202.404	0,15 %
Europäische Investitionsbank	200.000	0,25 %	14.10.2024	201.200	0,15 %
Europäische Investitionsbank	200.000	0,00 %	15.01.2019	201.118	0,15 %
European Financial Stability Facility	200.000	0,00 %	17.11.2022	200.476	0,15 %
Europäische Investitionsbank	200.000	1,00 %	14.04.2032	200.114	0,15 %
Europäische Investitionsbank	200.000	1,13 %	15.09.2036	199.046	0,15 %
Europäische Union	150.000	1,50 %	04.10.2035	160.802	0,12 %
European Financial Stability Facility	150.000	1,63 %	17.07.2020	157.591	0,12 %
Europäische Investitionsbank	100.000	4,50 %	15.10.2025	132.642	0,10 %
Europäische Investitionsbank	100.000	2,75 %	15.03.2040	130.702	0,10 %
Europäische Investitionsbank	100.000	3,50 %	15.04.2027	128.117	0,09 %
Europäische Investitionsbank	100.000	4,13 %	15.04.2024	125.390	0,09 %
Europäische Union	100.000	3,00 %	04.09.2026	122.372	0,09 %
European Financial Stability Facility	100.000	2,35 %	29.07.2044	120.586	0,09 %
Europäische Investitionsbank	100.000	2,75 %	15.09.2025	118.383	0,09 %
Europäische Union	100.000	3,50 %	04.06.2021	112.959	0,08 %
European Stability Mechanism	100.000	2,13 %	20.11.2023	112.131	0,08 %
Europäische Union	100.000	2,75 %	21.09.2021	111.156	0,08 %
Council Of Europe Development Bank	100.000	1,75 %	24.04.2024	109.455	0,08 %
EUROFIMA	100.000	4,38 %	21.10.2019	108.381	0,08 %
European Stability Mechanism	100.000	1,63 %	17.11.2036	107.383	0,08 %
Europäische Union	100.000	1,38 %	04.10.2029	107.309	0,08 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	100.000	3,88 %	20.05.2019	106.081	0,08 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Corp.Andina de Fomento	100.000	1,88 %	29.05.2021	105.423	0,08 %
European Financial Stability Facility	100.000	1,25 %	24.05.2033	101.914	0,07 %
European Financial Stability Facility	100.000	1,45 %	05.09.2040	101.739	0,07 %
European Stability Mechanism	100.000	1,13 %	03.05.2032	101.648	0,07 %
Europäische Union	100.000	0,25 %	04.07.2020	101.642	0,07 %
Europäische Investitionsbank	100.000	1,13 %	13.04.2033	101.082	0,07 %
Europäische Union	100.000	1,13 %	04.04.2036	100.967	0,07 %
Nordic Investment Bank	100.000	0,13 %	10.06.2024	99.556	0,07 %
European Financial Stability Facility	100.000	0,40 %	31.05.2026	99.158	0,07 %
Europäische Union	100.000	0,75 %	04.04.2031	98.723	0,07 %
Council Of Europe Development Bank	100.000	0,38 %	08.06.2026	98.505	0,07 %
African Development Bank	100.000	0,13 %	07.10.2026	95.070	0,07 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	100.000	0,63 %	12.01.2033	92.824	0,07 %
Europäische Union	50.000	3,38 %	04.04.2038	70.546	0,05 %
European Financial Stability Facility	50.000	1,80 %	10.07.2048	52.840	0,04 %
European Financial Stability Facility	50.000	1,70 %	13.02.2043	52.768	0,04 %
				20.974.246	15,39 %
Schweden 3,02 %					
Nordea Bank AB	200.000	3,25 %	05.07.2022	226.544	0,17 %
Lansforsakringar Hypotek AB	200.000	1,50 %	18.03.2021	209.836	0,15 %
Swedbank Hypotek AB	200.000	1,13 %	21.05.2021	207.914	0,15 %
Atlas Copco AB	200.000	2,63 %	15.03.2019	206.440	0,15 %
Swedbank AB	200.000	0,63 %	04.01.2021	203.507	0,15 %
Sweden Government International Bond	200.000	0,05 %	12.02.2020	201.889	0,15 %
Stadshypotek AB	200.000	0,05 %	20.06.2022	199.438	0,15 %
Vattenfall AB	100.000	5,38 %	29.04.2024	128.857	0,09 %
Investor AB	100.000	4,50 %	12.05.2023	121.255	0,09 %
Telia Co. AB	100.000	4,75 %	16.11.2021	117.721	0,09 %
Svenska Handelsbanken AB	100.000	4,38 %	20.10.2021	115.957	0,08 %
Volvo Treasury AB^	100.000	4,85 %	10.03.2078	114.610	0,08 %
Svenska Handelsbanken AB	100.000	2,63 %	23.08.2022	110.517	0,08 %
Nordea Bank AB	100.000	4,50 %	26.03.2020	109.656	0,08 %
Essity AB	100.000	2,50 %	09.06.2023	109.485	0,08 %
Nordea Bank AB	100.000	4,00 %	11.07.2019	106.384	0,08 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB^	100.000	2,50 %	28.05.2026	105.961	0,08 %
Svenska Handelsbanken AB	100.000	2,25 %	27.08.2020	105.948	0,08 %
Stadshypotek AB	100.000	1,63 %	30.10.2020	105.020	0,08 %
SKF AB	100.000	1,63 %	02.12.2022	104.142	0,08 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	100.000	1,50 %	25.02.2020	103.742	0,08 %
Alfa Laval Treasury International AB	100.000	1,38 %	12.09.2022	103.580	0,08 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	100.000	0,75 %	16.06.2022	102.865	0,08 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	100.000	2,00 %	18.03.2019	102.577	0,08 %
Sveriges Sakerställda Obligationer AB	100.000	0,63 %	07.10.2021	102.272	0,07 %
Sveriges Sakerställda Obligationer AB	100.000	0,25 %	20.01.2021	101.061	0,07 %
Fastighets AB Balder	100.000	1,13 %	14.03.2022	100.932	0,07 %
Stadshypotek AB	100.000	0,38 %	22.02.2023	100.750	0,07 %
Lansforsakringar Hypotek AB	100.000	0,25 %	22.04.2022	100.496	0,07 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	100.000	0,30 %	17.02.2022	100.302	0,07 %
Akelius Residential Property AB	100.000	1,13 %	14.03.2024	98.721	0,07 %
Telia Co. AB	100.000	1,63 %	23.02.2035	91.971	0,07 %
				4.120.350	3,02 %
Schweiz 2,13 %					
Glencore Finance Europe Ltd.	200.000	2,75 %	01.04.2021	213.555	0,16 %
Credit Suisse AG	200.000	1,00 %	12.03.2019	203.148	0,15 %
UBS Group Funding Switzerland AG	200.000	1,25 %	01.09.2026	201.867	0,15 %
Holcim Finance Luxembourg SA	150.000	3,00 %	22.01.2024	169.258	0,12 %
Roche Holdings, Inc.	100.000	6,50 %	04.03.2021	120.501	0,09 %
Aquarius & Investments PLC for Zurich Insurance Co., Ltd.^	100.000	4,25 %	02.10.2043	116.520	0,09 %
UBS AG	100.000	4,00 %	08.04.2022	116.389	0,08 %
ELM BV for Swiss Life Insurance & Pension Group^	100.000	4,50 %	19.05.2166	115.064	0,08 %
Credit Suisse AG	100.000	4,75 %	05.08.2019	107.713	0,08 %
Nestle Finance International Ltd.	100.000	2,13 %	10.09.2021	107.645	0,08 %
Lunar Funding V for Swisscom AG	100.000	2,00 %	30.09.2020	105.168	0,08 %
ELM BV for Swiss Reinsurance Co., Ltd.^	100.000	2,60 %	01.09.2166	104.738	0,08 %
Credit Suisse AG	100.000	1,50 %	10.04.2026	104.437	0,08 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Swiss Re ReAssure Ltd.	100.000	1,38 %	27.05.2023	104.098	0,08 %
ABB Finance BV	100.000	2,63 %	26.03.2019	103.258	0,08 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	100.000	1,25 %	14.04.2022	103.154	0,08 %
Credit Suisse AG	100.000	1,38 %	29.11.2019	102.770	0,08 %
Nestle Finance International Ltd.	100.000	1,50 %	19.07.2019	102.742	0,07 %
UBS AG	100.000	1,13 %	30.06.2020	102.705	0,07 %
Nestle Finance International Ltd.	100.000	1,75 %	02.11.2037	102.129	0,07 %
Credit Suisse AG	100.000	0,38 %	11.04.2019	100.619	0,07 %
Novartis Finance SA	100.000	0,00 %	31.03.2021	99.707	0,07 %
Holcim Finance Luxembourg SA	100.000	1,75 %	29.08.2029	99.204	0,07 %
Novartis Finance SA	100.000	0,13 %	20.09.2023	98.446	0,07 %
				2.904.835	2,13 %
Vereinigte Arabische Emirate 0,08 %					
Emirates Telecommunications Group Co. PJSC	100.000	2,75 %	18.06.2026	110.723	0,08 %
				110.723	0,08 %
Vereinigtes Königreich 7,62 %					
BP Capital Markets plc	300.000	1,95 %	03.03.2025	322.987	0,24 %
Lloyds Bank plc	200.000	4,88 %	13.01.2023	245.950	0,18 %
Santander UK plc	200.000	4,25 %	12.04.2021	227.938	0,17 %
HSBC Holdings plc	200.000	3,00 %	30.06.2025	222.278	0,16 %
Royal Bank of Scotland plc	200.000	5,38 %	30.09.2019	218.831	0,16 %
Royal Bank of Scotland Group plc	200.000	2,50 %	22.03.2023	215.751	0,16 %
HSBC Holdings plc	200.000	1,50 %	15.03.2022	209.501	0,15 %
Sky plc	200.000	1,50 %	15.09.2021	208.766	0,15 %
Standard Chartered plc	200.000	1,63 %	13.06.2021	208.701	0,15 %
BP Capital Markets plc	200.000	2,99 %	18.02.2019	207.027	0,15 %
BAT International Finance plc	200.000	1,00 %	23.05.2022	204.264	0,15 %
Nationwide Building Society	200.000	0,50 %	29.10.2019	201.820	0,15 %
Santander UK plc	200.000	0,25 %	09.08.2021	201.510	0,15 %
Nationwide Building Society	200.000	0,63 %	25.03.2027	196.015	0,14 %
Barclays Bank plc	100.000	6,63 %	30.03.2022	122.698	0,09 %
Nationwide Building Society	100.000	4,38 %	28.02.2022	117.627	0,09 %
Barclays Bank plc	100.000	4,00 %	12.01.2021	112.273	0,08 %
WPP Finance 2013	100.000	3,00 %	20.11.2023	112.187	0,08 %
Lloyds Bank plc	100.000	4,00 %	29.09.2020	111.256	0,08 %
Diageo Finance plc	100.000	2,38 %	20.05.2026	111.234	0,08 %
Royal Bank of Scotland plc	100.000	3,88 %	19.10.2020	111.015	0,08 %
BP Capital Markets plc	100.000	2,21 %	25.09.2026	109.264	0,08 %
Bank of Scotland plc	100.000	3,88 %	07.02.2020	108.622	0,08 %
HSBC Holdings plc	100.000	6,00 %	10.06.2019	108.452	0,08 %
Aviva plc^	100.000	3,38 %	04.12.2045	108.409	0,08 %
SSE plc	100.000	2,38 %	10.02.2022	108.267	0,08 %
Barclays Bank plc	100.000	4,00 %	07.10.2019	107.593	0,08 %
Urenco Finance NV	100.000	2,25 %	05.08.2022	107.464	0,08 %
Bank of Scotland plc	100.000	4,88 %	04.06.2019	107.406	0,08 %
Vodafone Group plc	100.000	2,20 %	25.08.2026	107.060	0,08 %
Leeds Building Society	100.000	2,63 %	01.04.2021	106.784	0,08 %
ELM BV for RELX Finance	100.000	2,50 %	24.09.2020	106.495	0,08 %
Sky plc	100.000	1,88 %	24.11.2023	106.482	0,08 %
DS Smith plc	100.000	2,25 %	16.09.2022	106.333	0,08 %
Vodafone Group plc	100.000	1,75 %	25.08.2023	105.618	0,08 %
Hammerson plc	100.000	2,00 %	01.07.2022	105.481	0,08 %
Unilever NV	100.000	1,75 %	05.08.2020	104.728	0,08 %
Barclays plc	100.000	1,88 %	23.03.2021	104.704	0,08 %
BP Capital Markets plc	100.000	1,37 %	03.03.2022	104.647	0,08 %
Standard Chartered plc	100.000	4,13 %	18.01.2019	104.383	0,08 %
Yorkshire Building Society	100.000	1,25 %	11.06.2021	104.083	0,08 %
Barclays plc^	100.000	2,63 %	11.11.2025	103.968	0,08 %
FCE Bank plc	100.000	1,53 %	09.11.2020	103.865	0,08 %
Barclays plc	100.000	1,50 %	01.04.2022	103.753	0,08 %
Centrica plc^	100.000	3,00 %	10.04.2076	103.500	0,08 %
Channel Link Enterprises Finance plc^	100.000	2,71 %	30.06.2050	103.473	0,08 %
Lloyds Bank plc	100.000	1,25 %	13.01.2025	103.382	0,08 %
Vodafone Group plc	100.000	1,25 %	25.08.2021	103.360	0,08 %
BAT International Finance plc	100.000	2,25 %	16.01.2030	103.353	0,08 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Coca-Cola European Partners plc	100.000	1,75 %	26.05.2028	103.315	0,08 %
HSBC Holdings plc^	100.000	3,38 %	10.01.2024	103.247	0,08 %
Santander UK plc	100.000	1,13 %	14.01.2022	103.021	0,08 %
Nationwide Building Society	100.000	1,13 %	03.06.2022	102.984	0,08 %
CNH Industrial Finance Europe SA	100.000	1,75 %	12.09.2025	102.710	0,08 %
Aptiv plc	100.000	1,50 %	10.03.2025	102.577	0,08 %
FCE Bank plc	100.000	1,13 %	10.02.2022	102.198	0,08 %
Nationwide Building Society	100.000	1,63 %	03.04.2019	102.154	0,08 %
Vodafone Group plc	100.000	1,00 %	11.09.2020	102.146	0,08 %
Mondi Finance plc	100.000	1,50 %	15.04.2024	101.988	0,07 %
Nationwide Building Society	100.000	0,75 %	25.06.2019	101.613	0,07 %
Lloyds Banking Group plc	100.000	0,75 %	09.11.2021	101.594	0,07 %
FCE Bank plc	100.000	0,87 %	13.09.2021	101.572	0,07 %
GlaxoSmithKline Capital plc	100.000	0,63 %	02.12.2019	101.320	0,07 %
Lloyds Bank plc	100.000	0,38 %	18.01.2021	101.281	0,07 %
Imperial Brands Finance plc	100.000	1,38 %	27.01.2025	101.229	0,07 %
Nationwide Building Society^	100.000	2,00 %	25.07.2029	101.224	0,07 %
easyJet plc	100.000	1,13 %	18.10.2023	101.112	0,07 %
British Telecommunications plc	100.000	0,63 %	10.03.2021	101.071	0,07 %
AstraZeneca plc	100.000	1,25 %	12.05.2028	100.850	0,07 %
BAT International Finance plc	100.000	0,88 %	13.10.2023	100.464	0,07 %
Vodafone Group plc	100.000	2,88 %	20.11.2037	100.459	0,07 %
Anglo American Capital plc	100.000	1,63 %	18.09.2025	100.271	0,07 %
HSBC Holdings plc	100.000	0,88 %	06.09.2024	100.264	0,07 %
GlaxoSmithKline Capital plc	100.000	1,00 %	12.09.2026	100.209	0,07 %
Coventry Building Society	100.000	0,50 %	12.01.2024	100.154	0,07 %
Unilever NV	100.000	0,00 %	29.04.2020	100.140	0,07 %
Heathrow Funding Ltd.	100.000	1,50 %	11.02.2030	99.831	0,07 %
GlaxoSmithKline Capital plc	100.000	0,00 %	12.09.2020	99.824	0,07 %
Standard Chartered plc^	100.000	0,75 %	03.10.2023	99.731	0,07 %
British Telecommunications plc	100.000	1,50 %	23.06.2027	99.472	0,07 %
Vodafone Group plc	100.000	1,13 %	20.11.2025	99.353	0,07 %
British Telecommunications plc	100.000	1,00 %	21.11.2024	99.226	0,07 %
Compass Group International BV	100.000	0,63 %	03.07.2024	99.160	0,07 %
Cadent Finance plc	100.000	0,63 %	22.09.2024	97.785	0,07 %
				10.386.107	7,62 %
USA 8,22 %					
Procter & Gamble Co.	230.000	1,13 %	02.11.2023	238.427	0,18 %
Citigroup, Inc.	200.000	7,38 %	04.09.2019	224.940	0,17 %
JPMorgan Chase & Co.	200.000	2,63 %	23.04.2021	216.196	0,16 %
Citigroup, Inc.	200.000	2,13 %	10.09.2026	214.874	0,16 %
Goldman Sachs Group, Inc.	200.000	2,13 %	30.09.2024	213.773	0,16 %
Morgan Stanley	200.000	1,88 %	30.03.2023	212.066	0,16 %
Apple, Inc.	200.000	1,38 %	17.01.2024	210.063	0,15 %
Bank of America Corp.^	200.000	1,78 %	04.05.2027	208.482	0,15 %
International Business Machines Corp.	200.000	0,50 %	07.09.2021	202.346	0,15 %
Goldman Sachs Group, Inc.	200.000	0,75 %	10.05.2019	202.172	0,15 %
Pfizer, Inc.	200.000	0,25 %	06.03.2022	200.004	0,15 %
Priceline Group, Inc.	150.000	2,15 %	25.11.2022	160.844	0,12 %
Microsoft Corp.	100.000	3,13 %	06.12.2028	121.265	0,09 %
Oracle Corp.	100.000	3,13 %	10.07.2025	116.815	0,09 %
AT&T, Inc.	100.000	3,50 %	17.12.2025	115.657	0,08 %
JPMorgan Chase & Co.	100.000	3,00 %	19.02.2026	114.997	0,08 %
International Business Machines Corp.	100.000	2,88 %	07.11.2025	114.934	0,08 %
Verizon Communications, Inc.	100.000	3,25 %	17.02.2026	114.746	0,08 %
Prologis LP	100.000	3,38 %	20.02.2024	114.199	0,08 %
Morgan Stanley	100.000	5,38 %	10.08.2020	113.681	0,08 %
AT&T, Inc.	100.000	3,55 %	17.12.2032	112.148	0,08 %
JPMorgan Chase & Co.	100.000	2,75 %	01.02.2023	111.167	0,08 %
Aon plc	100.000	2,88 %	14.05.2026	111.050	0,08 %
McDonald's Corp.	100.000	2,38 %	27.11.2024	109.676	0,08 %
Bank of America Corp.	100.000	2,38 %	19.06.2024	109.614	0,08 %
AT&T, Inc.	100.000	2,65 %	17.12.2021	108.351	0,08 %
Verizon Communications, Inc.	100.000	2,38 %	17.02.2022	108.120	0,08 %
Merck & Co., Inc.	100.000	1,88 %	15.10.2026	107.951	0,08 %
Eli Lilly & Co.	100.000	2,13 %	03.06.2030	107.297	0,08 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Amgen, Inc.	100.000	2,00 %	25.02.2026	107.272	0,08 %
Blackstone Holdings Finance Co. LLC	100.000	2,00 %	19.05.2025	106.999	0,08 %
Mondelez International, Inc.	100.000	2,38 %	26.01.2021	106.477	0,08 %
Carnival Corp.	100.000	1,88 %	07.11.2022	106.315	0,08 %
Apple, Inc.	100.000	1,63 %	10.11.2026	106.168	0,08 %
Verizon Communications, Inc.	100.000	2,63 %	01.12.2031	105.928	0,08 %
Simon Property Group LP	100.000	2,38 %	02.10.2020	105.771	0,08 %
DH Europe Finance SA	100.000	1,70 %	04.01.2022	105.649	0,08 %
General Mills, Inc.	100.000	2,10 %	16.11.2020	105.153	0,08 %
Philip Morris International, Inc.	100.000	1,88 %	03.03.2021	105.112	0,08 %
Eastman Chemical Co.	100.000	1,88 %	23.11.2026	104.714	0,08 %
3M Co.	100.000	1,50 %	09.11.2026	104.650	0,08 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	100.000	2,43 %	13.12.2026	104.540	0,08 %
Metropolitan Life Global Funding I	100.000	2,38 %	30.09.2019	104.372	0,08 %
Mylan NV	100.000	2,25 %	22.11.2024	104.001	0,08 %
AT&T, Inc.	100.000	1,45 %	01.06.2022	103.931	0,08 %
Praxair, Inc.	100.000	1,20 %	12.02.2024	103.790	0,08 %
JPMorgan Chase & Co.	100.000	1,88 %	21.11.2019	103.775	0,08 %
AbbVie, Inc.	100.000	2,13 %	17.11.2028	103.652	0,08 %
Illinois Tool Works, Inc.	100.000	1,25 %	22.05.2023	103.644	0,08 %
Apple, Inc.	100.000	1,00 %	10.11.2022	103.611	0,08 %
Prologis LP	100.000	1,38 %	13.05.2021	103.559	0,08 %
Metropolitan Life Global Funding I	100.000	1,25 %	17.09.2021	103.551	0,08 %
Merck & Co., Inc.	100.000	1,13 %	15.10.2021	103.422	0,08 %
Amgen, Inc.	100.000	1,25 %	25.02.2022	103.398	0,08 %
Bunge Finance Europe BV	100.000	1,85 %	16.06.2023	103.347	0,08 %
International Business Machines Corp.	100.000	1,38 %	19.11.2019	102.839	0,08 %
Bank of America Corp.^	100.000	1,38 %	07.02.2025	102.816	0,08 %
JPMorgan Chase & Co.^	100.000	1,64 %	18.05.2028	102.637	0,08 %
AT&T, Inc.	100.000	3,15 %	04.09.2036	102.570	0,08 %
AT&T, Inc.	100.000	1,30 %	05.09.2023	102.497	0,08 %
Goldman Sachs Group, Inc.	100.000	1,38 %	15.05.2024	102.079	0,07 %
Morgan Stanley	100.000	1,00 %	02.12.2022	102.048	0,07 %
FedEx Corp.	100.000	1,63 %	11.01.2027	101.880	0,07 %
Kraft Heinz Foods Co.	100.000	1,50 %	24.05.2024	101.847	0,07 %
Southern Power Co.	100.000	1,00 %	20.06.2022	101.687	0,07 %
McKesson Corp.	100.000	1,50 %	17.11.2025	101.538	0,07 %
National Grid North America, Inc.	100.000	0,75 %	11.02.2022	101.503	0,07 %
Coca-Cola Co.	100.000	0,75 %	09.03.2023	101.493	0,07 %
Verizon Communications, Inc.	100.000	2,88 %	15.01.2038	101.267	0,07 %
Johnson & Johnson	100.000	1,15 %	20.11.2028	101.236	0,07 %
AT&T, Inc.	100.000	1,80 %	04.09.2026	100.989	0,07 %
Coca-Cola Co.	100.000	1,13 %	09.03.2027	100.959	0,07 %
McDonald's Corp.	100.000	0,50 %	15.01.2021	100.801	0,07 %
Molson Coors Brewing Co.	100.000	1,25 %	15.07.2024	100.746	0,07 %
Goldman Sachs Group, Inc.	100.000	1,25 %	01.05.2025	100.742	0,07 %
Johnson & Johnson	100.000	0,25 %	20.01.2022	100.489	0,07 %
Bank of America Corp.	100.000	0,75 %	26.07.2023	100.384	0,07 %
Morgan Stanley	100.000	1,38 %	27.10.2026	100.091	0,07 %
Allergan Funding SCS	100.000	0,50 %	01.06.2021	100.071	0,07 %
Kellogg Co.	100.000	1,00 %	17.05.2024	100.006	0,07 %
Morgan Stanley^	100.000	1,34 %	23.10.2026	99.872	0,07 %
John Deere Cash Management SA	100.000	0,50 %	15.09.2023	99.774	0,07 %
Toyota Motor Credit Corp.	100.000	0,63 %	21.11.2024	99.419	0,07 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	100.000	1,45 %	16.03.2027	99.349	0,07 %
Discovery Communications LLC	100.000	1,90 %	19.03.2027	99.346	0,07 %
JPMorgan Chase & Co.	100.000	0,63 %	25.01.2024	99.316	0,07 %
Dover Corp.	100.000	1,25 %	09.11.2026	99.313	0,07 %
United Parcel Service, Inc.	100.000	0,38 %	15.11.2023	98.823	0,07 %
McDonald's Corp.	100.000	1,50 %	28.11.2029	98.613	0,07 %
Whirlpool Finance Luxembourg Sarl	100.000	1,10 %	09.11.2027	97.724	0,07 %
Philip Morris International, Inc.	100.000	1,88 %	06.11.2037	96.951	0,07 %
PepsiCo, Inc.	100.000	0,88 %	18.07.2028	96.811	0,07 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	100.000	1,38 %	12.09.2028	96.440	0,07 %
Coca-Cola Co.	100.000	1,10 %	02.09.2036	90.578	0,07 %
Goldman Sachs Group, Inc.	50.000	3,25 %	01.02.2023	56.155	0,04 %

	Kapital Euro (€)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Citigroup, Inc.	50.000	5,00 %	02.08.2019	54.030	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.	50.000	2,50 %	18.10.2021	53.994	0,04 %
				11.210.379	8,22 %
Summe Anleihen				133.481.090	97,91 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				133.481.090	97,91 %
		Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente					
Futures 0,62 %					
Euro-Bobl Futures März 2018		4	526.600	(160)	(0,00 %)
Euro-Bund Futures März 2018		2	323.780	(420)	(0,00 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente				(580)	(0,00 %)
				Marktwert Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva				2.845.366	2,09 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)				136.325.876	100,00 %
				Euro (€)	% des Gesamt- nettovermögens
Analyse des Gesamtvermögens					
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind				115.727.044	84,89 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere				17.754.046	13,02 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente				(580)	(0,00 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva				2.845.366	2,09 %
Gesamtnettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)				136.325.876	100,00 %

[^] Zinsvariable Anleihe (FRN). Der Effektivzins zum 31. Dezember 2017.

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

Für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017¹

	Kapital Euro (€)	Kosten Euro (€)		Kapital Euro (€)	Kosten Euro (€)
Käufe			Verkäufe		
Bundesobligation 0,00 % 17.4.2020	3.900.000	3.968.361	Bundesobligation 0,00 % 17.4.2020	3.900.000	3.968.074
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,00 % 15.8.2024	2.600.000	2.780.313	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1,00 % 15.8.2024	2.000.000	2.149.068
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,50 % 4.1.2021	1.500.000	1.636.830	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,50 % 15.8.2027	1.550.000	1.566.584
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,50 % 15.8.2027	1.550.000	1.565.778	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,00 % 4.1.2037	470.000	727.843
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,00 % 4.1.2037	470.000	722.726	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,25 % 4.9.2020	500.000	544.150
European Investment Bank 1,38 % 15.09.2021	600.000	637.398	European Investment Bank 2,50 % 15.10.2018	300.000	308.883
European Investment Bank 2,25 % 14.10.2022	500.000	558.906	Bundesobligation 0,25 % 16.10.2020	300.000	307.851
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 2,25 % 5.9.2022	500.000	556.538	Europäischer Stabilitätsmechanismus 1,25 % 15.10.2018	300.000	305.280
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,25 % 4.9.2020	500.000	543.925	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 2,25 % 5.9.2022	250.000	279.080
European Investment Bank 1,63 % 15.03.2023	500.000	542.704	NIBC Bank NV 0,25 % 22.4.2022	235.000	237.330
European Investment Bank 0,13 % 15.06.2020	500.000	508.486	Europäische Union 1,88 % 04.04.2024	200.000	224.326
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,00 % 29.3.2021	500.000	504.050	Europäischer Stabilitätsmechanismus 0,05 % 17.12.2018	210.000	211.336
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 3,00 % 4.9.2034	400.000	499.172	innogy Finance BV 5,13 % 23.7.2018	200.000	210.206
European Investment Bank 1,00 % 14.03.2031	500.000	494.185	Cie de Saint-Gobain 4,00 % 8.10.2018	200.000	207.910
European Investment Bank 0,13 % 15.04.2025	500.000	489.545	OP Mortgage Bank 0,63 % 4.9.2022	200.000	205.822
European Investment Bank 4,63 % 15.04.2020	400.000	455.114	Adecco International Financial Services BV 1,00 % 2.12.2024	200.000	203.362
Romanian Government International Bond 3,63 % 24.4.2024	400.000	453.807	Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,00 % 29.3.2021	200.000	201.714
European Investment Bank 0,50 % 15.01.2027	450.000	447.964	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 2,40 % 17.1.2025	120.000	137.023
Caisse Francaise de Financement Local 3,50 % 24.9.2020	400.000	445.249	European Investment Bank 3,50 % 15.04.2027	100.000	127.900
European Investment Bank 2,50 % 15.03.2019	400.000	419.605	Philip Morris International, Inc. 3,13 % 3.6.2033	100.000	120.669

¹ Der Fonds wurde am 18. Juli 2017 aufgelegt.

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Berichtszeitraums. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Berichtszeitraum überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Berichtszeitraum ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	Euro (€) Zum 31. Dezember 2017
Umlaufvermögen	
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	133.481.090
Barmittel und liquide Vermögenswerte	601.308
Forderungen:	
Zinsen und Dividenden	1.363.748
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	3.948.000
Bareinschüsse für Futures	2.034
Summe Umlaufvermögen	139.396.180
Kurzfristige Passiva	
Derivative Finanzinstrumente	580
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:	
Erworbene Kapitalanlagen	3.041.298
Zahlbare Verwaltungsgebühren	28.426
Summe kurzfristige Passiva	3.070.304
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	136.325.876

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)	
Nettovermögen	4.962
Anzahl der umlaufenden Anteile	50
Nettoinventarwert je Anteil	99,24
Institutionelle Euro-Anteile (€)	
Nettovermögen	136.320.914
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.347.419
Nettoinventarwert je Anteil	101,17

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	Euro (€) Berichtszeitraum bis zum 31. Dezember 2017 ¹
Anlageerträge/(-verluste)	
Zinserträge	332.024
Verschiedene Erträge	200
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	1.023.284
Summe Anlageerträge/(-verluste)	1.355.508
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühren	140.280
Transaktionsgebühren und Provisionen	97
Sonstige Aufwendungen	14
Summe Aufwendungen	140.391
Finanzierungskosten	
Zinsaufwand	2.585
Summe Finanzierungskosten	2.585
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1.212.532
Ausländische Quellensteuer	(9.045)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)	1.203.487

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer
gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	Euro (€) Berichtszeitraum bis zum 31. Dezember 2017 ¹
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens	
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	1.203.487
Kapitalgeschäfte	
Zeichnungen	138.387.389
Rücknahmen	(3.265.000)
Summe Kapitalgeschäfte	135.122.389
Gesamtsteigerung/(-minderung) für den Zeitraum	136.325.876
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)	
Zu Beginn des Berichtszeitraums	—
Ende des Berichtszeitraums	136.325.876

¹ Der Fonds wurde am 18. Juli 2017 aufgelegt.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Berichtszeitraums verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für den Berichtszeitraum beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

U.K. Government Bond Index Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Asset Management, Limited.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds strebt eine Rendite an, die der Wertentwicklung des Bloomberg Barclays U.K. Government Float Adjusted Bond Index entspricht, eines marktgewichteten Index, der das gesamte Spektrum der auf Pfund Sterling lautenden britischen Schatztitel und regierungsnahen Wertpapiere mit Laufzeiten von mehr als einem Jahr widerspiegeln soll.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	63	62
Rendite auf Endfälligkeit	1,2 % ³	1,2 %
Durchschnittlicher Kupon	3,1 %	3,2 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	17,4 Jahre	17,5 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	Aa	Aa
Durchschnittliche Duration	12,3 Jahre	12,3 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Thesaurierende Anteile	0,15 %	
Ausschüttende Anteile	0,15 %	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,06 %	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,06 %	
Kurzfristige Reserven	0,7 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
R ²	1,00	1,00
Beta	1,00	1,00

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

Treasury-Titel	98,3 %
Agency-Titel	1,7

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aa	100,0 %
----	---------

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	27,9 %
5-10 Jahre	18,0
Mehr als 10 Jahre	54,1

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit	Kurz	Mittel	Lang
Kreditqualität Staats-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays U.K. Government Float Adjusted Bond Index.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

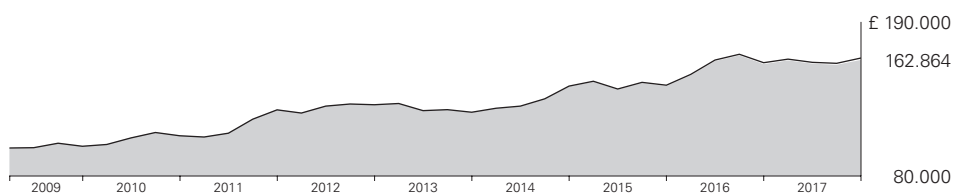
U.K. Government Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays U.K. Government Float Adjusted Bond Index

In GBP

Kumulative Wertentwicklung: 23. Juni 2009–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile	1,89 %	4,46 %	5,89 %	£ 162.864
Benchmark ²	2,08	4,64	5,99	164.219
				Endwert einer Anlage von £ 100.000
Ausschüttende Anteile	1,89 %	4,46 %	5,88 %	£ 162.780
Benchmark ²	2,08	4,64	5,99	164.219
				Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile		1,98 %	5,92 %	£ 242.182.800
Benchmark		2,08	6,04	243.080.110
				Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
Institutionelle Plus-Ertragsanteile		1,98 %	5,91 %	£ 242.159.034
Benchmark		2,08	6,04	243.080.110

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,19 Prozentpunkte für Thesaurierungsanteile und Ertragsanteile und 0,10 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile und institutionelle Plus-Ertragsanteile.³

1 Für Thesaurierungs- und Ertragsanteile, 23. Juni 2009; für institutionelle Plus-Thesaurierungs- und institutionelle Plus-Ertragsanteile; 2. September 2014.

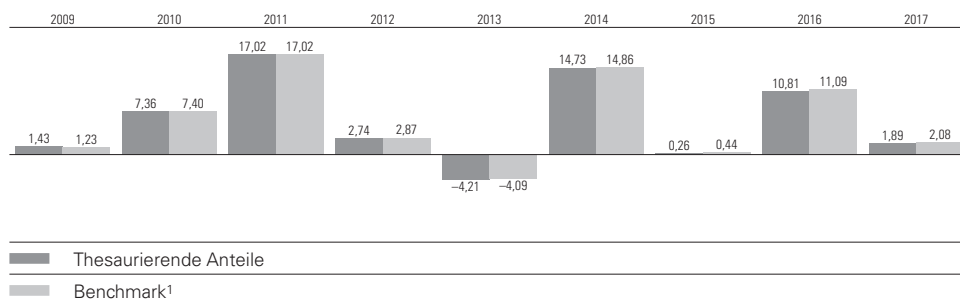
2 Bloomberg Barclays U.K. Government Bond Index bis 30. Juni 2010; danach Bloomberg Barclays U.K. Government Float Adjusted Bond Index.

3 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

U.K. Government Bond Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays U.K. Government Float Adjusted Bond Index

In GBP

Summe Anlagerenditen (%): 23. Juni 2009–31. Dezember 2017

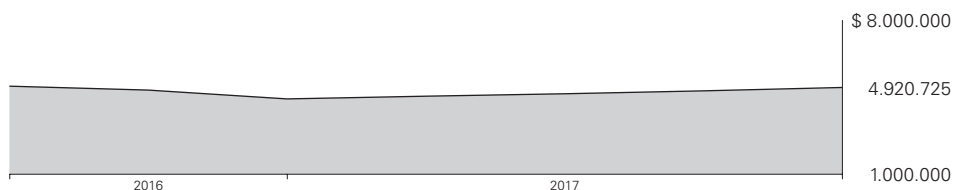


1 Bloomberg Barclays U.K. Government Bond Index bis 30. Juni 2010; danach Bloomberg Barclays U.K. Government Float Adjusted Bond Index.

U.K. Government Bond Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays U.K. Government Float Adjusted Bond Index

In USD

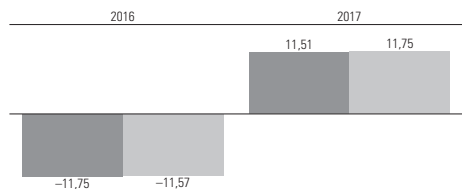
Kumulative Wertentwicklung: 8. September 2016–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
— Institutionelle Anteile	11,51 %	-1,21 %	\$ 4.920.725
— Benchmark	11,75	-0,90	4.940.932

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,24 Prozentpunkte für institutionelle Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 8. September 2016–31. Dezember 2017



■ Institutionelle Anteile
■ Benchmark

¹ 8. September 2016.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsergebnisse und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 99,26 % (2016: 99,08 %)					
Verschiedene Finanzdienstleistungen 1,34 % (2016: 1,23 %)					
LCR Finance plc	4.975.000	4,50 %	07.12.2028	6.413.235	0,29 %
Network Rail Infrastructure Finance plc	2.870.000	4,75 %	29.11.2035	4.103.969	0,19 %
Network Rail Infrastructure Finance plc	3.150.000	4,75 %	22.01.2024	3.809.682	0,17 %
LCR Finance plc	1.820.000	5,10 %	07.03.2051	3.191.185	0,15 %
Affordable Housing Finance plc	2.775.000	2,89 %	11.08.2043	3.190.207	0,15 %
Network Rail Infrastructure Finance plc	2.250.000	4,38 %	09.12.2030	2.946.168	0,13 %
Network Rail Infrastructure Finance plc	1.650.000	4,63 %	21.07.2020	1.813.219	0,08 %
Network Rail Infrastructure Finance plc	1.500.000	3,00 %	07.09.2023	1.658.752	0,08 %
Affordable Housing Finance plc	820.000	3,80 %	20.05.2042	1.078.186	0,05 %
LCR Finance plc	660.000	4,50 %	07.12.2038	944.823	0,04 %
Merseylink Issuer plc	250.000	3,84 %	31.03.2043	323.872	0,01 %
				29.473.298	1,34 %
Staatlich 97,57 % (2016: 97,41 %)					
United Kingdom Gilt	156.002.000	2,00 %	22.07.2020	161.965.696	7,37 %
United Kingdom Gilt	138.315.000	1,75 %	22.07.2019	141.094.440	6,41 %
United Kingdom Gilt	113.340.000	0,50 %	22.07.2022	112.215.289	5,10 %
United Kingdom Gilt	76.305.000	3,25 %	22.01.2044	99.368.853	4,52 %
United Kingdom Gilt	68.871.850	4,50 %	07.09.2034	97.915.867	4,45 %
United Kingdom Gilt	66.200.485	4,25 %	07.03.2036	93.050.409	4,23 %
United Kingdom Gilt	59.545.000	3,75 %	22.07.2052	91.669.785	4,17 %
United Kingdom Gilt	78.785.000	0,75 %	22.07.2023	78.264.231	3,56 %
United Kingdom Gilt	53.835.000	3,50 %	22.01.2045	73.537.277	3,34 %
United Kingdom Gilt	72.000.000	1,25 %	22.07.2027	72.173.796	3,29 %
United Kingdom Gilt	41.445.000	3,50 %	22.07.2068	69.192.856	3,14 %
United Kingdom Gilt	42.761.712	4,25 %	07.12.2046	66.596.503	3,03 %
United Kingdom Gilt	40.633.619	4,50 %	07.12.2042	62.941.933	2,86 %
United Kingdom Gilt	42.275.000	2,50 %	22.07.2065	55.257.346	2,51 %
United Kingdom Gilt	49.500.000	2,00 %	07.09.2025	53.129.917	2,41 %
United Kingdom Gilt	50.800.000	1,50 %	22.01.2021	52.258.298	2,38 %
United Kingdom Gilt	49.900.000	1,50 %	22.07.2026	51.535.270	2,34 %
United Kingdom Gilt	29.637.434	4,25 %	07.12.2055	51.402.947	2,34 %
United Kingdom Gilt	45.695.000	2,75 %	07.09.2024	51.092.112	2,32 %
United Kingdom Gilt	30.927.357	4,25 %	07.12.2049	50.019.077	2,27 %
United Kingdom Gilt	30.671.347	4,25 %	07.12.2040	45.118.012	2,05 %
United Kingdom Gilt	25.655.215	4,00 %	22.01.2060	44.400.625	2,02 %
United Kingdom Gilt	31.200.000	4,25 %	07.12.2027	40.108.110	1,82 %
United Kingdom Gilt	27.346.547	4,25 %	07.09.2039	39.723.744	1,81 %
United Kingdom Gilt	33.580.000	3,75 %	07.09.2021	37.443.007	1,70 %
United Kingdom Gilt	26.502.134	4,25 %	07.06.2032	35.902.383	1,63 %
United Kingdom Gilt	34.740.000	1,75 %	07.09.2037	34.816.869	1,58 %
United Kingdom Gilt	32.419.275	1,75 %	22.07.2057	33.552.058	1,52 %
United Kingdom Gilt	35.330.000	1,50 %	22.07.2047	33.236.521	1,51 %
United Kingdom Gilt	23.805.946	5,00 %	07.03.2025	30.494.680	1,39 %
United Kingdom Gilt	18.983.481	4,75 %	07.12.2038	29.105.133	1,32 %
United Kingdom Gilt	26.192.000	4,50 %	07.03.2019	27.443.839	1,25 %
United Kingdom Gilt	21.542.976	8,00 %	07.06.2021	26.956.002	1,23 %
United Kingdom Gilt	18.695.594	4,75 %	07.12.2030	26.055.346	1,18 %
United Kingdom Gilt	19.957.228	4,00 %	07.03.2022	22.735.443	1,03 %
United Kingdom Gilt	13.504.250	6,00 %	07.12.2028	20.030.424	0,91 %
United Kingdom Gilt	11.426.340	3,75 %	07.09.2020	12.417.946	0,56 %
United Kingdom Gilt	10.000.000	1,25 %	22.07.2018	10.048.000	0,46 %
United Kingdom Gilt	9.249.000	2,25 %	07.09.2023	9.973.258	0,45 %
United Kingdom Gilt	2.400.000	1,75 %	07.09.2022	2.512.761	0,11 %
				2.146.756.063	97,57 %
Transportdienstleistungen 0,35 % (2016: 0,44 %)					
Transport for London	2.100.000	4,00 %	07.04.2064	3.163.139	0,13 %
Transport for London	1.200.000	2,13 %	24.04.2025	1.252.840	0,05 %
Transport for London	800.000	4,00 %	12.09.2033	1.000.641	0,05 %
Transport for London	950.000	2,25 %	09.08.2022	995.991	0,05 %
Transport for London	450.000	3,88 %	23.07.2042	574.536	0,03 %
Transport for London	300.000	3,63 %	15.05.2045	372.712	0,02 %
Transport for London	150.000	4,50 %	31.03.2031	182.630	0,01 %
Transport for London	100.000	5,00 %	31.03.2035	134.512	0,01 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
				7.677.001	0,35 %
Summe Anleihen				2.183.906.362	99,26 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				2.183.906.362	99,26 %
	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens	
Derivative Finanzinstrumente					
Futures 0,00 % (2016: 0,00 %)					
Long Gilt Futures März 2018	12	1.489.080	12.840	0,00 %	
Summe Derivative Finanzinstrumente			12.840	0,00 %	
	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens			
Sonstige Aktiva und Passiva	16.244.413	0,74 %			
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)	2.200.163.615	100,00 %			
Analyse des Gesamtvermögens	GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens			
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	2.183.906.362	99,26 %			
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	—	0,00 %			
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	—	0,00 %			
(d) Derivative Finanzinstrumente	12.840	0,00 %			
(e) Sonstige Aktiva und Passiva	16.244.413	0,74 %			
Gesamt Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)	2.200.163.615	100,00 %			

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Kapital GBP (£)	Kosten GBP (£)		Kapital GBP (£)	Erlöse GBP (£)
Käufe			Verkäufe		
United Kingdom Gilt 0,50 % 22.07.2022	128.740.000	128.374.853	United Kingdom Gilt 1,25 % 22.07.2018	73.520.000	74.261.437
United Kingdom Gilt 2,00 % 22.07.2020	107.437.000	112.882.212	United Kingdom Gilt 2,25 % 07.09.2023	58.261.000	62.953.829
United Kingdom Gilt 1,75 % 22.07.2019	108.120.000	111.323.539	United Kingdom Gilt 4,75 % 07.03.2020	47.860.143	53.111.102
United Kingdom Gilt 0,75 % 22.07.2023	78.785.000	78.280.588	United Kingdom Gilt 1,75 % 07.09.2022	48.040.000	51.199.463
United Kingdom Gilt 1,25 % 22.07.2027	72.000.000	72.193.391	United Kingdom Gilt 4,25 % 07.12.2027	27.922.101	36.661.318
United Kingdom Gilt 3,25 % 22.01.2044	44.450.000	57.875.291	United Kingdom Gilt 3,75 % 07.09.2019	32.817.089	34.977.438
United Kingdom Gilt 4,25 % 07.12.2046	35.772.000	55.521.620	United Kingdom Gilt 0,50 % 22.07.2022	26.700.000	26.428.416
United Kingdom Gilt 4,50 % 07.09.2034	31.500.000	45.435.875	United Kingdom Gilt 4,75 % 07.12.2030	18.200.000	25.749.620
United Kingdom Gilt 1,75 % 22.07.2057	40.419.275	41.294.334	United Kingdom Gilt 1,75 % 22.07.2019	24.300.000	25.003.765
United Kingdom Gilt 4,25 % 07.12.2027	31.200.000	40.279.237	United Kingdom Gilt 4,25 % 07.12.2046	15.200.000	23.467.026
United Kingdom Gilt 4,25 % 07.03.2036	28.400.000	40.154.746	United Kingdom Gilt 4,00 % 07.03.2022	19.600.000	22.995.173
United Kingdom Gilt 2,50 % 22.07.2065	29.165.000	37.675.155	United Kingdom Gilt 5,00 % 07.03.2018	21.031.145	21.854.675
United Kingdom Gilt 2,25 % 07.09.2023	29.400.000	31.999.819	United Kingdom Gilt 3,75 % 07.09.2020	14.000.000	15.659.560
United Kingdom Gilt 3,75 % 22.07.2052	20.340.000	31.655.597	United Kingdom Gilt 3,50 % 22.01.2045	11.300.000	15.180.838
United Kingdom Gilt 1,75 % 07.09.2037	28.940.000	28.833.136	United Kingdom Gilt 4,25 % 07.06.2032	10.300.000	13.740.786
United Kingdom Gilt 1,50 % 22.07.2026	24.800.000	25.531.850	United Kingdom Gilt 1,50 % 22.07.2026	12.000.000	12.530.424
United Kingdom Gilt 3,50 % 22.01.2045	15.790.000	21.078.975	United Kingdom Gilt 6,00 % 07.12.2028	8.000.000	12.063.605
United Kingdom Gilt 4,25 % 07.12.2049	12.806.000	20.805.168	United Kingdom Gilt 3,25 % 22.01.2044	9.300.000	12.042.713
United Kingdom Gilt 2,75 % 07.09.2024	17.900.000	20.486.492	United Kingdom Gilt 4,50 % 07.03.2019	11.000.000	11.642.370
United Kingdom Gilt 3,50 % 22.07.2068	12.070.000	19.704.994	United Kingdom Gilt 4,75 % 07.12.2038	7.400.000	11.320.887
United Kingdom Gilt 2,00 % 07.09.2025	17.800.000	19.049.538	United Kingdom Gilt 2,50 % 22.07.2065	8.560.000	11.017.639
United Kingdom Gilt 1,50 % 22.07.2047	20.430.000	18.979.786	United Kingdom Gilt 4,00 % 22.01.2060	5.800.000	10.102.443
United Kingdom Gilt 4,50 % 07.03.2019	17.000.000	18.493.640	United Kingdom Gilt 1,75 % 22.07.2057	8.000.000	8.155.980
United Kingdom Gilt 6,00 % 07.12.2028	11.800.000	17.708.543	United Kingdom Gilt 4,25 % 07.09.2039	5.333.000	7.752.657
United Kingdom Gilt 4,50 % 07.12.2042	10.040.000	15.248.737	United Kingdom Gilt 5,00 % 07.03.2025	5.500.000	7.052.925
United Kingdom Gilt 4,25 % 07.12.2055	7.745.987	13.113.464			
United Kingdom Gilt 1,75 % 07.09.2022	12.200.000	12.976.610			
United Kingdom Gilt 4,75 % 07.03.2020	11.000.000	12.495.660			

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	GBP (£) Zum 31. Dezember 2017	GBP (£) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.183.906.362	1.579.076.910
Derivative Finanzinstrumente	12.840	—
Barmittel und liquide Vermögenswerte	1.199.707	3.466.397
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	15.280.522	11.767.234
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	7.832.625	12.226.135
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	950.611	—
Bareinschüsse für Futures	21.000	—
Sonstige Forderungen	—	5.169
Summe Umlaufvermögen	2.209.203.667	1.606.541.845
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	—	23.427
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	5.101.786	5.788.526
Zahlbare Dividenden	1.714.874	2.784.674
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	1.964.892	3.978.753
Zahlbare Verwaltungsgebühren	258.500	184.256
Summe kurzfristige Passiva	9.040.052	12.759.636
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	2.200.163.615	1.593.782.209

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
GBP (£) Equivalent	4.071	19.723.743	—
Nettovermögen	5.507	24.371.643	—
Anzahl der umlaufenden Anteile	56	276.145	—
Nettoinventarwert je Anteil	98,34	88,26	—
Thesaurierende GBP-Anteile (£)			
Nettovermögen	1.673.956.506	838.871.552	532.787.973
Anzahl der umlaufenden Anteile	10.278.227	5.247.820	3.693.544
Nettoinventarwert je Anteil	162,86	159,85	144,25
Ausschüttende GBP-Anteile (£)			
Nettovermögen	280.550.140	562.792.745	317.542.802
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.112.238	4.258.673	2.619.311
Nettoinventarwert je Anteil	132,82	132,15	121,23
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile (£)			
Nettovermögen	13.709.986	8.353.213	54.969
Anzahl der umlaufenden Anteile	113.220	70.346	513
Nettoinventarwert je Anteil	121,09	118,74	107,06
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)			
Nettovermögen	231.942.912	164.040.956	46.384.506
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.029.518	1.442.645	444.688
Nettoinventarwert je Anteil	114,28	113,71	104,31

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	GBP (£) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	GBP (£) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	29.721.028	22.422.864
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	7.555.242	90.344.802
Summe Anlageerträge/(-verluste)	37.276.270	112.767.666
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	2.761.387	1.802.606
Transaktionsgebühren und Provisionen	52	—
Sonstige Aufwendungen	—	6
Summe Aufwendungen	2.761.439	1.802.612
Finanzierungskosten		
Ausgezählte Ausschüttungen	8.181.875	9.974.548
Ertragsausgleich	1.010.691	(952.985)
Summe Finanzierungskosten	9.192.566	9.021.563
Nettoanlageerträge/(-verluste)	25.322.265	101.943.491
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	25.322.265	101.943.491

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	GBP (£) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	GBP (£) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	25.322.265	101.943.491
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	1.619.600.154	1.016.611.241
Rücknahmen	(1.041.313.354)	(423.860.176)
Reinvestitionen	2.772.341	2.317.403
Summe Kapitalgeschäfte ¹	581.059.141	595.068.468
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	606.381.406	697.011.959
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	1.593.782.209	896.770.250
Zum Jahresende	2.200.163.615	1.593.782.209

1 Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

U.K. Investment Grade Bond Index Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Asset Management, Limited.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds strebt eine Rendite an, die der Wertentwicklung des Bloomberg Barclays GBP Non-Government Float Adjusted Bond Index entspricht, eines marktgewichteten Index, der das gesamte Spektrum der auf Pfund Sterling lautenden festverzinslichen Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating und Laufzeiten von mehr als einem Jahr widerspiegeln soll, ausgenommen Schatztitel und regierungsnahe Wertpapiere.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	963	971
Rendite auf Endfälligkeit	2,1 % ³	2,1 %
Durchschnittlicher Kupon	4,5 %	4,4 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	11,5 Jahre	11,6 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	A2	A2
Durchschnittliche Duration	8,1 Jahre	8,1 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Thesaurierende Anteile	0,15 %	
Ausschüttende Anteile	0,15 %	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,06 %	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,06 %	
Kurzfristige Reserven	2,2 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
R ²	0,99	1,00
Beta	1,01	1,00

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Vereinigtes Königreich	46,6 %	45,5 %
USA	11,5	11,8
Deutschland	10,6	10,6
Supranationale Anleihen	7,6	7,8
Frankreich	6,9	7,0
Niederlande	3,1	3,0
Australien	2,3	2,4
Schweden	1,5	1,5
Belgien	1,4	1,4
Italien	1,4	1,7
Mexiko	1,1	1,1
Schweiz	1,1	1,1
Kanada	1,0	1,0
Sonstige	3,9	4,1

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

Behörden	12,9 %
Forderungsbesicherte Wertpapiere	7,8
Finanzinstitute	28,1
Industriegüter	26,6
Lokale Behörde	0,8
Staatlich	1,0
Supranationale Anleihen	7,6
Treasury/Federal	2,4
Versorger	12,8

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	19,1 %
Aa	10,6
A	30,4
Baa	38,3
Weniger als Baa2	0,1
nicht eingestuft	1,5

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	30,1 %
5-10 Jahre	22,7
Mehr als 10 Jahre	47,2

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit

Durchschnittliche Fälligkeit	Kurz	Mittel	Lang
Kreditqualität Staats-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays GBP Non-Government Float Adjusted Bond Index.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

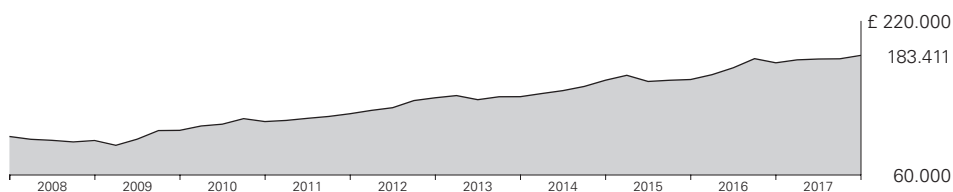
Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

U.K. Investment Grade Bond Index Fund
Benchmark: Bloomberg Barclays GBP Non-Government Float Adjusted Bond Index

In GBP

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Thesaurierende Anteile	4,23 %	5,53 %	6,25 %	£ 183.411
Benchmark ¹	4,38	5,61	6,30	184.214
				Endwert einer Anlage von £ 100.000
Ausschüttende Anteile	4,23 %	5,53 %	6,23 %	£ 183.019
Benchmark ¹	4,38	5,61	6,30	184.214
		Ein Jahr	Seit Auflegung ²	Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile		4,32 %	5,89 %	£ 241.946.400
Benchmark		4,38	5,94	242.320.391
		Ein Jahr	Seit Auflegung ²	Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
Institutionelle Plus-Ertragsanteile		4,32 %	5,89 %	£ 241.974.238
Benchmark		4,38	5,94	242.320.391

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,15 Prozentpunkte für Thesaurierungsanteile und Ertragsanteile und 0,06 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile und institutionelle Plus-Ertragsanteile.³

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,50 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

¹ Bloomberg Barclays GBP Non-Government Bond Index bis 30. Juni 2010; und danach Bloomberg Barclays GBP Non-Government Float Adjusted Bond Index.

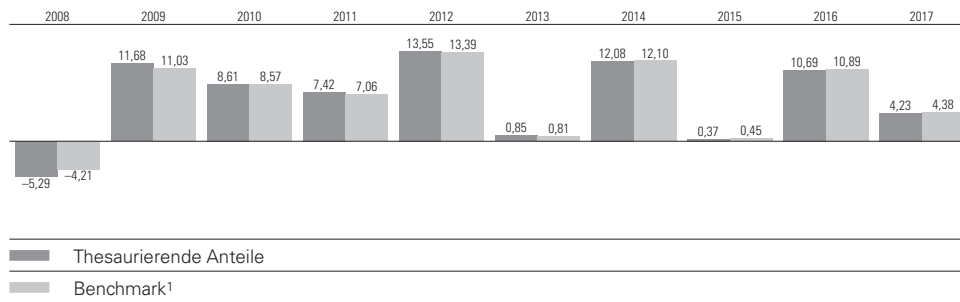
² Für institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile und institutionelle Plus-Ertragsanteile, 2. September 2014.

³ Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

U.K. Investment Grade Bond Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays GBP Non-Government Float Adjusted Bond Index

In GBP

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



¹ Bloomberg Barclays GBP Non-Government Bond Index bis 30. Juni 2010; und danach Bloomberg Barclays GBP Non-Government Float Adjusted Bond Index.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 97,04 % (2016: 98,18 %)					
Australien 2,31 % (2016: 2,31 %)					
BHP Billiton Finance Ltd.	5.650.000	4,30 %	25.09.2042	7.102.547	0,27 %
APT Pipelines Ltd.	3.500.000	3,50 %	22.03.2030	3.701.499	0,14 %
National Australia Bank Ltd.	3.600.000	1,88 %	20.02.2020	3.660.995	0,14 %
National Australia Bank Ltd.	3.250.000	0,88 %	26.06.2020	3.232.912	0,12 %
Commonwealth Bank of Australia	2.900.000	3,00 %	04.09.2026	3.222.335	0,12 %
Westpac Banking Corp.	3.000.000	5,00 %	21.10.2019	3.214.260	0,12 %
BHP Billiton Finance Ltd.^	2.600.000	6,50 %	22.10.2077	3.035.292	0,11 %
Commonwealth Bank of Australia	3.000.000	1,13 %	22.12.2021	2.998.398	0,11 %
Rio Tinto Finance plc	2.200.000	4,00 %	11.12.2029	2.579.460	0,10 %
Westpac Banking Corp.	2.400.000	1,00 %	30.06.2022	2.382.415	0,09 %
National Australia Bank Ltd.	2.300.000	1,13 %	10.11.2021	2.301.017	0,09 %
National Capital Trust I^	2.110.000	5,62 %	17.12.2166	2.181.681	0,08 %
Scentre Group Trust 1	1.700.000	3,88 %	16.07.2026	1.916.451	0,07 %
Westpac Banking Corp.	1.800.000	2,63 %	14.12.2022	1.899.718	0,07 %
Vicinity Centres	1.750.000	3,38 %	07.04.2026	1.882.867	0,07 %
Lendlease Europe Finance plc	1.616.000	6,13 %	12.10.2021	1.861.493	0,07 %
Scentre Group Trust 1/Scentre Group Trust 2	1.796.000	2,38 %	08.04.2022	1.858.233	0,07 %
National Australia Bank Ltd.	1.500.000	5,13 %	09.12.2021	1.717.659	0,06 %
National Australia Bank Ltd.	1.500.000	1,38 %	27.06.2022	1.497.885	0,06 %
Westfield America Management Ltd.	1.500.000	2,13 %	30.03.2025	1.497.876	0,06 %
Macquarie Bank Ltd.	1.400.000	3,50 %	18.12.2020	1.490.290	0,06 %
QBE Insurance Group Ltd.^	1.255.000	6,12 %	24.05.2042	1.429.520	0,05 %
SGSP Australia Assets Pty Ltd.	1.050.000	5,13 %	11.02.2021	1.164.404	0,04 %
Asciano Finance Ltd.	1.000.000	5,00 %	19.09.2023	1.126.030	0,04 %
Westpac Banking Corp.	1.000.000	2,13 %	02.05.2025	1.014.208	0,04 %
APT Pipelines Ltd.	700.000	4,25 %	26.11.2024	782.920	0,03 %
National Australia Bank Ltd.	600.000	3,00 %	04.09.2026	667.676	0,03 %
				61.420.041	2,31 %
Österreich 0,13 % (2016: 0,08 %)					
Oesterreichische Kontrollbank AG	3.500.000	0,75 %	07.03.2022	3.461.010	0,13 %
				3.461.010	0,13 %
Belgien 1,26 % (2016: 0,87 %)					
Anheuser-Busch InBev SA	4.600.000	2,85 %	25.05.2037	4.598.615	0,17 %
Dexia Credit Local SA	4.500.000	1,13 %	15.06.2022	4.490.847	0,17 %
Dexia Credit Local SA	4.500.000	0,88 %	07.09.2021	4.460.868	0,17 %
Anheuser-Busch InBev SA	2.925.000	9,75 %	30.07.2024	4.333.867	0,16 %
Anheuser-Busch InBev SA	3.500.000	2,25 %	24.05.2029	3.434.165	0,13 %
Dexia Credit Local SA	3.300.000	2,13 %	12.02.2025	3.416.913	0,13 %
Dexia Credit Local SA	3.000.000	2,00 %	17.06.2020	3.073.770	0,12 %
Anheuser-Busch InBev SA	2.700.000	1,75 %	07.03.2025	2.670.980	0,10 %
Anheuser-Busch InBev SA	2.200.000	4,00 %	24.09.2025	2.515.163	0,09 %
Kingdom of Belgium Government International Bond	472.000	9,38 %	21.02.2020	555.446	0,02 %
				33.550.634	1,26 %
Kanada 0,98 % (2016: 0,38 %)					
Province of Alberta Canada	3.750.000	1,00 %	15.11.2021	3.734.229	0,14 %
Export Development Canada	3.500.000	1,00 %	15.12.2020	3.522.307	0,13 %
Province of Manitoba Canada	3.300.000	0,75 %	15.12.2021	3.254.988	0,12 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	2.400.000	1,13 %	30.06.2022	2.392.440	0,09 %
Royal Bank of Canada	2.000.000	1,13 %	22.12.2021	2.003.892	0,08 %
Bank of Nova Scotia	2.000.000	1,25 %	08.06.2022	1.992.892	0,08 %
Bank of Nova Scotia	2.000.000	0,75 %	14.09.2021	1.978.376	0,07 %
Bank of Montreal	1.600.000	1,38 %	29.12.2021	1.608.451	0,06 %
Export Development Canada	1.500.000	1,38 %	16.12.2019	1.519.727	0,06 %
Toronto-Dominion Bank	1.500.000	1,00 %	13.12.2021	1.495.923	0,06 %
Provinz Quebec (Kanada)	1.400.000	0,88 %	24.05.2022	1.384.031	0,05 %
Export Development Canada	1.000.000	0,88 %	07.12.2021	997.620	0,04 %
				25.884.876	0,98 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Kaimaninseln 0,13 % (2016: 0,10 %)					
IPIC GMTN Ltd.	2.500.000	6,88 %	14.03.2026	3.351.250	0,13 %
				3.351.250	0,13 %
Dänemark 0,53 % (2016: 0,63 %)					
Orsted	4.950.000	4,88 %	12.01.2032	6.229.238	0,24 %
Orsted	2.250.000	5,75 %	09.04.2040	3.289.239	0,12 %
AP Moller – Maersk A/S	2.300.000	4,00 %	04.04.2025	2.486.374	0,09 %
TDC A/S	1.800.000	5,63 %	23.02.2023	2.095.913	0,08 %
				14.100.764	0,53 %
Finnland 0,30 % (2016: 0,35 %)					
Finland Government International Bond	2.800.000	1,63 %	15.12.2020	2.867.500	0,11 %
OP Corporate Bank plc	1.410.000	2,50 %	20.05.2022	1.481.651	0,06 %
Finland Government International Bond	1.300.000	1,50 %	19.12.2019	1.319.561	0,05 %
Municipality Finance plc	1.200.000	0,75 %	15.12.2020	1.196.844	0,04 %
Municipality Finance plc	1.000.000	1,25 %	07.03.2019	1.005.966	0,04 %
				7.871.522	0,30 %
Frankreich 6,84 % (2016: 7,25 %)					
Electricite de France SA	10.420.000	5,88 %	18.07.2031	13.756.588	0,52 %
Electricite de France SA	7.500.000	6,00 %	23.01.2114	10.863.975	0,41 %
Electricite de France SA	7.300.000	5,50 %	17.10.2041	9.578.330	0,36 %
Engie SA	5.200.000	5,00 %	01.10.2060	8.416.720	0,32 %
Electricite de France SA^	5.700.000	6,00 %	29.07.2166	6.074.604	0,23 %
SNCF Reseau EPIC	4.925.000	5,50 %	01.12.2021	5.734.632	0,22 %
AXA SA^	4.000.000	5,63 %	16.01.2054	4.865.028	0,18 %
Veolia Environnement SA	3.200.000	6,13 %	29.10.2037	4.738.797	0,18 %
BPCE SA	3.800.000	5,25 %	16.04.2029	4.623.563	0,17 %
SNCF Reseau EPIC	3.400.000	5,25 %	07.12.2028	4.509.973	0,17 %
SNCF Reseau EPIC	3.155.000	5,25 %	31.01.2035	4.494.028	0,17 %
SNCF Reseau EPIC	2.725.000	5,00 %	11.03.2052	4.433.065	0,17 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	4.000.000	1,00 %	07.03.2019	4.010.105	0,15 %
Engie SA	2.650.000	7,00 %	30.10.2028	3.871.496	0,15 %
Electricite de France SA	3.000.000	5,13 %	22.09.2050	3.855.546	0,15 %
Orange SA^	3.150.000	5,75 %	01.04.2166	3.514.600	0,13 %
SNCF Reseau EPIC	2.075.000	4,83 %	25.03.2060	3.513.349	0,13 %
Electricite de France SA	2.700.000	5,50 %	27.03.2037	3.479.744	0,13 %
Orange SA	2.558.000	5,63 %	23.01.2034	3.470.879	0,13 %
Electricite de France SA^	3.300.000	5,88 %	22.07.2166	3.437.676	0,13 %
Orange SA	2.300.000	5,38 %	22.11.2050	3.317.115	0,12 %
Orange SA^	2.800.000	5,88 %	07.02.2166	3.123.372	0,12 %
AXA SA^	2.650.000	5,45 %	04.03.2166	3.025.240	0,11 %
Bouygues SA	2.350.000	5,50 %	06.10.2026	2.948.051	0,11 %
Orange SA	1.900.000	8,13 %	20.11.2028	2.919.500	0,11 %
Electricite de France SA	2.050.000	6,25 %	30.05.2028	2.723.589	0,10 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	2.700.000	0,88 %	08.06.2020	2.685.393	0,10 %
BNP Paribas SA	2.700.000	1,13 %	16.08.2022	2.667.017	0,10 %
Orange SA	2.157.000	5,25 %	05.12.2025	2.653.265	0,10 %
AXA SA	2.250.000	7,13 %	15.12.2020	2.606.940	0,10 %
Electricite de France SA	2.050.000	6,88 %	12.12.2022	2.573.955	0,10 %
SNCF Mobilites EPIC	1.850.000	5,38 %	18.03.2027	2.399.679	0,09 %
Credit Agricole SA	1.800.000	7,38 %	18.12.2023	2.323.791	0,09 %
Total Capital International SA	2.000.000	2,25 %	09.06.2022	2.094.820	0,08 %
CNP Assurances^	1.700.000	7,38 %	30.09.2041	2.012.545	0,08 %
Dexia Credit Local SA	2.000.000	1,13 %	24.02.2019	2.007.356	0,08 %
IXIS Corporate & Investment Bank SA	1.812.000	5,88 %	24.02.2020	1.995.827	0,08 %
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	2.000.000	1,00 %	14.06.2022	1.990.588	0,07 %
Engie SA^	1.800.000	4,63 %	10.01.2167	1.859.398	0,07 %
BNP Paribas SA	1.800.000	2,38 %	20.11.2019	1.849.910	0,07 %
Suez	1.300.000	5,38 %	02.12.2030	1.725.688	0,07 %
Cie de Financement Foncier SA	1.275.000	5,50 %	26.01.2027	1.679.188	0,06 %
RCI Banque SA	1.600.000	3,00 %	09.05.2019	1.642.414	0,06 %
Cie de Saint-Gobain	1.300.000	5,63 %	15.11.2024	1.594.345	0,06 %
AXA SA^	1.300.000	6,69 %	06.07.2166	1.586.975	0,06 %
Societe Generale SA	1.400.000	5,00 %	20.12.2018	1.456.675	0,05 %
Cie de Saint-Gobain	1.200.000	4,63 %	09.10.2029	1.438.086	0,05 %
AXA SA^	1.250.000	6,77 %	16.10.2166	1.362.000	0,05 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Total Capital International SA	1.250.000	2,25 %	17.12.2020	1.295.827	0,05 %
Credit Agricole SA	950.000	5,50 %	17.12.2021	1.106.639	0,04 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	1.000.000	0,50 %	12.06.2020	992.665	0,04 %
BNP Paribas SA	850.000	5,75 %	24.01.2022	980.676	0,04 %
RCI Banque SA	962.000	1,88 %	08.11.2022	973.679	0,04 %
Orange SA	790.000	7,25 %	10.11.2020	924.104	0,03 %
Total Capital International SA	900.000	1,25 %	16.12.2024	884.439	0,03 %
Caisse des Depots et Consignations	800.000	1,50 %	23.12.2019	811.228	0,03 %
				181.474.677	6,84 %
Deutschland 10,53 % (2016: 9,84 %)					
KFW	21.400.000	1,13 %	23.12.2019	21.621.276	0,81 %
KFW	9.165.000	6,00 %	07.12.2028	13.270.718	0,50 %
KFW	7.265.000	5,75 %	07.06.2032	11.041.986	0,42 %
KFW	9.200.000	5,55 %	07.06.2021	10.661.181	0,40 %
KFW	10.000.000	0,38 %	15.12.2020	9.891.390	0,37 %
KFW	9.500.000	1,38 %	01.02.2021	9.665.832	0,36 %
FMS Wertmanagement AoeR	9.000.000	0,63 %	06.03.2020	8.986.698	0,34 %
E.ON International Finance BV	5.675.000	6,38 %	07.06.2032	8.063.335	0,30 %
KFW	5.400.000	6,00 %	07.12.2028	7.819.081	0,29 %
innogy Finance BV	4.850.000	6,13 %	06.07.2039	7.176.409	0,27 %
KFW	7.000.000	0,88 %	15.03.2022	6.987.288	0,26 %
E.ON International Finance BV	4.750.000	5,88 %	30.10.2037	6.811.500	0,26 %
FMS Wertmanagement AoeR	6.000.000	1,13 %	13.12.2019	6.053.436	0,23 %
FMS Wertmanagement AoeR	5.900.000	1,25 %	08.03.2019	5.946.315	0,22 %
innogy Finance BV	4.200.000	6,25 %	03.06.2030	5.748.381	0,22 %
KFW	3.865.000	5,50 %	18.06.2025	5.036.752	0,19 %
KFW	3.275.000	5,00 %	09.06.2036	4.949.730	0,19 %
E.ON International Finance BV	3.000.000	6,75 %	27.01.2039	4.713.330	0,18 %
Allianz Finance II BV	3.300.000	4,50 %	13.03.2043	4.562.600	0,17 %
innogy Finance BV	3.650.000	6,50 %	20.04.2021	4.257.878	0,16 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	3.300.000	3,75 %	10.09.2042	4.048.704	0,15 %
Daimler AG	4.000.000	1,00 %	20.12.2019	3.999.752	0,15 %
Deutsche Telekom International Finance BV	3.250.000	6,50 %	08.04.2022	3.931.532	0,15 %
E.ON International Finance BV	3.600.000	6,00 %	30.10.2019	3.922.358	0,15 %
Deutsche Bank AG	3.800.000	1,88 %	28.02.2020	3.826.885	0,14 %
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	3.600.000	1,13 %	17.05.2021	3.627.187	0,14 %
FMS Wertmanagement AoeR	3.600.000	0,88 %	14.05.2021	3.609.277	0,14 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	3.600.000	1,13 %	15.12.2023	3.597.725	0,14 %
innogy Finance BV	2.600.000	4,75 %	31.01.2034	3.203.460	0,12 %
Bayerische Landesbank	3.000.000	1,25 %	20.12.2021	3.009.222	0,11 %
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen^	2.500.000	6,63 %	26.05.2042	2.996.565	0,11 %
FMS Wertmanagement AoeR	3.000.000	0,88 %	14.02.2022	2.994.627	0,11 %
BMW Finance NV	2.700.000	0,88 %	16.08.2022	2.644.650	0,10 %
Volkswagen Financial Services NV	2.600.000	1,50 %	12.04.2021	2.611.232	0,10 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	2.200.000	3,13 %	24.07.2026	2.455.957	0,09 %
Deutsche Telekom International Finance BV	1.500.000	8,88 %	27.11.2028	2.417.978	0,09 %
innogy Finance BV	2.050.000	5,50 %	06.07.2022	2.402.899	0,09 %
BMW US Capital LLC	2.270.000	2,00 %	20.11.2019	2.311.995	0,09 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	2.200.000	1,38 %	15.12.2020	2.239.607	0,08 %
Volkswagen Financial Services NV	2.200.000	1,75 %	17.04.2020	2.226.585	0,08 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	2.200.000	1,00 %	04.12.2020	2.197.800	0,08 %
Deutsche Telekom International Finance BV	1.350.000	7,63 %	15.06.2030	2.074.470	0,08 %
KFW	2.000.000	1,63 %	05.06.2020	2.044.456	0,08 %
FMS Wertmanagement AoeR	2.000.000	1,13 %	07.09.2023	1.998.060	0,08 %
NRW Bank	2.000.000	1,00 %	15.06.2022	1.994.320	0,08 %
Deutsche Telekom International Finance BV	2.000.000	1,25 %	06.10.2023	1.969.340	0,07 %
Volkswagen Financial Services NV	1.900.000	2,63 %	22.07.2019	1.946.278	0,07 %
innogy Finance BV	1.600.000	5,63 %	06.12.2023	1.935.587	0,07 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	1.800.000	2,75 %	20.06.2022	1.925.032	0,07 %
Daimler International Finance BV	1.850.000	3,50 %	06.06.2019	1.915.379	0,07 %
KFW	1.265.000	4,88 %	15.03.2037	1.907.529	0,07 %
Daimler AG	1.800.000	2,13 %	07.06.2022	1.859.308	0,07 %
Henkel AG & Co. KGaA	1.789.000	0,88 %	13.09.2022	1.768.509	0,07 %
Volkswagen Financial Services NV	1.700.000	1,75 %	12.09.2022	1.711.152	0,06 %
BMW Finance NV	1.500.000	1,88 %	29.06.2020	1.530.435	0,06 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Deutsche Pfandbriefbank AG	1.500.000	1,88 %	20.12.2019	1.526.862	0,06 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	1.500.000	1,50 %	23.12.2019	1.524.702	0,06 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	1.400.000	2,75 %	10.09.2025	1.514.236	0,06 %
Volkswagen Financial Services NV	1.500.000	2,25 %	12.04.2025	1.510.995	0,06 %
BMW International Investment BV	1.500.000	1,00 %	17.11.2021	1.489.500	0,06 %
BASF SE	1.500.000	0,88 %	06.10.2023	1.464.165	0,06 %
Linde Finance BV	1.130.000	5,88 %	24.04.2023	1.390.171	0,05 %
Deutsche Bahn Finance BV	1.380.000	1,38 %	07.07.2025	1.366.987	0,05 %
Daimler AG	1.200.000	2,75 %	04.12.2020	1.255.601	0,05 %
BMW Finance NV	1.200.000	2,38 %	01.12.2021	1.253.132	0,05 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	1.200.000	1,13 %	12.05.2021	1.212.360	0,05 %
BASF SE	1.200.000	1,75 %	11.03.2025	1.205.988	0,05 %
Aroundtown SA	1.133.000	3,00 %	16.10.2029	1.137.385	0,04 %
Deutsche Telekom International Finance BV	1.000.000	7,38 %	04.12.2019	1.119.084	0,04 %
Daimler AG	1.000.000	2,38 %	16.12.2021	1.042.248	0,04 %
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	1.000.000	0,88 %	07.03.2022	994.340	0,04 %
Deutsche Telekom International Finance BV	1.000.000	2,25 %	13.04.2029	983.284	0,04 %
Erste Abwicklungsanstalt	900.000	1,00 %	07.03.2019	903.111	0,03 %
Volkswagen Financial Services NV	850.000	2,75 %	02.10.2020	884.117	0,03 %
Daimler AG	800.000	1,50 %	13.01.2022	805.766	0,03 %
Aareal Bank AG	500.000	1,00 %	04.06.2020	500.410	0,02 %
KFW	250.000	5,00 %	10.09.2024	311.209	0,01 %
				279.516.621	10,53 %
Guernsey 0,06 % (2016: 0,08 %)					
States of Guernsey Bond	1.500.000	3,38 %	12.12.2046	1.721.699	0,06 %
				1.721.699	0,06 %
Hongkong 0,06 % (2016: 0,05 %)					
Hutchison Whampoa Finance UK plc	1.300.000	5,63 %	24.11.2026	1.669.999	0,06 %
				1.669.999	0,06 %
Irland 0,39 % (2016: 0,41 %)					
NIE Finance plc	2.350.000	6,38 %	02.06.2026	3.123.037	0,12 %
Freshwater Finance plc	1.690.000	5,18 %	20.04.2035	2.262.476	0,08 %
Freshwater Finance plc	1.400.000	4,61 %	17.10.2036	1.778.842	0,07 %
Freshwater Finance plc	1.050.000	4,56 %	03.04.2036	1.321.260	0,05 %
Dali Capital plc	850.000	4,80 %	21.12.2037	1.093.565	0,04 %
ESB Finance DAC	655.000	6,50 %	05.03.2020	728.150	0,03 %
				10.307.330	0,39 %
Italien 1,42 % (2016: 1,51 %)					
Enel Finance International NV	6.180.000	5,75 %	14.09.2040	8.623.992	0,33 %
Republic of Italy Government International Bond	6.626.000	6,00 %	04.08.2028	8.274.943	0,31 %
Enel Finance International NV	4.225.000	5,63 %	14.08.2024	5.144.842	0,19 %
Enel SpA	3.600.000	6,25 %	20.06.2019	3.866.940	0,15 %
Enel SpA	2.750.000	5,75 %	22.06.2037	3.774.303	0,14 %
FCA Bank SpA	2.900.000	1,63 %	29.09.2021	2.895.789	0,11 %
Autostrade per l'Italia SpA	2.000.000	6,25 %	09.06.2022	2.400.260	0,09 %
Republic of Italy Government International Bond	1.800.000	5,25 %	07.12.2034	2.176.090	0,08 %
ENI Finance International SA	500.000	5,00 %	27.01.2019	520.500	0,02 %
				37.677.659	1,42 %
Japan 0,59 % (2016: 0,57 %)					
Toyota Motor Credit Corp.	2.800.000	1,00 %	27.09.2022	2.769.925	0,10 %
East Japan Railway Co.	1.650.000	4,75 %	08.12.2031	2.154.405	0,08 %
East Japan Railway Co.	1.550.000	4,50 %	25.01.2036	2.016.324	0,08 %
East Japan Railway Co.	1.450.000	4,88 %	14.06.2034	1.936.521	0,07 %
SMFG Preferred Capital GBP 2 Ltd.^	1.000.000	10,23 %	25.01.2166	1.603.740	0,06 %
Japan Bank for International Corp.	1.450.000	2,63 %	15.12.2020	1.516.287	0,06 %
American Honda Finance Corp.	1.500.000	1,30 %	21.03.2022	1.496.037	0,06 %
East Japan Railway Co.	800.000	5,25 %	22.04.2033	1.103.438	0,04 %
Toyota Motor Credit Corp.	1.000.000	1,13 %	07.09.2021	1.001.898	0,04 %
				15.598.575	0,59 %
Jersey 0,07 % (2016: 0,07 %)					
Jersey International Bond	1.400.000	3,75 %	09.06.2054	1.805.644	0,07 %
				1.805.644	0,07 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Mexiko 1,06 % (2016: 0,89 %)					
Mexico Government International Bond	4.599.000	5,63 %	19.03.2114	5.026.132	0,19 %
America Movil SAB de CV	3.750.000	4,38 %	07.08.2041	4.475.895	0,17 %
America Movil SAB de CV	3.275.000	5,75 %	28.06.2030	4.269.120	0,16 %
America Movil SAB de CV	3.300.000	5,00 %	27.10.2026	3.991.396	0,15 %
America Movil SAB de CV^	2.400.000	6,38 %	06.09.2073	2.657.683	0,10 %
Mexico Government International Bond	1.863.000	6,75 %	06.02.2024	2.301.970	0,09 %
Petroleos Mexicanos	2.200.000	3,75 %	16.11.2025	2.195.512	0,08 %
Petroleos Mexicanos	1.600.000	8,25 %	02.06.2022	1.984.000	0,08 %
America Movil SAB de CV	950.000	4,95 %	22.07.2033	1.184.878	0,04 %
				28.086.586	1,06 %
Niederlande 3,06 % (2016: 3,25 %)					
Cooperatieve Rabobank UA	7.050.000	4,63 %	23.05.2029	8.314.009	0,31 %
Koninklijke KPN NV	3.850.000	5,75 %	17.09.2029	4.929.317	0,18 %
ABN AMRO Bank NV	4.000.000	1,38 %	07.06.2022	4.014.816	0,15 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	3.425.000	5,38 %	07.06.2021	3.937.640	0,15 %
Cooperatieve Rabobank UA	2.750.000	5,25 %	14.09.2027	3.344.996	0,13 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	3.175.000	1,38 %	09.12.2019	3.214.878	0,12 %
Cooperatieve Rabobank UA	2.550.000	4,55 %	30.08.2029	3.177.856	0,12 %
ABN AMRO Bank NV	3.000.000	1,00 %	30.06.2020	2.994.018	0,11 %
Cooperatieve Rabobank UA	2.600.000	4,00 %	19.09.2022	2.902.507	0,11 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	2.800.000	1,00 %	09.12.2019	2.815.268	0,11 %
Aegon NV	1.700.000	6,63 %	16.12.2039	2.655.264	0,10 %
ING Bank NV	2.300.000	5,38 %	15.04.2021	2.611.425	0,10 %
Cooperatieve Rabobank UA	2.500.000	2,25 %	23.03.2022	2.596.870	0,10 %
Cooperatieve Rabobank UA	1.500.000	5,38 %	03.08.2060	2.592.525	0,10 %
Shell International Finance BV	2.500.000	2,00 %	20.12.2019	2.556.030	0,10 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	2.500.000	1,00 %	15.03.2022	2.497.150	0,09 %
UPP Bond 1 Issuer plc	1.867.174	4,90 %	28.02.2040	2.299.765	0,09 %
Koninklijke KPN NV	1.875.000	5,00 %	18.11.2026	2.228.158	0,08 %
Rabobank Capital Funding Trust IV^	1.950.000	5,56 %	31.12.2166	2.083.762	0,08 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	1.425.000	5,38 %	07.06.2032	2.034.729	0,08 %
ABN AMRO Bank NV	1.800.000	2,38 %	07.12.2021	1.881.139	0,07 %
Aegon NV	1.250.000	6,13 %	15.12.2031	1.735.650	0,06 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	1.200.000	5,20 %	07.12.2028	1.606.974	0,06 %
Cooperatieve Rabobank UA	1.100.000	5,25 %	23.05.2041	1.592.970	0,06 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	1.500.000	0,88 %	20.12.2021	1.491.660	0,06 %
Unilever plc	1.500.000	1,88 %	15.09.2029	1.459.185	0,05 %
Cooperatieve Rabobank UA	1.000.000	4,88 %	10.01.2023	1.160.744	0,04 %
Cooperatieve Rabobank UA	1.050.000	4,63 %	13.01.2021	1.158.872	0,04 %
Unilever plc	1.100.000	1,13 %	03.02.2022	1.099.483	0,04 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	1.000.000	1,13 %	24.05.2021	1.007.675	0,04 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	1.000.000	1,13 %	07.03.2019	1.005.572	0,04 %
Unilever plc	1.000.000	1,38 %	15.09.2024	988.580	0,04 %
ABN AMRO Bank NV	700.000	4,88 %	16.01.2019	728.567	0,03 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	580.000	5,75 %	18.01.2019	610.696	0,02 %
				81.328.750	3,06 %
Neuseeland 0,14 % (2016: 0,18 %)					
Fonterra Co.-operative Group Ltd.	779.000	9,38 %	04.12.2023	1.103.154	0,04 %
Chorus Ltd.	950.000	6,75 %	06.04.2020	1.058.631	0,04 %
ASB Finance Ltd.	1.000.000	1,00 %	07.09.2020	995.850	0,04 %
Westpac Securities NZ Ltd.	500.000	2,50 %	13.01.2021	519.410	0,02 %
				3.677.045	0,14 %
Norwegen 0,46 % (2016: 0,42 %)					
Statoil A.S.A	3.660.000	6,88 %	11.03.2031	5.504.750	0,21 %
Statoil A.S.A	1.500.000	6,13 %	27.11.2028	2.061.943	0,08 %
DNB Bank A.S.A	1.700.000	4,25 %	27.01.2020	1.812.758	0,07 %
Statoil A.S.A	1.350.000	4,25 %	10.04.2041	1.709.455	0,06 %
Kommunalbanken A.S.	1.000.000	0,88 %	08.12.2020	1.002.005	0,04 %
				12.090.911	0,46 %
Portugal 0,12 % (2016: 0,15 %)					
EDP Finance BV	2.400.000	8,63 %	04.01.2024	3.235.872	0,12 %
				3.235.872	0,12 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Singapur 0,18 % (2016: 0,17 %)					
Temasek Financial I Ltd.	1.900.000	5,13 %	26.07.2040	2.830.924	0,11 %
Temasek Financial I Ltd.	1.750.000	4,63 %	26.07.2022	2.013.365	0,07 %
				4.844.289	0,18 %
Südkorea 0,05 % (2016: 0,02 %)					
Koreanische Entwicklungsbank	1.300.000	1,75 %	15.12.2022	1.299.727	0,05 %
				1.299.727	0,05 %
Spanien 0,67 % (2016: 0,88 %)					
Telefonica Emisiones SAU	3.300.000	5,38 %	02.02.2026	3.978.361	0,15 %
Iberdrola Finanzas SA	2.650.000	6,00 %	01.07.2022	3.155.445	0,12 %
Telefonica Emisiones SAU	2.800.000	5,60 %	12.03.2020	3.062.214	0,12 %
Telefonica Emisiones SAU	2.550.000	5,29 %	09.12.2022	2.976.029	0,11 %
Telefonica Emisiones SAU	1.600.000	5,45 %	08.10.2029	2.012.082	0,08 %
Iberdrola Finanzas SA	1.250.000	7,38 %	29.01.2024	1.637.613	0,06 %
Spain Government International Bond	750.000	5,25 %	06.04.2029	891.145	0,03 %
				17.712.889	0,67 %
Supranational 7,50 % (2016: 8,37 %)					
Europäische Investitionsbank	25.350.000	1,50 %	01.02.2019	25.617.493	0,96 %
Europäische Investitionsbank	10.575.000	5,63 %	07.06.2032	15.726.040	0,59 %
Europäische Investitionsbank	9.435.000	6,00 %	07.12.2028	13.565.756	0,51 %
Europäische Investitionsbank	12.550.000	2,25 %	07.03.2020	12.979.436	0,49 %
Europäische Investitionsbank	10.400.000	2,50 %	31.10.2022	11.109.322	0,42 %
Europäische Investitionsbank	7.200.000	3,88 %	08.06.2037	9.463.378	0,36 %
Europäische Investitionsbank	6.350.000	4,50 %	07.06.2029	8.214.119	0,31 %
Europäische Investitionsbank	6.265.000	5,50 %	15.04.2025	8.095.558	0,30 %
Europäische Investitionsbank	5.125.000	5,00 %	15.04.2039	7.841.250	0,29 %
Europäische Investitionsbank	4.340.000	4,63 %	12.10.2054	7.375.049	0,28 %
Europäische Investitionsbank	6.175.000	5,38 %	07.06.2021	7.114.464	0,27 %
Europäische Investitionsbank	7.000.000	1,13 %	07.09.2021	7.059.668	0,27 %
Europäische Investitionsbank	7.000.000	0,63 %	17.01.2020	6.995.954	0,26 %
Europäische Investitionsbank	4.615.000	4,50 %	07.03.2044	6.933.318	0,26 %
Europäische Investitionsbank	5.550.000	4,25 %	07.12.2021	6.252.208	0,24 %
Europäische Investitionsbank	5.500.000	1,00 %	21.09.2026	5.332.140	0,20 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	3.280.000	5,63 %	07.12.2028	4.586.955	0,17 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	4.250.000	1,38 %	15.12.2020	4.326.570	0,16 %
Europäische Investitionsbank	3.300.000	3,75 %	07.12.2027	3.978.414	0,15 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	2.050.000	5,75 %	07.06.2032	3.106.276	0,12 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	3.000.000	0,63 %	15.12.2023	2.923.813	0,11 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	2.900.000	0,75 %	07.12.2021	2.884.067	0,11 %
Council Of Europe Development Bank	2.000.000	1,25 %	23.12.2019	2.021.684	0,08 %
Nordic Investment Bank	2.000.000	0,63 %	02.11.2021	1.982.010	0,07 %
Council Of Europe Development Bank	2.000.000	0,63 %	15.06.2022	1.968.754	0,07 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	1.500.000	5,40 %	07.06.2021	1.731.259	0,06 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	950.000	4,88 %	07.12.2028	1.266.349	0,05 %
Inter-American Development Bank	1.000.000	1,13 %	17.12.2019	1.009.439	0,04 %
Council Of Europe Development Bank	1.000.000	1,13 %	07.03.2019	1.006.066	0,04 %
Nordic Investment Bank	1.000.000	1,00 %	07.03.2019	1.004.972	0,04 %
African Development Bank	1.000.000	0,88 %	20.12.2021	997.412	0,04 %
Asian Development Bank	1.000.000	0,75 %	24.03.2022	992.997	0,04 %
Inter-American Development Bank	1.000.000	0,63 %	15.12.2021	989.583	0,04 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	1.000.000	0,38 %	15.06.2021	985.421	0,04 %
Europäische Investitionsbank	1.000.000	0,00 %	07.12.2028	834.467	0,03 %
Nordic Investment Bank	440.000	5,25 %	26.11.2019	477.950	0,02 %
Europäische Investitionsbank	200.000	5,38 %	07.03.2019	211.178	0,01 %
				198.960.789	7,50 %
Schweden 1,43 % (2016: 1,25 %)					
Vattenfall AB	4.675.000	6,88 %	15.04.2039	7.567.969	0,29 %
Nordea Bank AB	2.800.000	2,38 %	02.06.2022	2.935.514	0,11 %
Swedbank AB	2.700.000	1,25 %	29.12.2021	2.701.863	0,10 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	2.700.000	1,25 %	05.08.2022	2.685.485	0,10 %
Svensk Exportkredit AB	2.500.000	0,63 %	07.12.2020	2.485.115	0,09 %
Svenska Handelsbanken AB	2.363.000	4,00 %	18.01.2019	2.439.230	0,09 %
Nordea Bank AB	1.900.000	2,13 %	13.11.2019	1.942.697	0,07 %
Kommuninvest I Sverige AB	1.900.000	1,13 %	06.09.2019	1.913.053	0,07 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Investor AB	1.350.000	5,50 %	05.05.2037	1.901.410	0,07 %
Svenska Handelsbanken AB	1.600.000	3,00 %	20.11.2020	1.686.366	0,06 %
Svenska Handelsbanken AB	1.500.000	2,38 %	18.01.2022	1.566.705	0,06 %
Svenska Handelsbanken AB	1.450.000	2,75 %	05.12.2022	1.548.831	0,06 %
Swedbank Hypotek AB	1.500.000	1,13 %	07.12.2021	1.502.205	0,06 %
Akelius Residential Property AB	1.500.000	2,38 %	15.08.2025	1.476.872	0,06 %
Telia Co. AB	1.100.000	4,38 %	05.12.2042	1.334.696	0,05 %
Swedbank AB	1.100.000	1,63 %	15.04.2019	1.110.391	0,04 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	700.000	3,00 %	18.12.2020	738.850	0,03 %
Vattenfall AB	450.000	6,13 %	16.12.2019	493.517	0,02 %
				38.030.769	1,43 %
Schweiz 1,07 % (2016: 1,14 %)					
Glencore Canada Financial Corp.	4.025.000	7,38 %	27.05.2020	4.580.369	0,17 %
Nestle Holdings, Inc.	3.725.000	1,75 %	09.12.2020	3.816.806	0,14 %
Credit Suisse Group AG^	3.500.000	2,13 %	12.09.2025	3.473.684	0,13 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	2.700.000	2,75 %	08.08.2025	2.791.994	0,11 %
ELM BV for Swiss Reinsurance Co., Ltd.^	2.200.000	6,30 %	25.11.2166	2.338.600	0,09 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	2.200.000	3,00 %	27.05.2022	2.322.302	0,09 %
Zurich Finance UK plc^	1.900.000	6,63 %	02.10.2166	2.252.458	0,08 %
Glencore Finance Europe Ltd.	1.950.000	6,50 %	27.02.2019	2.068.478	0,08 %
Nestle Finance International Ltd.	1.750.000	2,25 %	30.11.2023	1.844.483	0,07 %
Glencore Finance Europe Ltd.	1.550.000	6,00 %	03.04.2022	1.793.880	0,07 %
LafargeHolcim Sterling Finance Netherlands BV	1.100.000	3,00 %	12.05.2032	1.090.319	0,04 %
				28.373.373	1,07 %
Vereinigtes Königreich 44,20 % (2016: 45,68 %)					
Barclays Bank plc	8.413.000	10,00 %	21.05.2021	10.557.339	0,40 %
United Kingdom Gilt	7.000.000	4,25 %	07.03.2036	9.839.095	0,37 %
Lloyds Bank plc	6.700.000	4,88 %	30.03.2027	8.479.051	0,32 %
United Kingdom Gilt	8.000.000	0,75 %	22.07.2023	7.947.120	0,30 %
Lloyds Bank plc	5.450.000	6,00 %	08.02.2029	7.676.172	0,29 %
Lloyds Bank plc	4.675.000	6,50 %	17.09.2040	7.493.483	0,28 %
Santander UK plc	6.550.000	5,13 %	14.04.2021	7.416.971	0,28 %
GlaxoSmithKline Capital plc	4.675.000	5,25 %	10.04.2042	6.800.722	0,26 %
Santander UK plc	5.150.000	5,75 %	02.03.2026	6.773.949	0,26 %
Imperial Brands Finance plc	5.200.000	9,00 %	17.02.2022	6.722.040	0,25 %
Heathrow Funding Ltd.	4.522.000	6,45 %	10.12.2031	6.501.822	0,25 %
Lloyds Bank plc	5.100.000	5,13 %	07.03.2025	6.344.522	0,24 %
Royal Bank of Scotland plc	5.150.000	5,13 %	13.01.2024	6.244.540	0,24 %
Aspire Defence Finance plc	4.904.342	4,67 %	31.03.2040	6.149.662	0,23 %
GlaxoSmithKline Capital plc	4.700.000	4,25 %	18.12.2045	6.120.208	0,23 %
United Kingdom Gilt	3.900.000	3,75 %	22.07.2052	6.004.067	0,23 %
Western Power Distribution West Midlands plc	4.390.000	5,75 %	16.04.2032	5.973.701	0,23 %
HSBC Holdings plc	5.800.000	2,63 %	16.08.2028	5.917.409	0,22 %
Barclays plc	5.664.000	3,25 %	12.02.2027	5.917.407	0,22 %
HSBC Holdings plc	3.850.000	7,00 %	07.04.2038	5.795.405	0,22 %
GlaxoSmithKline Capital plc	4.175.000	5,25 %	19.12.2033	5.751.305	0,22 %
Barclays Bank plc	4.950.000	4,25 %	12.01.2022	5.571.824	0,21 %
HSBC Holdings plc	3.750.000	6,00 %	29.03.2040	5.165.625	0,19 %
HSBC Holdings plc^	5.079.000	2,26 %	13.11.2026	5.095.039	0,19 %
Standard Chartered plc	4.500.000	5,13 %	06.06.2034	5.057.015	0,19 %
Centrica plc	3.350.000	7,00 %	19.09.2033	4.978.100	0,19 %
NGG Finance plc^	4.400.000	5,63 %	18.06.2073	4.973.056	0,19 %
BG Energy Capital plc	3.600.000	5,00 %	04.11.2036	4.865.969	0,18 %
Lloyds Bank plc	3.600.000	7,63 %	22.04.2025	4.824.248	0,18 %
HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 LP^	3.615.000	5,84 %	05.11.2166	4.759.711	0,18 %
Heathrow Funding Ltd.	3.225.000	5,88 %	13.05.2041	4.743.511	0,18 %
Heathrow Funding Ltd.	3.650.000	4,63 %	31.10.2046	4.736.711	0,18 %
Scottish Widows Ltd.	3.350.000	7,00 %	16.06.2043	4.648.939	0,18 %
Lloyds Banking Group plc	4.550.000	2,25 %	16.10.2024	4.594.717	0,17 %
THFC Funding No 3 plc	3.300.000	5,20 %	11.10.2043	4.557.161	0,17 %
Santander UK plc	3.350.000	5,25 %	16.02.2029	4.474.260	0,17 %
BAT International Finance plc	4.410.000	1,75 %	05.07.2021	4.472.578	0,17 %
Heathrow Funding Ltd.	3.250.000	6,75 %	03.12.2026	4.416.009	0,17 %
AA Bond Co., Ltd.	4.350.000	2,88 %	31.01.2022	4.381.886	0,17 %
Santander UK plc	4.300.000	1,88 %	17.02.2020	4.375.878	0,16 %
BG Energy Capital plc	3.470.000	5,13 %	01.12.2025	4.297.234	0,16 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Scottish Widows Ltd.	3.750.000	5,50 %	16.06.2023	4.285.894	0,16 %
High Speed Rail Finance 1 plc	3.400.000	4,38 %	01.11.2038	4.266.871	0,16 %
GlaxoSmithKline Capital plc	3.800.000	3,38 %	20.12.2027	4.252.808	0,16 %
Barclays plc	4.060.000	3,13 %	17.01.2024	4.244.011	0,16 %
Vodafone Group plc	4.800.000	3,00 %	12.08.2056	4.226.117	0,16 %
Centrica plc	3.500.000	6,38 %	10.03.2022	4.181.653	0,16 %
Clydesdale Bank plc	3.400.000	4,63 %	08.06.2026	4.177.560	0,16 %
Aviva plc^	3.450.000	6,13 %	14.11.2036	4.171.768	0,16 %
Land Securities Capital Markets plc^	3.355.000	5,39 %	31.03.2027	4.168.158	0,16 %
CTRL Section 1 Finance plc	3.258.515	5,23 %	02.05.2035	4.153.698	0,16 %
Standard Chartered plc	3.580.000	4,38 %	18.01.2038	4.138.516	0,16 %
Community Finance Co. 1 plc	3.036.000	5,02 %	31.07.2034	4.107.708	0,15 %
Nationwide Building Society	3.100.000	5,63 %	28.01.2026	4.070.064	0,15 %
Prudential plc^	3.300.000	5,70 %	19.12.2063	3.987.225	0,15 %
Juturna European Loan Conduit No 16 plc	3.242.967	5,06 %	10.08.2033	3.977.752	0,15 %
Lloyds Bank plc	3.800.000	1,75 %	31.03.2022	3.900.168	0,15 %
British Telecommunications plc	3.025.000	5,75 %	07.12.2028	3.882.140	0,15 %
Aviva plc^	3.360.000	6,13 %	29.09.2166	3.855.600	0,15 %
Chancellor Masters & Scholars of the University of Oxford	3.600.000	2,54 %	08.12.2117	3.827.592	0,14 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	2.950.000	4,63 %	04.06.2046	3.821.831	0,14 %
Bank of Scotland plc	3.050.000	9,38 %	15.05.2021	3.799.437	0,14 %
Heathrow Funding Ltd.	3.225.000	5,23 %	15.02.2023	3.777.949	0,14 %
Cadent Finance plc	3.900.000	2,75 %	22.09.2046	3.747.822	0,14 %
Investec Bank plc	3.000.000	9,63 %	17.02.2022	3.741.210	0,14 %
Cadent Finance plc	3.800.000	2,13 %	22.09.2028	3.709.142	0,14 %
Gatwick Funding Ltd.	2.892.000	6,13 %	02.03.2026	3.707.657	0,14 %
Aviva plc^	2.650.000	6,88 %	20.05.2058	3.659.772	0,14 %
BAT International Finance plc	2.800.000	7,25 %	12.03.2024	3.632.779	0,14 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	2.575.000	5,50 %	11.02.2041	3.630.168	0,14 %
United Utilities Water Ltd.	2.750.000	5,63 %	20.12.2027	3.625.132	0,14 %
Lloyds Bank plc	2.710.000	7,50 %	15.04.2024	3.622.376	0,14 %
Vodafone Group plc	3.800.000	3,38 %	08.08.2049	3.605.987	0,14 %
HSBC Bank plc	2.675.000	4,75 %	24.03.2046	3.540.930	0,13 %
Nationwide Building Society	3.400.000	2,25 %	29.04.2022	3.533.222	0,13 %
GlaxoSmithKline Capital plc	2.200.000	6,38 %	09.03.2039	3.518.658	0,13 %
Phoenix Group Holdings	3.300.000	4,13 %	20.07.2022	3.517.846	0,13 %
Society of Lloyd's	3.100.000	4,75 %	30.10.2024	3.517.700	0,13 %
Co.-Operative Bank plc	3.205.000	4,75 %	11.11.2021	3.509.994	0,13 %
Annington Funding plc	3.300.000	3,69 %	12.07.2034	3.467.317	0,13 %
Motability Operations Group plc	3.000.000	3,63 %	10.03.2036	3.466.707	0,13 %
Centrica plc	3.000.000	4,38 %	13.03.2029	3.465.570	0,13 %
SSE plc^	3.300.000	3,88 %	10.09.2166	3.427.875	0,13 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	1.600.000	7,74 %	09.04.2058	3.339.040	0,13 %
Mitchells & Butlers Finance plc	2.768.400	6,01 %	15.12.2028	3.308.196	0,12 %
Yorkshire Building Society	3.000.000	3,50 %	21.04.2026	3.287.130	0,12 %
BAT Capital Corp.	3.300.000	2,13 %	15.08.2025	3.284.721	0,12 %
Western Power Distribution East Midlands plc	2.810.000	5,25 %	17.01.2023	3.283.682	0,12 %
Southern Water Services Finance Ltd.	2.425.000	6,64 %	31.03.2026	3.259.733	0,12 %
THFC Funding No 2 plc	2.140.000	6,35 %	08.07.2039	3.256.894	0,12 %
Annington Funding plc	3.000.000	3,94 %	12.07.2047	3.250.470	0,12 %
Imperial Brands Finance plc	2.650.000	4,88 %	07.06.2032	3.217.482	0,12 %
Legal & General Group plc^	2.800.000	5,38 %	27.10.2045	3.191.524	0,12 %
Centrica plc	2.750.000	4,25 %	12.09.2044	3.185.270	0,12 %
BUPA Finance plc	2.729.000	5,00 %	08.12.2026	3.180.584	0,12 %
Places for People Homes Ltd.	3.080.000	3,63 %	22.11.2028	3.128.664	0,12 %
British Telecommunications plc	2.150.000	6,38 %	23.06.2037	3.108.883	0,12 %
BAT International Finance plc	2.750.000	4,00 %	04.09.2026	3.099.110	0,12 %
Severn Trent Utilities Finance plc	3.000.000	2,75 %	05.12.2031	3.087.342	0,12 %
Cadent Finance plc	3.196.000	2,63 %	22.09.2038	3.074.271	0,12 %
Annington Funding plc	3.000.000	2,65 %	12.07.2025	3.050.739	0,12 %
Meadowhall Finance plc	2.456.502	4,99 %	12.01.2032	3.046.888	0,11 %
Legal & General Finance plc	2.188.000	5,88 %	11.12.2031	3.037.487	0,11 %
Heathrow Funding Ltd.	2.400.000	7,13 %	14.02.2024	3.034.776	0,11 %
Barclays plc^	3.000.000	2,38 %	06.10.2023	3.033.462	0,11 %
Aspire Defence Finance plc	2.416.972	4,67 %	31.03.2040	3.030.695	0,11 %
HSBC Bank plc	2.297.000	5,38 %	22.08.2033	3.023.153	0,11 %
Wellcome Trust Ltd.	1.975.000	4,00 %	09.05.2059	3.022.741	0,11 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Sanctuary Capital plc	2.130.000	5,00 %	26.04.2047	3.015.675	0,11 %
AA Bond Co., Ltd.	2.500.000	6,27 %	31.07.2025	3.005.393	0,11 %
BAT International Finance plc	2.150.000	6,00 %	24.11.2034	3.002.927	0,11 %
Legal & General Group plc^	2.550.000	5,50 %	27.06.2064	2.964.847	0,11 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	3.000.000	1,88 %	24.01.2024	2.962.761	0,11 %
Thames Water Utilities Finance Ltd.	2.225.000	5,13 %	28.09.2037	2.955.022	0,11 %
Great Rolling Stock Co., Ltd.	2.267.346	6,88 %	27.07.2035	2.951.631	0,11 %
SSE plc	1.950.000	6,25 %	27.08.2038	2.941.825	0,11 %
Broadgate Financing plc	2.454.835	5,10 %	05.04.2033	2.918.573	0,11 %
Imperial Brands Finance plc	2.650.000	7,75 %	24.06.2019	2.904.710	0,11 %
Land Securities Capital Markets plc	2.850.000	1,97 %	08.02.2024	2.901.785	0,11 %
Eversholt Funding plc	2.150.000	6,70 %	22.02.2035	2.884.934	0,11 %
Intu SGS Finance plc	2.665.000	3,88 %	17.03.2023	2.873.131	0,11 %
UNITE USAF II plc	2.665.000	3,37 %	30.06.2023	2.865.706	0,11 %
Heathrow Funding Ltd.	2.600.000	6,00 %	20.03.2020	2.863.505	0,11 %
Wellcome Trust Finance plc	2.050.000	4,63 %	25.07.2036	2.853.379	0,11 %
BP Capital Markets plc	2.900.000	1,18 %	12.08.2023	2.842.052	0,11 %
Prudential plc^	2.500.000	5,00 %	20.07.2055	2.807.298	0,11 %
ABP Finance plc	2.200.000	6,25 %	14.12.2026	2.806.912	0,11 %
Canary Wharf Finance II plc	1.960.000	5,95 %	22.01.2035	2.806.320	0,11 %
HSBC Bank plc^	2.300.000	5,38 %	04.11.2030	2.805.386	0,11 %
South Eastern Power Networks plc	2.100.000	5,63 %	30.09.2030	2.803.580	0,11 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	2.485.000	4,00 %	19.06.2025	2.802.923	0,11 %
Nationwide Building Society	2.600.000	3,00 %	06.05.2026	2.801.942	0,11 %
Places For People Treasury plc	2.800.000	2,88 %	17.08.2026	2.762.992	0,10 %
Sky plc	2.630.000	2,88 %	24.11.2020	2.753.794	0,10 %
RAC Bond Co. plc	2.500.000	4,87 %	06.05.2026	2.750.773	0,10 %
RI Finance Bonds No 3 plc	2.300.000	6,13 %	13.11.2028	2.746.161	0,10 %
Aviva plc^	2.400.000	6,63 %	03.06.2041	2.743.855	0,10 %
HSBC Holdings plc	2.175.000	5,75 %	20.12.2027	2.732.983	0,10 %
Channel Link Enterprises Finance plc^	2.700.000	3,04 %	30.06.2050	2.725.642	0,10 %
BAT International Finance plc	3.300.000	2,25 %	09.09.2052	2.713.092	0,10 %
HSBC Bank plc	1.765.000	6,25 %	30.01.2041	2.706.578	0,10 %
Circle Anglia Social Housing plc	1.592.000	7,25 %	12.11.2038	2.695.840	0,10 %
Rolls-Royce plc	2.500.000	6,75 %	30.04.2019	2.690.850	0,10 %
Imperial Brands Finance plc	2.000.000	8,13 %	15.03.2024	2.681.920	0,10 %
Eastern Power Networks plc	1.775.000	6,25 %	12.11.2036	2.678.564	0,10 %
HSBC Holdings plc	2.000.000	6,75 %	11.09.2028	2.675.930	0,10 %
Motability Operations Group plc	2.675.000	2,38 %	14.03.2032	2.667.489	0,10 %
CPUK Finance Ltd.	2.600.000	2,67 %	28.02.2020	2.666.180	0,10 %
Manchester Airport Group Funding plc	2.100.000	4,75 %	31.03.2034	2.657.663	0,10 %
Derby Healthcare plc	1.964.400	5,56 %	30.06.2041	2.615.889	0,10 %
HSBC Holdings plc	2.050.000	6,50 %	20.05.2024	2.603.336	0,10 %
Cadent Finance plc	2.616.000	1,13 %	22.09.2021	2.599.687	0,10 %
Telereal Secured Finance plc	2.389.913	4,01 %	10.12.2031	2.581.230	0,10 %
Southern Water Services Finance Ltd.	2.300.000	5,00 %	31.03.2021	2.572.642	0,10 %
Northumbrian Water Finance plc	1.850.000	5,13 %	23.01.2042	2.565.543	0,10 %
Vodafone Group plc	1.950.000	5,90 %	26.11.2032	2.564.593	0,10 %
British Telecommunications plc	2.500.000	3,13 %	21.11.2031	2.558.643	0,10 %
Eastern Power Networks plc	2.250.000	4,75 %	30.09.2021	2.529.329	0,10 %
University of Cambridge	1.800.000	3,75 %	17.10.2052	2.520.925	0,10 %
Coventry Building Society	2.100.000	5,88 %	28.09.2022	2.507.828	0,09 %
Prudential plc	1.862.000	5,88 %	11.05.2029	2.504.193	0,09 %
Friends Life Holdings plc	1.950.000	8,25 %	21.04.2022	2.495.830	0,09 %
Southern Electric Power Distribution plc	1.850.000	5,50 %	07.06.2032	2.484.450	0,09 %
Nationwide Building Society	2.300.000	5,63 %	09.09.2019	2.479.011	0,09 %
Firstgroup plc	2.150.000	5,25 %	29.11.2022	2.472.328	0,09 %
GKN Holdings plc	2.150.000	5,38 %	19.09.2022	2.464.177	0,09 %
Aviva plc^	2.270.000	5,90 %	27.07.2166	2.460.680	0,09 %
HSBC Bank plc	2.000.000	6,50 %	07.07.2023	2.456.448	0,09 %
Santander UK Group Holdings plc	2.250.000	3,63 %	14.01.2026	2.455.524	0,09 %
Motability Operations Group plc	2.050.000	4,38 %	08.02.2027	2.451.890	0,09 %
Yorkshire Water Services Bradford Finance Ltd.	2.150.000	3,63 %	01.08.2029	2.450.183	0,09 %
Legal & General Group plc^	1.920.000	10,00 %	23.07.2041	2.447.733	0,09 %
Southern Gas Networks plc	1.550.000	6,38 %	15.05.2040	2.446.892	0,09 %
WM Morrison Supermarkets plc	2.150.000	4,63 %	08.12.2023	2.446.694	0,09 %
G4S plc	2.250.000	7,75 %	13.05.2019	2.443.752	0,09 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Firstgroup plc	2.000.000	8,75 %	08.04.2021	2.440.420	0,09 %
AA Bond Co., Ltd.	2.300.000	4,25 %	31.07.2020	2.427.245	0,09 %
Standard Life Aberdeen plc^	1.925.000	6,75 %	12.07.2166	2.421.457	0,09 %
SSE plc	1.550.000	8,38 %	20.11.2028	2.419.787	0,09 %
Nats En Route plc	2.078.700	5,25 %	31.03.2026	2.416.071	0,09 %
Southern Electric Power Distribution plc	1.900.000	4,63 %	20.02.2037	2.411.860	0,09 %
Electricity North West Ltd.	1.600.000	8,88 %	25.03.2026	2.408.467	0,09 %
TSB Banking Group plc^	2.167.000	5,75 %	06.05.2026	2.398.271	0,09 %
Standard Life Aberdeen plc^	2.100.000	5,50 %	04.12.2042	2.388.322	0,09 %
TP ICAP plc	2.244.000	5,25 %	26.01.2024	2.387.055	0,09 %
Bank of Scotland plc	1.950.000	4,88 %	20.12.2024	2.382.510	0,09 %
Imperial Brands Finance plc	1.900.000	5,50 %	28.09.2026	2.349.817	0,09 %
Western Power Distribution West Midlands plc	2.100.000	3,88 %	17.10.2024	2.345.507	0,09 %
Land Securities Capital Markets plc	2.300.000	2,63 %	22.09.2037	2.334.762	0,09 %
London & Quadrant Housing Trust Ltd.	1.850.000	4,63 %	05.12.2033	2.321.748	0,09 %
Experian Finance plc	2.150.000	3,50 %	15.10.2021	2.318.040	0,09 %
Sanctuary Capital plc	1.435.000	6,70 %	23.03.2039	2.310.116	0,09 %
London & Quadrant Housing Trust Ltd.	2.200.000	2,63 %	05.05.2026	2.288.440	0,09 %
EE Finance plc	2.200.000	4,38 %	28.03.2019	2.288.176	0,09 %
Broadgate Financing plc	1.850.000	5,00 %	05.10.2031	2.279.951	0,09 %
Northern Gas Networks Finance plc	1.850.000	4,88 %	30.06.2027	2.276.788	0,09 %
Martlet Homes Ltd.	2.300.000	3,00 %	09.05.2052	2.270.783	0,09 %
CPUK Finance Ltd.	1.778.000	7,24 %	28.02.2024	2.270.246	0,09 %
Southern Water Services Finance Ltd.	1.625.000	6,19 %	31.03.2029	2.260.342	0,09 %
Severn Trent Utilities Finance plc	2.040.000	3,63 %	16.01.2026	2.259.251	0,09 %
BAT International Finance plc	2.050.000	6,38 %	12.12.2019	2.256.144	0,09 %
Annington Funding plc	2.200.000	3,18 %	12.07.2029	2.255.260	0,09 %
Phoenix Group Holdings	1.880.000	6,63 %	18.12.2025	2.242.840	0,08 %
RSL Finance No 1 plc	1.588.798	6,63 %	31.03.2038	2.241.797	0,08 %
BP Capital Markets plc	2.200.000	2,03 %	14.02.2025	2.235.658	0,08 %
Prudential plc	1.770.000	6,88 %	20.01.2023	2.229.002	0,08 %
Aviva plc^	1.975.000	5,13 %	04.06.2050	2.224.352	0,08 %
RSA Insurance Group plc^	1.950.000	5,13 %	10.10.2045	2.221.961	0,08 %
Dignity Finance plc	1.968.318	3,55 %	31.12.2034	2.211.767	0,08 %
Dignity Finance plc	1.754.000	4,70 %	31.12.2049	2.209.423	0,08 %
Kennedy Wilson Europe Real Estate plc	2.100.000	3,95 %	30.06.2022	2.206.512	0,08 %
Intu Metrocentre Finance plc	2.000.000	4,13 %	06.12.2023	2.204.400	0,08 %
Porterbrook Rail Finance Ltd.	1.620.000	7,13 %	20.10.2026	2.199.544	0,08 %
Land Securities Capital Markets plc	2.108.000	2,75 %	22.09.2057	2.191.388	0,08 %
Wessex Water Services Finance plc	1.530.000	5,75 %	14.10.2033	2.179.699	0,08 %
Great Rolling Stock Co., Ltd.	1.683.500	6,50 %	05.04.2031	2.176.252	0,08 %
Eversholt Funding plc	2.150.000	3,53 %	07.08.2042	2.171.866	0,08 %
Wales & West Utilities Finance plc	1.823.000	6,25 %	30.11.2021	2.164.692	0,08 %
Notting Hill Housing Trust	2.100.000	3,25 %	12.10.2048	2.162.735	0,08 %
Arqiva Financing plc	1.900.000	4,88 %	31.12.2032	2.160.699	0,08 %
South Eastern Power Networks plc	1.487.000	6,38 %	12.11.2031	2.153.131	0,08 %
AstraZeneca plc	1.550.000	5,75 %	13.11.2031	2.141.241	0,08 %
Prudential plc	1.625.000	6,13 %	19.12.2031	2.140.125	0,08 %
Hammerson plc	2.000.000	3,50 %	27.10.2025	2.128.702	0,08 %
Affinity Sutton Capital Markets plc	1.700.000	4,25 %	08.10.2042	2.128.604	0,08 %
Northern Powergrid Holdings Co.	1.680.000	7,25 %	15.12.2022	2.123.564	0,08 %
SP Distribution plc	1.650.000	5,88 %	17.07.2026	2.116.014	0,08 %
Northumbrian Water Finance plc	2.200.000	1,63 %	11.10.2026	2.114.957	0,08 %
Anglian Water Services Financing plc	1.850.000	4,50 %	22.02.2026	2.110.325	0,08 %
Coventry Building Society	2.100.000	1,88 %	24.10.2023	2.097.535	0,08 %
Manchester Airport Group Funding plc	1.850.000	4,13 %	02.04.2024	2.089.949	0,08 %
Rolls-Royce plc	1.900.000	3,38 %	18.06.2026	2.087.336	0,08 %
Heathrow Funding Ltd.	2.200.000	2,75 %	09.08.2049	2.080.489	0,08 %
FCE Bank plc	2.000.000	2,73 %	03.06.2022	2.076.360	0,08 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	1.900.000	3,50 %	25.02.2028	2.071.912	0,08 %
CRH Finance UK plc	1.800.000	4,13 %	02.12.2029	2.071.330	0,08 %
Stagecoach Group plc	1.900.000	4,00 %	29.09.2025	2.062.298	0,08 %
A2Dominion Housing Group Ltd.	2.000.000	3,50 %	15.11.2028	2.055.786	0,08 %
Yorkshire Water Services Bradford Finance Ltd.	1.300.000	6,38 %	19.08.2039	2.050.455	0,08 %
Gatwick Funding Ltd.	1.455.000	5,75 %	23.01.2037	2.047.734	0,08 %
Intu SGS Finance plc	1.750.000	4,63 %	17.03.2028	2.044.439	0,08 %
Marks & Spencer plc	1.967.000	3,00 %	08.12.2023	2.037.344	0,08 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Western Power Distribution West Midlands plc	1.600.000	6,00 %	09.05.2025	2.036.445	0,08 %
Gatwick Funding Ltd	2.000.000	3,13 %	28.09.2039	2.033.440	0,08 %
Liberty Living Finance plc	2.000.000	2,63 %	28.11.2024	2.027.906	0,08 %
National Express Group plc	2.000.000	2,50 %	11.11.2023	2.027.508	0,08 %
SP Manweb plc	1.650.000	4,88 %	20.09.2027	2.027.355	0,08 %
Arqiva Financing plc	1.925.000	4,04 %	30.06.2020	2.027.298	0,08 %
Marks & Spencer plc	1.800.000	4,75 %	12.06.2025	2.021.368	0,08 %
Manchester Airport Group Funding plc	2.000.000	2,88 %	31.03.2039	2.006.448	0,08 %
Segro plc	2.000.000	2,38 %	11.10.2029	2.001.592	0,08 %
BAE Systems plc	1.800.000	4,13 %	08.06.2022	2.000.821	0,08 %
Principality Building Society	2.000.000	2,38 %	23.11.2023	2.000.612	0,08 %
THFC Funding No 1 plc	1.522.000	5,13 %	21.12.2035	1.991.000	0,08 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	2.000.000	2,38 %	03.05.2023	1.990.836	0,08 %
Severn Trent Utilities Finance plc	2.000.000	1,13 %	07.09.2021	1.985.816	0,07 %
Greene King Finance plc	1.650.000	5,11 %	15.03.2034	1.978.838	0,07 %
Liverpool Victoria Friendly Society Ltd.^	1.750.000	6,50 %	22.05.2043	1.976.751	0,07 %
University of Manchester	1.350.000	4,25 %	04.07.2053	1.974.656	0,07 %
Lloyds Bank plc^	1.800.000	5,75 %	09.07.2025	1.971.776	0,07 %
Northumbrian Water Finance plc	1.425.000	5,63 %	29.04.2033	1.965.762	0,07 %
InterContinental Hotels Group plc	1.800.000	3,75 %	14.08.2025	1.964.713	0,07 %
Equity Release Funding No 3 plc	1.574.000	5,05 %	26.04.2033	1.960.319	0,07 %
British Land Co. plc	2.000.000	2,38 %	14.09.2029	1.959.032	0,07 %
Peabody Capital No 2 plc	1.400.000	4,63 %	12.12.2053	1.951.194	0,07 %
Southern Water Services Finance Ltd.	1.200.000	5,13 %	30.09.2056	1.942.103	0,07 %
3i Group plc	1.500.000	5,75 %	03.12.2032	1.937.439	0,07 %
BUPA Finance plc	1.700.000	5,00 %	25.04.2023	1.937.033	0,07 %
London Power Networks plc	1.650.000	5,13 %	31.03.2023	1.930.180	0,07 %
Anglian Water Services Financing plc	1.600.000	4,50 %	05.10.2027	1.928.736	0,07 %
InterContinental Hotels Group plc	2.000.000	2,13 %	24.08.2026	1.928.284	0,07 %
Western Power Distribution East Midlands plc	1.250.000	6,25 %	10.12.2040	1.925.528	0,07 %
BAT International Finance plc	1.600.000	4,00 %	23.11.2055	1.907.950	0,07 %
Marks & Spencer plc	1.750.000	6,13 %	02.12.2019	1.907.461	0,07 %
3i Group plc	1.552.000	6,88 %	09.03.2023	1.897.318	0,07 %
Artesian Finance II plc	1.300.000	6,00 %	30.09.2033	1.884.050	0,07 %
Longstone Finance plc	1.650.000	4,90 %	19.04.2031	1.874.532	0,07 %
ENW Finance plc	1.610.000	6,13 %	21.07.2021	1.873.705	0,07 %
Telereal Securitisation plc	1.509.922	5,95 %	10.12.2031	1.872.699	0,07 %
Eversholt Funding plc	1.450.000	6,36 %	02.12.2025	1.854.556	0,07 %
Notting Hill Housing Trust	1.350.000	5,25 %	07.07.2042	1.849.206	0,07 %
Standard Life Aberdeen plc^	1.690.000	6,55 %	06.01.2167	1.846.916	0,07 %
White City Property Finance plc	1.468.572	5,12 %	17.04.2035	1.839.777	0,07 %
Scotland Gas Networks plc	1.700.000	3,25 %	08.03.2027	1.832.134	0,07 %
Motability Operations Group plc	1.640.000	6,63 %	10.12.2019	1.820.695	0,07 %
Intu SGS Finance plc	1.590.000	4,25 %	17.09.2030	1.820.114	0,07 %
Next plc	1.600.000	5,38 %	26.10.2021	1.816.285	0,07 %
Skipton Building Society	1.818.000	1,75 %	30.06.2022	1.811.733	0,07 %
Wheatley Group Capital plc	1.500.000	4,38 %	28.11.2044	1.810.920	0,07 %
Segro plc	1.800.000	2,88 %	11.10.2037	1.806.593	0,07 %
Notting Hill Housing Trust	1.400.000	4,38 %	20.02.2054	1.804.614	0,07 %
Nestle Holdings, Inc.	1.800.000	1,00 %	11.06.2021	1.803.834	0,07 %
Centrica plc^	1.700.000	5,25 %	10.04.2075	1.799.858	0,07 %
Dwr Cymru Financing Ltd.	1.498.000	6,91 %	31.03.2021	1.776.242	0,07 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	1.475.000	4,38 %	03.07.2034	1.762.215	0,07 %
South Eastern Power Networks plc	1.401.000	5,50 %	05.06.2026	1.757.246	0,07 %
Sunderland SHG Finance plc	1.230.000	6,38 %	31.03.2042	1.741.505	0,07 %
Hammerson plc	1.400.000	6,00 %	23.02.2026	1.739.466	0,07 %
Western Power Distribution South West plc	1.200.000	5,75 %	23.03.2040	1.737.653	0,07 %
Lloyds Bank plc	1.700.000	2,75 %	09.12.2018	1.731.365	0,07 %
Aviva plc^	1.600.000	4,38 %	12.09.2049	1.717.330	0,06 %
Yorkshire Water Services Finance Ltd.	1.200.000	5,50 %	28.05.2037	1.711.968	0,06 %
Vodafone Group plc	1.375.000	5,63 %	04.12.2025	1.708.891	0,06 %
BUPA Finance plc	1.600.000	3,38 %	17.06.2021	1.705.405	0,06 %
Circle Anglia Social Housing plc	1.200.000	5,20 %	02.03.2044	1.700.148	0,06 %
Swan Housing Capital plc	1.563.000	3,63 %	05.03.2048	1.698.003	0,06 %
Peabody Capital plc	1.200.000	5,25 %	17.03.2043	1.691.052	0,06 %
British Telecommunications plc	1.450.000	8,63 %	26.03.2020	1.686.947	0,06 %
Whitbread Group plc	1.600.000	3,38 %	16.10.2025	1.686.413	0,06 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Santander UK plc	1.450.000	3,88 %	15.10.2029	1.686.182	0,06 %
Severn Trent Utilities Finance plc	1.250.000	4,88 %	24.01.2042	1.679.046	0,06 %
Yorkshire Power Finance Ltd.	1.150.000	7,25 %	04.08.2028	1.667.649	0,06 %
Genfinance II plc	1.145.000	6,06 %	21.12.2039	1.666.324	0,06 %
Broadgate Financing plc	1.250.000	4,82 %	05.07.2033	1.656.590	0,06 %
United Utilities Water Ltd.	1.400.000	5,75 %	25.03.2022	1.653.904	0,06 %
Gatwick Funding Ltd.	1.800.000	2,63 %	07.10.2046	1.652.863	0,06 %
Babcock International Group plc	1.700.000	1,88 %	05.10.2026	1.642.438	0,06 %
Aviva plc^	1.500.000	6,88 %	21.05.2166	1.636.155	0,06 %
Sky plc	1.250.000	6,00 %	21.05.2027	1.632.937	0,06 %
Libra Longhurst Group Treasury plc	1.249.000	5,13 %	02.08.2038	1.632.166	0,06 %
Southern Gas Networks plc	1.300.000	4,88 %	21.03.2029	1.630.044	0,06 %
Wales & West Utilities Finance plc	1.200.000	5,75 %	29.03.2030	1.629.012	0,06 %
Haven Funding plc	1.036.075	8,13 %	30.09.2037	1.628.609	0,06 %
Gwynt y Mor OFTO plc	1.553.804	2,78 %	17.02.2034	1.624.096	0,06 %
Western Power Distribution plc	1.500.000	3,63 %	06.11.2023	1.618.047	0,06 %
Severn Trent Utilities Finance plc	1.300.000	6,13 %	26.02.2024	1.617.021	0,06 %
Affinity Water Programme Finance Ltd.	1.250.000	4,50 %	31.03.2036	1.607.413	0,06 %
Anglian Water Services Financing plc	1.125.000	6,29 %	30.07.2030	1.599.502	0,06 %
Great Places Housing Group Ltd.	1.235.000	4,75 %	22.10.2042	1.594.262	0,06 %
Southern Gas Networks plc	1.350.000	4,88 %	05.10.2023	1.577.058	0,06 %
Coventry Building Society	1.450.000	6,00 %	16.10.2019	1.576.933	0,06 %
National Grid Electricity Transmission plc	1.350.000	4,00 %	08.06.2027	1.575.488	0,06 %
GKN Holdings plc	1.600.000	3,38 %	12.05.2032	1.574.246	0,06 %
Compass Group plc	1.600.000	2,00 %	03.07.2029	1.573.918	0,06 %
Global Switch Holdings Ltd.	1.400.000	4,38 %	13.12.2022	1.567.160	0,06 %
Nationwide Building Society	1.440.000	3,25 %	20.01.2028	1.565.669	0,06 %
WM Morrison Supermarkets plc	1.450.000	3,50 %	27.07.2026	1.564.821	0,06 %
Wessex Water Services Finance plc	1.400.000	4,00 %	24.09.2021	1.538.163	0,06 %
Together Housing Finance plc	1.230.000	4,50 %	17.12.2042	1.534.767	0,06 %
Hyde Housing Association Ltd.	1.150.000	5,13 %	23.07.2040	1.534.291	0,06 %
Porterbrook Rail Finance Ltd.	1.300.000	4,63 %	04.04.2029	1.533.204	0,06 %
WM Morrison Supermarkets plc	1.300.000	4,75 %	04.07.2029	1.528.758	0,06 %
HSBC Bank Capital Funding Sterling 2 LP^	1.405.000	5,86 %	07.04.2166	1.517.691	0,06 %
Cardiff University	1.300.000	3,00 %	07.12.2055	1.517.230	0,06 %
Northumbrian Water Finance plc	1.500.000	2,38 %	05.10.2027	1.511.685	0,06 %
Sky plc	1.300.000	4,00 %	26.11.2029	1.508.216	0,06 %
Aster Treasury plc	1.160.000	4,50 %	18.12.2043	1.503.348	0,06 %
Telereal Securitisation plc	1.224.032	6,16 %	10.12.2031	1.501.628	0,06 %
EMH Treasury plc	1.200.000	4,50 %	29.01.2044	1.500.622	0,06 %
Heathrow Funding Ltd.	1.200.000	9,20 %	29.03.2021	1.493.968	0,06 %
Bazalgette Finance plc	1.500.000	2,38 %	29.11.2027	1.493.189	0,06 %
Admiral Group plc	1.300.000	5,50 %	25.07.2024	1.486.105	0,06 %
AA Bond Co., Ltd.	1.500.000	2,75 %	31.07.2023	1.485.861	0,06 %
Segro plc	1.050.000	5,75 %	20.06.2035	1.485.275	0,06 %
London & Quadrant Housing Trust Ltd.	1.500.000	2,25 %	20.07.2029	1.480.404	0,06 %
WPP Finance 2013	1.700.000	2,88 %	14.09.2046	1.478.823	0,06 %
London & Quadrant Housing Trust Ltd.	1.500.000	2,75 %	20.07.2057	1.477.094	0,06 %
Barclays Bank plc	1.200.000	5,75 %	14.09.2026	1.468.300	0,06 %
Northern Gas Networks Finance plc	1.108.000	4,88 %	15.11.2035	1.456.987	0,05 %
University of Southampton	1.500.000	2,25 %	11.04.2057	1.456.848	0,05 %
Wessex Water Services Finance plc	1.130.000	5,38 %	10.03.2028	1.455.521	0,05 %
Southern Gas Networks plc	1.400.000	2,50 %	03.02.2025	1.449.862	0,05 %
Coventry Building Society	1.450.000	1,00 %	05.05.2020	1.446.724	0,05 %
Next plc	1.300.000	4,38 %	02.10.2026	1.443.182	0,05 %
SSE plc	1.200.000	5,88 %	22.09.2022	1.440.742	0,05 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.^	1.250.000	5,75 %	13.09.2030	1.435.015	0,05 %
Wellcome Trust Finance plc	1.267.000	4,75 %	28.05.2021	1.428.051	0,05 %
Northern Gas Networks Finance plc	1.325.000	5,88 %	08.07.2019	1.421.394	0,05 %
BAT International Finance plc	1.000.000	5,75 %	05.07.2040	1.419.048	0,05 %
Daily Mail & General Trust plc	1.200.000	6,38 %	21.06.2027	1.414.555	0,05 %
National Express Group plc	1.250.000	6,63 %	17.06.2020	1.405.189	0,05 %
Dwr Cymru Financing Ltd.	1.025.000	6,02 %	31.03.2028	1.396.931	0,05 %
HSBC Holdings plc	1.100.000	6,50 %	20.05.2024	1.396.912	0,05 %
Severn Trent Utilities Finance plc	1.000.000	6,25 %	07.06.2029	1.388.280	0,05 %
Channel Link Enterprises Finance plc	1.265.000	3,85 %	30.06.2050	1.385.054	0,05 %
University of Liverpool	1.100.000	3,38 %	25.06.2055	1.384.515	0,05 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
WHG Treasury plc	1.150.000	4,25 %	06.10.2045	1.383.342	0,05 %
RL Finance Bonds No 2 plc^	1.200.000	6,13 %	30.11.2043	1.380.974	0,05 %
Yorkshire Water Services Bradford Finance Ltd.^	1.300.000	3,75 %	22.03.2046	1.378.247	0,05 %
Motability Operations Group plc	1.200.000	3,75 %	16.07.2026	1.377.130	0,05 %
Prudential plc^	1.200.000	11,38 %	29.05.2039	1.365.444	0,05 %
Gatwick Funding Ltd.	1.150.000	5,25 %	23.01.2024	1.356.496	0,05 %
Close Brothers Finance plc	1.250.000	3,88 %	27.06.2021	1.348.825	0,05 %
Next plc	1.300.000	3,63 %	18.05.2028	1.348.482	0,05 %
SSE plc^	1.300.000	3,63 %	16.09.2077	1.342.679	0,05 %
Bank of Scotland plc	1.240.000	6,38 %	16.08.2019	1.338.084	0,05 %
RELX Investments plc	1.300.000	2,75 %	01.08.2019	1.327.872	0,05 %
BPHA Finance plc	1.000.000	4,82 %	11.04.2044	1.315.888	0,05 %
Barclays Bank plc	1.050.000	9,50 %	07.08.2021	1.309.856	0,05 %
Centrica plc	1.000.000	6,40 %	04.09.2026	1.299.374	0,05 %
Investec plc	1.200.000	4,50 %	05.05.2022	1.297.672	0,05 %
Orbit Capital plc	1.200.000	3,50 %	24.03.2045	1.291.865	0,05 %
BUPA Finance plc	1.280.000	2,00 %	05.04.2024	1.290.688	0,05 %
CYBG plc^	1.250.000	3,13 %	22.06.2025	1.288.943	0,05 %
Gatwick Funding Ltd.	1.050.000	4,63 %	27.03.2034	1.285.117	0,05 %
Penarian Housing Finance plc	1.280.000	3,21 %	07.06.2052	1.280.410	0,05 %
Riverside Finance plc	1.100.000	3,88 %	05.12.2044	1.276.290	0,05 %
Marks & Spencer plc	1.100.000	6,13 %	06.12.2021	1.276.059	0,05 %
Saxon Weald Capital plc	950.000	5,38 %	06.06.2042	1.274.425	0,05 %
University of Leeds	1.100.000	3,13 %	19.12.2050	1.272.594	0,05 %
Marston's Issuer plc^	1.121.000	5,18 %	15.07.2032	1.264.995	0,05 %
Hammerson plc	900.000	7,25 %	21.04.2028	1.252.186	0,05 %
GB Social Housing plc	1.000.000	5,19 %	12.02.2038	1.244.926	0,05 %
Land Securities Capital Markets plc	1.200.000	2,40 %	08.02.2029	1.236.614	0,05 %
Leeds Building Society	1.100.000	4,88 %	16.11.2020	1.225.380	0,05 %
Southern Water Services Finance Ltd.	1.150.000	6,13 %	31.03.2019	1.221.612	0,05 %
Sovereign Housing Capital plc	900.000	4,77 %	01.06.2043	1.200.898	0,05 %
Canary Wharf Finance II plc	935.948	6,46 %	22.04.2030	1.199.318	0,05 %
DS Smith plc	1.200.000	2,88 %	26.07.2029	1.193.417	0,05 %
Greene King Finance plc	997.248	5,32 %	15.09.2031	1.191.484	0,04 %
RAC Bond Co. plc	1.100.000	4,57 %	06.05.2023	1.188.213	0,04 %
Yorkshire Housing Finance plc	1.000.000	4,13 %	31.10.2044	1.185.887	0,04 %
London & Quadrant Housing Trust Ltd.	1.000.000	3,75 %	27.10.2049	1.174.302	0,04 %
Scotland Gas Networks plc	900.000	4,88 %	21.12.2034	1.167.084	0,04 %
Hiscox Ltd.^	1.000.000	6,13 %	24.11.2045	1.161.000	0,04 %
Student Finance plc	1.150.000	2,67 %	30.09.2024	1.155.313	0,04 %
Notting Hill Housing Trust	1.035.000	3,75 %	20.12.2032	1.153.683	0,04 %
FCE Bank plc	1.100.000	3,25 %	19.11.2020	1.152.780	0,04 %
Greene King Finance plc	1.032.596	4,06 %	15.03.2035	1.143.678	0,04 %
InterContinental Hotels Group plc	1.035.000	3,88 %	28.11.2022	1.136.931	0,04 %
Gatwick Funding Ltd.	700.000	6,50 %	02.03.2041	1.100.135	0,04 %
Motability Operations Group plc	800.000	5,63 %	29.11.2030	1.098.537	0,04 %
Equity Release Funding No 2 plc	884.011	5,88 %	26.05.2032	1.097.984	0,04 %
Direct Line Insurance Group plc^	846.000	9,25 %	27.04.2042	1.095.983	0,04 %
Metropolitan Funding plc	900.000	4,13 %	05.04.2048	1.086.962	0,04 %
Lloyds Bank plc	800.000	9,63 %	06.04.2023	1.085.738	0,04 %
Harbour Funding plc	824.000	5,28 %	31.03.2034	1.074.010	0,04 %
Eversholt Funding plc	950.000	5,83 %	02.12.2020	1.069.704	0,04 %
East Finance plc	750.000	5,49 %	15.06.2042	1.065.735	0,04 %
Porterbrook Rail Finance Ltd.	1.000.000	5,50 %	20.04.2019	1.054.198	0,04 %
Mitchells & Butlers Finance plc	850.000	6,47 %	15.09.2030	1.051.384	0,04 %
Anglian Water Services Financing plc	875.000	5,84 %	30.07.2022	1.048.427	0,04 %
Close Brothers Finance plc	1.000.000	2,75 %	19.10.2026	1.041.638	0,04 %
Housing & Care 21	1.000.000	3,29 %	08.11.2049	1.040.562	0,04 %
Longstone Finance plc	894.667	4,79 %	19.04.2030	1.039.593	0,04 %
Compass Group plc	900.000	3,85 %	26.06.2026	1.035.999	0,04 %
Eastern Power Networks plc	850.000	5,75 %	08.03.2024	1.034.781	0,04 %
Southern Gas Networks plc	934.000	4,88 %	21.12.2020	1.033.275	0,04 %
FCE Bank plc	1.000.000	2,76 %	13.11.2019	1.028.810	0,04 %
British Telecommunications plc	1.000.000	3,63 %	21.11.2047	1.024.230	0,04 %
WM Treasury 2 plc	1.000.000	3,25 %	20.10.2048	1.023.278	0,04 %
Firstgroup plc	800.000	6,88 %	18.09.2024	1.017.536	0,04 %
Virgin Money plc	1.000.000	2,25 %	21.04.2020	1.017.409	0,04 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Yorkshire Building Society^	1.000.000	3,38 %	13.09.2028	1.014.600	0,04 %
Affinity Water Finance 2004 plc	775.000	5,88 %	13.07.2026	1.008.035	0,04 %
Severn Trent Utilities Finance plc	1.000.000	1,63 %	04.12.2022	1.003.004	0,04 %
Firstgroup plc	950.000	6,13 %	18.01.2019	997.642	0,04 %
Legal & General Group plc^	950.000	5,88 %	01.10.2166	997.421	0,04 %
Go-Ahead Group plc	1.000.000	2,50 %	06.07.2024	996.853	0,04 %
Wales & West Utilities Finance plc	850.000	4,63 %	13.12.2023	991.372	0,04 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	1.000.000	2,88 %	03.05.2027	991.190	0,04 %
BUFA Finance plc^	900.000	6,13 %	16.09.2166	989.856	0,04 %
Anglian Water Services Financing plc	1.000.000	2,63 %	15.06.2027	989.554	0,04 %
Telereal Securitisation plc	821.837	5,39 %	10.12.2031	989.084	0,04 %
Paragon Treasury plc	897.000	3,63 %	21.01.2047	986.840	0,04 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.	1.000.000	2,63 %	24.01.2032	985.252	0,04 %
Anglian Water Services Financing plc	1.000.000	1,63 %	10.08.2025	985.234	0,04 %
Thames Water Utilities Finance Ltd.	700.000	6,75 %	16.11.2028	981.596	0,04 %
Great Rolling Stock Co., Ltd.	876.000	6,25 %	27.07.2020	980.723	0,04 %
Highbury Finance BV	815.079	7,02 %	20.03.2023	956.903	0,04 %
Northern Gas Networks Finance plc	650.000	5,63 %	23.03.2040	952.011	0,04 %
Western Power Distribution South Wales plc	650.000	5,75 %	23.03.2040	941.229	0,04 %
Tritax Big Box plc	925.000	3,13 %	14.12.2031	937.606	0,04 %
Trafford Centre Finance Ltd.	684.005	6,50 %	28.07.2033	934.345	0,04 %
Southern Water Services Finance Ltd.^	850.000	4,50 %	31.03.2038	929.540	0,04 %
Anglian Water Services Financing plc	641.000	6,63 %	15.01.2029	913.419	0,03 %
Standard Chartered Bank^	829.000	5,38 %	14.07.2166	882.252	0,03 %
Octagon Healthcare Funding plc	687.824	5,33 %	31.12.2035	862.718	0,03 %
WPP Finance SA	750.000	6,38 %	06.11.2020	856.291	0,03 %
Fidelity International Ltd.	750.000	6,75 %	19.10.2020	849.735	0,03 %
Marston's Issuer plc^	850.000	5,16 %	15.10.2027	847.062	0,03 %
Society of Lloyd's^	750.000	4,88 %	07.02.2047	845.085	0,03 %
Integrated Accommodation Services plc	666.129	6,48 %	31.03.2029	838.543	0,03 %
Northern Powergrid Yorkshire plc	620.000	5,13 %	04.05.2035	837.947	0,03 %
Mitchells & Butlers Finance plc	714.814	5,57 %	15.12.2030	836.320	0,03 %
Yorkshire Building Society^	800.000	4,13 %	20.11.2024	835.486	0,03 %
SSE plc	750.000	4,25 %	14.09.2021	831.177	0,03 %
Affinity Sutton Capital Markets plc	550.000	5,98 %	17.09.2038	827.244	0,03 %
Wods Transmission plc	747.029	3,45 %	24.08.2034	823.651	0,03 %
Scottish Power UK plc	650.000	6,75 %	29.05.2023	812.850	0,03 %
Yorkshire Water Services Odsal Finance Ltd.	550.000	6,60 %	17.04.2031	809.582	0,03 %
Western Power Distribution South West plc	600.000	5,88 %	25.03.2027	776.526	0,03 %
Tate & Lyle International Finance plc	700.000	6,75 %	25.11.2019	773.153	0,03 %
Motability Operations Group plc	650.000	5,38 %	28.06.2022	768.304	0,03 %
Imperial Brands Finance plc	700.000	7,75 %	24.06.2019	767.282	0,03 %
Tritax Big Box plc	750.000	2,63 %	14.12.2026	761.331	0,03 %
CPUK Finance Ltd.	700.000	3,59 %	28.08.2025	754.338	0,03 %
Guinness Partnership Ltd.	600.000	4,00 %	24.10.2044	723.860	0,03 %
London & Quadrant Housing Trust Ltd.	500.000	5,50 %	27.01.2040	708.544	0,03 %
Southern Water Services Finance Ltd.	500.000	4,50 %	31.03.2052	708.416	0,03 %
London Stock Exchange Group plc	620.000	9,13 %	18.10.2019	708.194	0,03 %
Anglian Water Services Financing plc	550.000	6,88 %	21.08.2023	705.665	0,03 %
Segro plc	625.000	5,63 %	07.12.2020	701.669	0,03 %
Legal & General Finance plc	500.000	5,88 %	05.04.2033	700.541	0,03 %
UNITE USAF II plc	600.000	3,92 %	30.06.2025	676.359	0,03 %
Northumbrian Water Finance plc	530.000	6,88 %	06.02.2023	661.507	0,02 %
London Power Networks plc	500.000	6,13 %	07.06.2027	660.491	0,02 %
GKN Holdings plc	600.000	6,75 %	28.10.2019	658.487	0,02 %
NRAM Ltd.	600.000	6,38 %	02.12.2019	653.497	0,02 %
Broadgate Financing plc	549.945	4,95 %	05.04.2029	653.206	0,02 %
GlaxoSmithKline Capital plc	400.000	6,38 %	09.03.2039	639.756	0,02 %
Greater Gabbard OFTO plc	539.152	4,14 %	29.11.2032	624.685	0,02 %
United Utilities Water Ltd.	450.000	5,00 %	28.02.2035	604.862	0,02 %
HBOS Sterling Finance Jersey LP^	400.000	7,88 %	09.12.2166	597.920	0,02 %
Northern Powergrid Yorkshire plc	500.000	9,25 %	17.01.2020	581.304	0,02 %
Santander UK plc^	400.000	7,04 %	14.02.2166	488.093	0,02 %
BAT International Finance plc	400.000	6,00 %	29.06.2022	476.109	0,02 %
Thames Water Utilities Finance Ltd.	300.000	6,50 %	09.02.2032	429.231	0,02 %
Yorkshire Water Services Odsal Finance Ltd.	305.000	6,59 %	21.02.2023	377.212	0,01 %
Porterbrook Rail Finance Ltd.	288.000	6,50 %	20.10.2020	327.669	0,01 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
South East Water Finance Ltd.	250.000	5,66 %	30.09.2019	268.565	0,01 %
Myriad Capital plc	200.000	4,75 %	20.12.2043	254.816	0,01 %
				1.172.877.570	44,20 %
USA 11,50 % (2016: 11,28 %)					
Pfizer, Inc.	9.469.000	2,74 %	15.06.2043	9.536.987	0,36 %
Wal-Mart Stores, Inc.	5.400.000	5,63 %	27.03.2034	7.791.196	0,29 %
AT&T, Inc.	6.050.000	4,88 %	01.06.2044	7.172.699	0,27 %
Bank of America Corp.	4.850.000	7,00 %	31.07.2028	6.991.144	0,26 %
AT&T, Inc.	4.300.000	7,00 %	30.04.2040	6.448.848	0,24 %
Wal-Mart Stores, Inc.	4.475.000	5,25 %	28.09.2035	6.364.166	0,24 %
International Business Machines Corp.	5.850.000	2,75 %	21.12.2020	6.144.325	0,23 %
AT&T, Inc.	5.500.000	3,55 %	14.09.2037	5.527.847	0,21 %
AT&T, Inc.	4.850.000	4,25 %	01.06.2043	5.255.499	0,20 %
GE Capital UK Funding Unlimited Co.	3.400.000	5,88 %	18.01.2033	4.802.568	0,18 %
Wells Fargo & Co.	3.600.000	4,88 %	29.11.2035	4.584.182	0,17 %
Morgan Stanley	4.462.000	2,63 %	09.03.2027	4.556.773	0,17 %
Apple, Inc.	4.100.000	3,05 %	31.07.2029	4.533.960	0,17 %
Wells Fargo & Co.	4.500.000	2,00 %	28.07.2025	4.495.860	0,17 %
Verizon Communications, Inc.	4.400.000	3,38 %	27.10.2036	4.428.600	0,17 %
GE Capital UK Funding Unlimited Co.	2.430.000	8,00 %	14.01.2039	4.411.325	0,17 %
Wal-Mart Stores, Inc.	3.149.000	4,88 %	19.01.2039	4.390.292	0,17 %
Citigroup, Inc.	2.550.000	7,38 %	01.09.2039	4.387.913	0,17 %
Bank of America Corp.	3.750.000	6,13 %	15.09.2021	4.383.330	0,17 %
Amgen, Inc.	3.650.000	4,00 %	13.09.2029	4.193.587	0,16 %
AT&T, Inc.	3.600.000	4,38 %	14.09.2029	4.099.986	0,15 %
Wells Fargo Bank NA	3.400.000	5,25 %	01.08.2023	4.001.844	0,15 %
Wells Fargo & Co.	3.050.000	4,63 %	02.11.2035	3.901.816	0,15 %
Comcast Corp.	2.800.000	5,50 %	23.11.2029	3.718.470	0,14 %
Bank of America Corp.	3.600.000	2,30 %	25.07.2025	3.694.190	0,14 %
Citigroup, Inc.	3.425.000	5,13 %	12.12.2018	3.555.849	0,13 %
Time Warner Cable LLC	3.000.000	5,75 %	02.06.2031	3.538.755	0,13 %
United Parcel Service, Inc.	2.250.000	5,13 %	12.02.2050	3.510.058	0,13 %
Goldman Sachs Group, Inc.	2.600.000	7,13 %	07.08.2025	3.487.578	0,13 %
Citigroup, Inc.	2.775.000	5,15 %	21.05.2026	3.394.166	0,13 %
Verizon Communications, Inc.	2.979.000	4,07 %	18.06.2024	3.353.681	0,13 %
Goldman Sachs Group, Inc.	2.900.000	4,25 %	29.01.2026	3.304.422	0,12 %
Goldman Sachs Group, Inc.	2.900.000	5,50 %	12.10.2021	3.300.577	0,12 %
General Electric Co.	2.525.000	4,88 %	18.09.2037	3.286.505	0,12 %
MetLife, Inc.	2.600.000	5,38 %	09.12.2024	3.200.782	0,12 %
Wells Fargo & Co.	2.850.000	3,50 %	12.09.2029	3.193.345	0,12 %
Welltower, Inc.	2.716.000	4,80 %	20.11.2028	3.187.851	0,12 %
Metropolitan Life Global Funding I	3.000.000	2,63 %	05.12.2022	3.160.167	0,12 %
Time Warner Cable LLC	2.750.000	5,25 %	15.07.2042	3.114.628	0,12 %
AT&T, Inc.	2.500.000	5,50 %	15.03.2027	3.082.030	0,12 %
American International Group, Inc.	2.650.000	5,00 %	26.04.2023	3.053.256	0,12 %
Goldman Sachs Group, Inc.	2.150.000	7,25 %	10.04.2028	3.049.371	0,12 %
Citigroup, Inc.	1.882.000	6,80 %	25.06.2038	3.020.070	0,11 %
AT&T, Inc.	2.450.000	5,20 %	18.11.2033	2.988.882	0,11 %
General Motors Financial Co., Inc.	3.000.000	2,25 %	06.09.2024	2.986.950	0,11 %
Wells Fargo & Co.	2.900.000	2,13 %	22.04.2022	2.967.280	0,11 %
JPMorgan Chase & Co.	2.800.000	1,88 %	10.02.2020	2.851.699	0,11 %
GE Capital UK Funding Unlimited Co.	2.700.000	4,38 %	31.07.2019	2.839.088	0,11 %
GE Capital UK Funding Unlimited Co.	1.840.000	6,25 %	05.05.2038	2.816.127	0,11 %
Wells Fargo & Co.	2.794.000	1,38 %	30.06.2022	2.772.442	0,10 %
Apple, Inc.	2.300.000	3,60 %	31.07.2042	2.748.040	0,10 %
Digital Stout Holding LLC	2.400.000	4,75 %	13.10.2023	2.712.830	0,10 %
Metropolitan Life Global Funding I	2.400.000	3,50 %	30.09.2026	2.709.917	0,10 %
JPMorgan Chase & Co.	2.400.000	3,50 %	18.12.2026	2.679.734	0,10 %
Wal-Mart Stores, Inc.	1.900.000	5,75 %	19.12.2030	2.677.558	0,10 %
Johnson & Johnson	2.100.000	5,50 %	06.11.2024	2.654.211	0,10 %
Wells Fargo & Co.	2.600.000	2,13 %	20.12.2023	2.650.963	0,10 %
Verizon Communications, Inc.	2.200.000	4,75 %	17.02.2034	2.622.448	0,10 %
GE Capital UK Funding Unlimited Co.	2.300.000	5,88 %	04.11.2020	2.598.540	0,10 %
Kraft Heinz Foods Co.	2.300.000	4,13 %	01.07.2027	2.560.898	0,10 %
Welltower, Inc.	2.200.000	4,50 %	01.12.2034	2.541.858	0,10 %
Bank of America Corp.	2.150.000	4,25 %	10.12.2026	2.514.560	0,10 %
GE Capital UK Funding Unlimited Co.	2.200.000	4,13 %	13.09.2023	2.497.165	0,09 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Prologis LP	2.482.000	2,25 %	30.06.2029	2.426.051	0,09 %
Amgen, Inc.	1.900.000	5,50 %	07.12.2026	2.401.116	0,09 %
Verizon Communications, Inc.	2.400.000	3,13 %	02.11.2035	2.366.928	0,09 %
General Electric Co.	1.835.000	5,25 %	07.12.2028	2.362.885	0,09 %
Procter & Gamble Co.	2.400.000	1,80 %	03.05.2029	2.359.579	0,09 %
General Electric Co.	1.600.000	5,38 %	18.12.2040	2.288.680	0,09 %
Westfield America Management Ltd.	2.200.000	2,63 %	30.03.2029	2.214.049	0,08 %
Bank of America Corp.	2.000.000	5,50 %	04.12.2019	2.169.340	0,08 %
MetLife, Inc.	1.950.000	5,25 %	29.06.2020	2.144.766	0,08 %
Discovery Communications LLC	2.100.000	2,50 %	20.09.2024	2.078.895	0,08 %
McKesson Corp.	1.900.000	3,13 %	17.02.2029	1.942.218	0,07 %
Bank of America Corp.	1.675.000	5,50 %	22.11.2021	1.911.430	0,07 %
Goldman Sachs Group, Inc.	1.250.000	6,88 %	18.01.2038	1.907.425	0,07 %
Fidelity International Ltd.	1.500.000	7,13 %	13.02.2024	1.885.188	0,07 %
Procter & Gamble Co.	1.260.000	6,25 %	31.01.2030	1.826.272	0,07 %
McDonald's Corp.	1.400.000	4,13 %	11.06.2054	1.736.434	0,07 %
PepsiCo, Inc.	1.600.000	2,50 %	01.11.2022	1.698.192	0,06 %
Procter & Gamble Co.	1.700.000	1,38 %	03.05.2025	1.679.260	0,06 %
Brown-Forman Corp.	1.630.000	2,60 %	07.07.2028	1.670.157	0,06 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	1.595.000	2,88 %	20.11.2020	1.662.295	0,06 %
McDonald's Corp.	1.125.000	5,88 %	23.04.2032	1.538.671	0,06 %
Digital Stout Holding LLC	1.500.000	2,75 %	19.07.2024	1.537.545	0,06 %
General Electric Co.	1.350.000	6,25 %	29.09.2020	1.533.430	0,06 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	1.375.000	3,60 %	20.11.2025	1.498.848	0,06 %
Citigroup, Inc.	1.200.000	4,50 %	03.03.2031	1.410.391	0,05 %
Fidelity National Information Services, Inc.	1.380.000	1,70 %	30.06.2022	1.381.104	0,05 %
Metropolitan Life Global Funding I	1.300.000	2,88 %	11.01.2023	1.379.715	0,05 %
American Honda Finance Corp.	1.300.000	2,63 %	14.10.2022	1.368.580	0,05 %
Digital Stout Holding LLC	1.150.000	4,25 %	17.01.2025	1.284.990	0,05 %
Procter & Gamble Co.	850.000	5,25 %	19.01.2033	1.190.056	0,05 %
General Electric Co.	1.000.000	5,50 %	07.06.2021	1.141.072	0,04 %
Tennessee Valley Authority	775.000	5,63 %	07.06.2032	1.089.073	0,04 %
Digital Stout Holding LLC	1.000.000	3,30 %	19.07.2029	1.033.244	0,04 %
Metropolitan Life Global Funding I	1.000.000	1,13 %	15.12.2021	994.056	0,04 %
Federal National Mortgage Association	700.000	5,38 %	07.12.2028	931.862	0,04 %
ASIF III Jersey Ltd.	736.000	5,00 %	18.12.2018	764.831	0,03 %
ASIF II	650.000	6,38 %	05.10.2020	739.428	0,03 %
McDonald's Corp.	300.000	6,38 %	03.02.2020	331.876	0,01 %
Tennessee Valley Authority	180.000	5,35 %	07.06.2021	204.751	0,01 %
International Business Machines Corp.	100.000	2,63 %	05.08.2022	105.940	0,00 %
				305.192.311	11,50 %
Summe Anleihen				2.575.123.182	97,04 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				2.575.123.182	97,04 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures (0,00 %) (2016: 0,00 %)				
Long Gilt Futures März 2018	158	19.778.440	(3.160)	(0,00 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente			(3.160)	(0,00 %)

	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva	78.612.527	2,96 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)	2.653.732.549	100,00 %

Analyse des Gesamtvermögens	GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind	2.535.301.548	95,54 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	39.821.634	1,50 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente	(3.160)	(0,00 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva	78.612.527	2,96 %
Gesamtnettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)	2.653.732.549	100,00 %

[^] Zinsvariable Anleihe (FRN). Der Effektivzins zum 31. Dezember 2017.

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Kapital GBP (£)	Kosten GBP (£)		Kapital GBP (£)	Erlöse GBP (£)
Käufe			Verkäufe		
United Kingdom Gilt 1,75 % 07.09.2037	41.600.000	40.800.035	United Kingdom Gilt 1,75 % 07.09.2037	41.600.000	41.037.230
United Kingdom Gilt 0,75 % 22.07.2023	24.000.000	23.783.280	United Kingdom Gilt 3,50 % 22.01.2045	19.870.000	26.747.081
United Kingdom Gilt 3,50 % 22.01.2045	12.390.000	16.911.488	United Kingdom Gilt 4,25 % 07.03.2036	13.420.000	18.571.572
United Kingdom Gilt 4,25 % 07.03.2036	10.770.000	15.059.376	United Kingdom Gilt 0,75 % 22.07.2023	16.000.000	15.893.280
United Kingdom Gilt 4,50 % 07.12.2042	7.300.000	11.519.378	European Investment Bank 1,38 % 15.01.2018	14.150.000	14.285.847
KFW 0,38 % 15.12.2020	10.000.000	9.899.800	United Kingdom Gilt 4,50 % 07.12.2042	7.300.000	11.516.533
KFW 1,13 % 23.12.2019	9.300.000	9.459.280	Electricite de France SA 6,13 % 2.6.2034	6.700.000	9.065.770
Electricite de France SA 5,88 % 18.7.2031	6.900.000	9.021.819	United Kingdom Gilt 4,50 % 07.03.2019	8.000.000	8.756.770
FMS Wertmanagement AoeR 0,63 % 6.3.2020	9.000.000	8.995.411	KFW 2,00 % 6.12.2018	8.000.000	8.148.060
European Investment Bank 0,63 % 17.01.2020	7.000.000	6.995.900	FMS Wertmanagement AoeR 1,00 % 10.4.2018	7.000.000	7.042.060
KFW 0,88 % 15.3.2022	7.000.000	6.984.540	European Investment Bank 4,75 % 15.10.2018	5.575.000	5.825.095
KFW 6,00 % 7.12.2028	4.600.000	6.788.252	United Kingdom Gilt 1,50 % 22.07.2047	5.500.000	5.046.160
United Kingdom Gilt 3,75 % 22.07.2052	3.900.000	5.985.447	Bank Nederlandse Gemeenten NV 1,88 % 7.12.2018	4.950.000	5.014.004
AT&T, Inc. 3,55 % 14.9.2037	5.500.000	5.415.705	European Investment Bank 1,13 % 07.09.2021	5.000.000	5.010.025
European Investment Bank 2,50 % 31.10.2022	5.000.000	5.349.450	Bank of America Corp. 7,75 % 30.4.2018	3.600.000	3.846.960
HSBC Holdings plc 2,26 % 13.11.2026	5.079.000	5.080.800	KFW 2,00 % Reg S 6.12.2018	3.600.000	3.653.892
United Kingdom Gilt 1,50 % 22.07.2047	5.500.000	4.998.985	Coventry Building Society 4,63 % 19.4.2018	3.500.000	3.640.175
Anheuser-Busch InBev SA 2,85 % 25.5.2037	4.600.000	4.611.656	BP Capital Markets plc 4,33 % 10.12.2018	3.350.000	3.466.580
European Investment Bank 4,25 % 07.12.2021	4.000.000	4.594.000	Yorkshire Building Society 4,75 % 12.4.2018	3.300.000	3.432.924
Lloyds Banking Group plc 2,25 % 16.10.2024	4.550.000	4.517.240	UBS AG 6,63 % 11.4.2018	3.100.000	3.275.801

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	GBP (£) Zum 31. Dezember 2017	GBP (£) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.575.123.182	2.060.643.449
Barmittel und liquide Vermögenswerte	66.646.789	20.099.109
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	39.685.548	34.440.823
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	13.247.024	8.754.234
Bareinschüsse für Futures	28.867	—
Sonstige Forderungen	—	168
Summe Umlaufvermögen	2.694.731.410	2.123.937.783
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	3.160	—
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	34.787.248	17.570.150
Zahlbare Dividenden	4.530.202	5.438.140
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	1.375.233	1.757.836
An Broker zu zahlende Bareinschüsse	—	145.412
Zahlbare Verwaltungsgebühren	303.018	231.558
Summe kurzfristige Passiva	40.998.861	25.143.096
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	2.653.732.549	2.098.794.687

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Thesaurierende GBP-Anteile (£)			
Nettovermögen	1.734.892.203	1.081.623.085	896.941.504
Anzahl der umlaufenden Anteile	18.280.903	11.879.225	10.904.061
Nettoinventarwert je Anteil	94,90	91,05	82,26
Ausschüttende GBP-Anteile (£)			
Nettovermögen	469.040.279	624.010.047	441.033.671
Anzahl der umlaufenden Anteile	7.950.947	10.745.085	8.172.846
Nettoinventarwert je Anteil	58,99	58,07	53,96
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile (£)			
Nettovermögen	204.064.183	216.434.540	82.383
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.686.834	1.866.422	787
Nettoinventarwert je Anteil	120,97	115,96	104,67
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)			
Nettovermögen	245.735.884	176.727.015	92.088.679
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.242.880	1.638.520	918.597
Nettoinventarwert je Anteil	109,56	107,86	100,25

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	GBP (£) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	GBP (£) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	66.094.870	51.706.138
Verschiedene Erträge	125.395	109.400
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	32.271.318	107.776.498
Summe Anlageerträge/(-verluste)	98.491.583	159.592.036
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	3.245.227	2.349.541
Transaktionsgebühren und Provisionen	3.830	3.682
Sonstige Aufwendungen	—	1.147
Summe Aufwendungen	3.249.057	2.354.370
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	15	5
Ausgezahlte Ausschüttungen	19.280.846	19.250.149
Ertragsausgleich	1.118.727	(778.358)
Summe Finanzierungskosten	20.399.588	18.471.796
Nettoanlageerträge/(-verluste)	74.842.938	138.765.870
Ausländische Quellensteuer	—	(52.697)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	74.842.938	138.713.173

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	GBP (£) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	GBP (£) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	74.842.938	138.713.173
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	1.180.021.746	1.058.094.631
Rücknahmen	(703.045.485)	(530.529.538)
Reinvestitionen	3.118.663	2.370.184
Summe Kapitalgeschäfte ¹	480.094.924	529.935.277
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	554.937.862	668.648.450
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	2.098.794.687	1.430.146.237
Zum Jahresende	2.653.732.549	2.098.794.687

1 Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund

Unterverwaltet durch Vanguard Asset Management, Limited.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds strebt eine Rendite an, die der Wertentwicklung des Bloomberg Barclays GBP Non-Government 1–5 Year 200MM Float Adjusted Bond Index entspricht, eines marktgewichteten Index für auf Pfund Sterling lautende Investment-Grade-Anleihen mit Laufzeiten von 1 bis 5 Jahren, ausgenommen Staatsanleihen.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	293	332
Rendite auf Endfälligkeit	1,2 % ³	1,3 %
Durchschnittlicher Kupon	3,6 %	3,5 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	3,1 Jahre	3,2 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	A1	A1
Durchschnittliche Duration	3,0 Jahre	3,0 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Thesaurierende Anteile	0,15 %	
Ausschüttende Anteile	0,15 %	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,05 %	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,05 %	
Kurzfristige Reserven	0,8 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
R ²	0,98	1,00
Beta	0,99	1,00

Diversifizierung nach Märkten (% des Portfolios)

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Vereinigtes Königreich	34,1 %	30,1 %
Deutschland	18,7	19,3
Supranationale Anleihen	12,3	12,5
USA	6,1	6,4
Niederlande	5,0	5,1
Frankreich	4,6	5,5
Australien	3,4	3,6
Kanada	3,1	3,0
Schweden	3,0	3,4
Schweiz	2,4	2,4
Belgien	1,6	1,7
Italien	1,3	1,7
Finnland	1,1	1,0
Japan	1,1	1,1
Sonstige	2,2	3,2

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

Finanzinstitute	26,4 %
Industriegüter	20,6
Agency-Titel	18,6
Supranationale Anleihen	12,3
Versorger	6,8
Forderungsbesicherte Wertpapiere	6,1
Treasury-Titel	6,0
Lokale Behörde	2,6
Staatlich	0,6

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	31,0 %
Aa	20,0
A	18,5
Baa	30,4
nicht eingestuft	0,1

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	92,0 %
Mehr als 5 Jahre	8,0 %

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit

Durchschnittliche Fälligkeit	Kurz	Mittel	Lang
Kreditqualität Staats-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays GBP Non-Government 1–5 Year 200MM Float Adjusted Bond Index.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

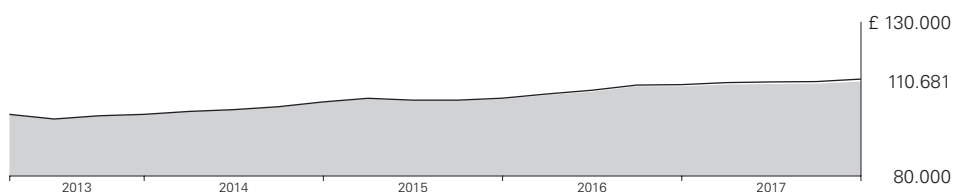
U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays GBP Non-Government 1–5 Year 200MM Float Adjusted Bond Index

In GBP

Kumulative Wertentwicklung: 22. Mai 2013–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile	1,44 %	2,23 %	£ 110.681
Benchmark	1,64	2,38	111.451
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von £ 100.000
Ausschüttende Anteile	1,44 %	2,22 %	£ 110.679
Benchmark	1,64	2,38	111.451
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	1,55 %	2,48 %	£ 217.004.000
Benchmark	1,64	2,58	217.677.235
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	1,55 %	2,48 %	£ 216.999.287
Benchmark	1,64	2,58	217.677.235

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,20 Prozentpunkte für Thesaurierungsanteile und Ertragsanteile und 0,09 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile und institutionelle Plus-Ertragsanteile.²

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,30 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

¹ Für Thesaurierungs- und Ertragsanteile, 22. Mai 2013; für institutionelle Plus-Thesaurierungs- und institutionelle Plus-Ertragsanteile, 2. September 2014.

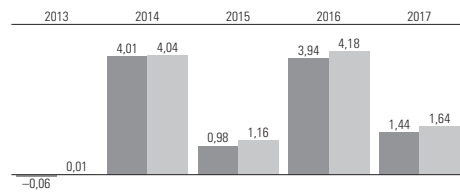
² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays GBP Non-Government 1–5 Year 500MM Float Adjusted Bond Index

In GBP

Summe Anlagerenditen (%): 22. Mai 2013–31. Dezember 2017



Thesaurierende Anteile

Benchmark

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 98,52 % (2016: 97,79 %)					
Australien 3,43 % (2016: 2,66 %)					
Westpac Banking Corp.	5.924.000	5,00 %	21.10.2019	6.347.092	0,44 %
National Australia Bank Ltd.	5.500.000	5,13 %	09.12.2021	6.298.083	0,44 %
BHP Billiton Finance Ltd.^	4.000.000	6,50 %	22.10.2077	4.669.680	0,32 %
Scentre Group Trust 1/Scentre Group Trust 2	4.000.000	2,38 %	08.04.2022	4.138.604	0,29 %
Westpac Banking Corp.	3.600.000	1,00 %	30.06.2022	3.573.623	0,25 %
National Australia Bank Ltd.	3.250.000	0,88 %	26.06.2020	3.232.911	0,23 %
National Australia Bank Ltd.	3.210.000	1,13 %	10.11.2021	3.211.419	0,22 %
National Capital Trust I^	3.071.000	5,62 %	17.12.2166	3.175.328	0,22 %
Commonwealth Bank of Australia	2.830.000	1,13 %	22.12.2021	2.828.489	0,20 %
Lendlease Europe Finance plc	2.300.000	6,13 %	12.10.2021	2.649.402	0,18 %
Westpac Banking Corp.	2.500.000	2,63 %	14.12.2022	2.638.498	0,18 %
National Australia Bank Ltd.	2.197.000	1,88 %	20.02.2020	2.234.224	0,16 %
National Australia Bank Ltd.	2.200.000	1,38 %	27.06.2022	2.196.898	0,15 %
Macquarie Bank Ltd.	2.000.000	3,50 %	18.12.2020	2.128.986	0,15 %
				49.323.237	3,43 %
Österreich 0,27 % (2016: 0,43 %)					
Oesterreichische Kontrollbank AG	4.000.000	0,75 %	07.03.2022	3.955.440	0,27 %
				3.955.440	0,27 %
Belgien 1,46 % (2016: 1,34 %)					
Dexia Credit Local SA	9.200.000	1,13 %	15.06.2022	9.181.287	0,64 %
Dexia Credit Local SA	5.100.000	2,00 %	17.06.2020	5.225.409	0,36 %
Dexia Credit Local SA	4.900.000	0,88 %	07.09.2021	4.857.390	0,34 %
Kingdom of Belgium Government International Bond	1.500.000	9,38 %	21.02.2020	1.765.187	0,12 %
				21.029.273	1,46 %
Kanada 3,04 % (2016: 1,84 %)					
Province of Alberta Canada	7.100.000	1,00 %	15.11.2021	7.070.140	0,49 %
Export Development Canada	5.500.000	1,00 %	15.12.2020	5.535.054	0,38 %
Export Development Canada	4.600.000	1,38 %	16.12.2019	4.660.497	0,32 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	4.600.000	1,13 %	30.06.2022	4.585.510	0,32 %
Royal Bank of Canada	4.200.000	1,13 %	22.12.2021	4.208.173	0,29 %
Bank of Nova Scotia	4.000.000	0,75 %	14.09.2021	3.956.752	0,27 %
Province of Manitoba Canada	3.200.000	0,75 %	15.12.2021	3.156.352	0,22 %
Bank of Nova Scotia	3.000.000	1,25 %	08.06.2022	2.989.338	0,21 %
Bank of Montreal	2.400.000	1,38 %	29.12.2021	2.412.677	0,17 %
Export Development Canada	2.300.000	0,88 %	07.12.2021	2.294.526	0,16 %
Provinz Quebec (Kanada)	2.000.000	0,88 %	24.05.2022	1.977.187	0,14 %
Toronto-Dominion Bank	1.000.000	1,00 %	13.12.2021	997.282	0,07 %
				43.843.488	3,04 %
Finnland 1,14 % (2016: 0,76 %)					
OP Corporate Bank plc	3.953.000	2,50 %	20.05.2022	4.153.876	0,29 %
Municipality Finance plc	3.600.000	1,25 %	07.03.2019	3.621.478	0,25 %
Finland Government International Bond	3.300.000	1,63 %	15.12.2020	3.379.553	0,23 %
Finland Government International Bond	3.200.000	1,50 %	19.12.2019	3.248.151	0,23 %
Municipality Finance plc	2.000.000	0,75 %	15.12.2020	1.994.740	0,14 %
				16.397.798	1,14 %
Frankreich 4,67 % (2016: 3,96 %)					
SNCF Reseau EPIC	6.600.000	5,50 %	01.12.2021	7.684.989	0,53 %
IXIS Corporate & Investment Bank SA	5.950.000	5,88 %	24.02.2020	6.553.628	0,46 %
Orange SA^	5.600.000	5,88 %	07.02.2166	6.246.744	0,43 %
BNP Paribas SA	4.900.000	2,38 %	20.11.2019	5.035.867	0,35 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	4.800.000	1,00 %	07.03.2019	4.812.126	0,33 %
BNP Paribas SA	4.500.000	1,13 %	16.08.2022	4.445.028	0,31 %
RCI Banque SA	3.653.000	1,88 %	08.11.2022	3.697.347	0,26 %
Total Capital International SA	3.400.000	2,25 %	09.06.2022	3.561.194	0,25 %
AXA SA	2.731.000	7,13 %	15.12.2020	3.164.246	0,22 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	3.000.000	1,00 %	14.06.2022	2.985.882	0,21 %
Engie SA^	2.800.000	4,63 %	10.01.2166	2.892.397	0,20 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	2.900.000	0,88 %	08.06.2020	2.884.311	0,20 %
AXA SA^	2.000.000	6,77 %	16.10.2166	2.179.200	0,15 %
Orange SA	1.797.000	7,25 %	10.11.2020	2.102.044	0,15 %
Total Capital International SA	2.000.000	2,25 %	17.12.2020	2.073.324	0,14 %
Dexia Credit Local SA	2.000.000	1,13 %	24.02.2019	2.007.356	0,14 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	1.600.000	0,50 %	12.06.2020	1.588.264	0,11 %
Credit Agricole SA	1.000.000	5,50 %	17.12.2021	1.164.883	0,08 %
BNP Paribas SA	1.000.000	5,75 %	24.01.2022	1.153.736	0,08 %
Caisse des Depots et Consignations	1.000.000	1,50 %	23.12.2019	1.014.035	0,07 %
				67.246.601	4,67 %
Deutschland 18,51 % (2016: 19,60 %)					
KFW	39.318.000	1,13 %	23.12.2019	39.724.548	2,76 %
KFW	21.900.000	5,55 %	07.06.2021	25.378.246	1,76 %
KFW	16.000.000	0,38 %	15.12.2020	15.826.224	1,10 %
FMS Wertmanagement AoeR	11.500.000	1,13 %	13.12.2019	11.602.419	0,81 %
KFW	11.227.000	1,38 %	01.02.2021	11.422.979	0,79 %
FMS Wertmanagement AoeR	9.300.000	1,25 %	08.03.2019	9.373.005	0,65 %
KFW	9.000.000	0,88 %	15.03.2022	8.983.656	0,62 %
innogy Finance BV	7.500.000	6,50 %	20.04.2021	8.749.065	0,61 %
FMS Wertmanagement AoeR	8.000.000	0,63 %	06.03.2020	7.988.176	0,55 %
Deutsche Telekom International Finance BV	6.310.000	6,50 %	08.04.2022	7.633.220	0,53 %
FMS Wertmanagement AoeR	7.500.000	0,88 %	14.02.2022	7.486.568	0,52 %
E.ON International Finance BV	6.500.000	6,00 %	30.10.2019	7.082.036	0,49 %
Deutsche Bank AG	7.000.000	1,88 %	28.02.2020	7.049.525	0,49 %
Daimler International Finance BV	6.700.000	3,50 %	06.06.2019	6.936.778	0,48 %
FMS Wertmanagement AoeR	6.700.000	0,88 %	14.05.2021	6.717.266	0,47 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	6.300.000	1,38 %	15.12.2020	6.413.419	0,45 %
Volkswagen Financial Services NV	5.700.000	1,50 %	12.04.2021	5.724.624	0,40 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	5.400.000	1,88 %	20.12.2019	5.496.703	0,38 %
NRW Bank	5.500.000	1,00 %	15.06.2022	5.484.380	0,38 %
BMW Finance NV	5.237.000	0,88 %	16.08.2022	5.129.641	0,36 %
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	5.000.000	0,88 %	07.03.2022	4.971.700	0,34 %
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	4.500.000	1,13 %	17.05.2021	4.533.984	0,31 %
Daimler AG	4.500.000	1,50 %	13.01.2022	4.532.436	0,31 %
Deutsche Bahn Finance GmbH	4.000.000	2,75 %	20.06.2022	4.277.848	0,30 %
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen^	3.500.000	6,63 %	26.05.2042	4.195.191	0,29 %
BMW International Investment BV	4.119.000	1,00 %	17.11.2021	4.090.167	0,28 %
Daimler AG	3.800.000	2,75 %	04.12.2020	3.976.069	0,28 %
Deutsche Pfandbriefbank AG	3.600.000	1,00 %	04.12.2020	3.596.400	0,25 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	3.211.000	1,13 %	12.05.2021	3.244.073	0,23 %
Volkswagen Financial Services NV	3.200.000	1,75 %	17.04.2020	3.238.669	0,22 %
BMW US Capital LLC	3.000.000	2,00 %	20.11.2019	3.055.500	0,21 %
Volkswagen Financial Services NV	3.000.000	1,75 %	12.09.2022	3.019.680	0,21 %
Bayerische Landesbank	1.800.000	1,25 %	20.12.2021	1.805.533	0,13 %
Daimler AG	1.600.000	2,38 %	16.12.2021	1.667.597	0,12 %
Henkel AG & Co. KGaA	1.535.000	0,88 %	13.09.2022	1.517.418	0,11 %
Aareal Bank AG	1.250.000	1,00 %	04.06.2020	1.251.025	0,09 %
innogy Finance BV	1.000.000	5,50 %	06.07.2022	1.172.146	0,08 %
BMW Finance NV	1.092.000	2,38 %	01.12.2021	1.140.350	0,08 %
Daimler AG	1.000.000	2,13 %	07.06.2022	1.032.949	0,07 %
				266.521.213	18,51 %
Italien 1,24 % (2016: 0,84 %)					
Enel SpA	5.300.000	6,25 %	20.06.2019	5.692.995	0,39 %
Autostrade per l'Italia SpA	4.035.000	6,25 %	09.06.2022	4.842.525	0,34 %
Enel SpA^	2.952.000	6,63 %	15.09.2076	3.392.698	0,24 %
FCA Bank SpA	2.900.000	1,63 %	29.09.2021	2.895.789	0,20 %
Enel SpA^	864.000	7,75 %	10.09.2075	994.248	0,07 %
				17.818.255	1,24 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Japan 0,99 % (2016: 0,31 %)					
Toyota Motor Credit Corp.	5.335.000	1,13 %	07.09.2021	5.345.126	0,37 %
Japan Bank for International Corp.	3.500.000	2,63 %	15.12.2020	3.660.003	0,26 %
American Honda Finance Corp.	2.800.000	1,30 %	21.03.2022	2.792.602	0,19 %
Toyota Motor Credit Corp.	2.500.000	1,00 %	27.09.2022	2.473.147	0,17 %
				14.270.878	0,99 %
Mexiko 0,60 % (2016: 0,45 %)					
America Movil SAB de CV^	4.500.000	6,38 %	06.09.2073	4.983.156	0,34 %
Petroleos Mexicanos	3.000.000	8,25 %	02.06.2022	3.720.000	0,26 %
				8.703.156	0,60 %
Niederlande 4,94 % (2016: 5,05 %)					
Cooperatieve Rabobank UA	7.618.000	2,25 %	23.03.2022	7.913.182	0,55 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	7.000.000	1,38 %	09.12.2019	7.087.920	0,49 %
ABN AMRO Bank NV	5.800.000	1,38 %	07.06.2022	5.821.483	0,40 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	5.500.000	1,00 %	09.12.2019	5.529.992	0,38 %
ING Bank NV	4.791.000	5,38 %	15.04.2021	5.439.711	0,38 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	5.000.000	1,13 %	24.05.2021	5.038.375	0,35 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	4.000.000	5,75 %	18.01.2019	4.211.696	0,29 %
Cooperatieve Rabobank UA	3.800.000	4,63 %	13.01.2021	4.194.014	0,29 %
Rabobank Capital Funding Trust IV^	3.900.000	5,56 %	31.12.2166	4.167.524	0,29 %
Shell International Finance BV	3.960.000	2,00 %	20.12.2019	4.048.752	0,28 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	3.500.000	5,38 %	07.06.2021	4.023.866	0,28 %
ABN AMRO Bank NV	4.000.000	1,00 %	30.06.2020	3.992.024	0,28 %
Unilever plc	3.600.000	1,13 %	03.02.2022	3.598.308	0,25 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	3.000.000	1,13 %	07.03.2019	3.016.716	0,21 %
Cooperatieve Rabobank UA	1.000.000	4,00 %	19.09.2022	1.116.349	0,08 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	1.000.000	1,00 %	15.03.2022	998.860	0,07 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	1.000.000	0,88 %	20.12.2021	994.440	0,07 %
				71.193.212	4,94 %
Neuseeland 0,07 % (2016: 0,00 %)					
ASB Finance Ltd.	1.000.000	1,00 %	07.09.2020	995.850	0,07 %
				995.850	0,07 %
Norwegen 0,42 % (2016: 0,35 %)					
DNB Bank A.S.A	4.300.000	4,25 %	27.01.2020	4.585.210	0,32 %
Kommunalbanken A.S.	1.400.000	0,88 %	08.12.2020	1.402.807	0,10 %
				5.988.017	0,42 %
Singapur 0,14 % (2016: 0,00 %)					
Temasek Financial I Ltd.	1.800.000	4,63 %	26.07.2022	2.070.889	0,14 %
				2.070.889	0,14 %
Südkorea 0,14 % (2016: 0,00 %)					
Koreanische Entwicklungsbank	2.000.000	1,75 %	15.12.2022	1.999.580	0,14 %
				1.999.580	0,14 %
Spanien 0,58 % (2016: 1,28 %)					
Telefonica Emisiones SAU	6.500.000	5,60 %	12.03.2020	7.108.712	0,50 %
Iberdrola Finanzas SA	1.000.000	6,00 %	01.07.2022	1.190.734	0,08 %
				8.299.446	0,58 %
Supranational 12,21 % (2016: 17,50 %)					
Europäische Investitionsbank	48.950.000	1,50 %	01.02.2019	49.466.520	3,44 %
Europäische Investitionsbank	17.800.000	5,38 %	07.06.2021	20.508.092	1,42 %
Europäische Investitionsbank	18.000.000	2,50 %	31.10.2022	19.227.672	1,34 %
Europäische Investitionsbank	14.800.000	2,25 %	07.03.2020	15.306.426	1,06 %
Europäische Investitionsbank	13.000.000	1,13 %	07.09.2021	13.110.812	0,91 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	8.000.000	0,75 %	07.12.2021	7.956.047	0,55 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	7.600.000	1,38 %	15.12.2020	7.736.926	0,54 %
Nordic Investment Bank	6.300.000	0,63 %	02.11.2021	6.243.332	0,43 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	6.000.000	0,38 %	15.06.2021	5.912.523	0,41 %
Council Of Europe Development Bank	5.800.000	1,25 %	23.12.2019	5.862.884	0,41 %
Europäische Investitionsbank	4.000.000	4,25 %	07.12.2021	4.506.096	0,31 %
Inter-American Development Bank	3.830.000	0,63 %	15.12.2021	3.790.103	0,26 %
Council Of Europe Development Bank	3.000.000	1,25 %	23.12.2019	3.032.526	0,21 %
Europäische Investitionsbank	3.000.000	0,63 %	17.01.2020	2.998.266	0,21 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
African Development Bank	3.000.000	0,88 %	20.12.2021	2.992.236	0,21 %
Inter-American Development Bank	2.000.000	1,13 %	17.12.2019	2.018.878	0,14 %
Asian Development Bank	2.000.000	0,75 %	24.03.2022	1.985.994	0,14 %
Council Of Europe Development Bank	2.000.000	0,63 %	15.06.2022	1.968.754	0,14 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	1.000.000	5,40 %	07.06.2021	1.154.173	0,08 %
				175.778.260	12,21 %
Schweden 2,94 % (2016: 1,85 %)					
Svenska Handelsbanken AB	5.400.000	4,00 %	18.01.2019	5.574.204	0,39 %
Svenska Handelsbanken AB	4.700.000	2,38 %	18.01.2022	4.909.009	0,34 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	4.870.000	1,25 %	05.08.2022	4.843.819	0,34 %
Kommuninvest I Sverige AB	4.300.000	1,13 %	06.09.2019	4.329.541	0,30 %
Nordea Bank AB	4.211.000	2,13 %	13.11.2019	4.305.630	0,30 %
Swedbank Hypotek AB	4.290.000	1,13 %	07.12.2021	4.296.306	0,30 %
Swedbank AB	3.800.000	1,25 %	29.12.2021	3.802.622	0,26 %
Nordea Bank AB	3.500.000	2,38 %	02.06.2022	3.669.393	0,25 %
Svensk Exportkredit AB	3.000.000	0,63 %	07.12.2020	2.982.138	0,21 %
Vattenfall AB	1.500.000	6,13 %	16.12.2019	1.645.057	0,11 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	1.000.000	3,00 %	18.12.2020	1.055.500	0,07 %
Svenska Handelsbanken AB	900.000	3,00 %	20.11.2020	948.581	0,07 %
				42.361.800	2,94 %
Schweiz 2,34 % (2016: 2,88 %)					
Glencore Canada Financial Corp.	5.300.000	7,38 %	27.05.2020	6.031.294	0,42 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	5.500.000	3,00 %	27.05.2022	5.805.756	0,40 %
ELM BV for Swiss Reinsurance Co., Ltd.^	5.350.000	6,30 %	25.11.2166	5.687.050	0,39 %
Glencore Finance Europe Ltd.	5.250.000	6,50 %	27.02.2019	5.568.980	0,39 %
Nestle Holdings, Inc.	5.000.000	1,75 %	09.12.2020	5.123.230	0,36 %
Glencore Finance Europe Ltd.	3.106.000	6,00 %	03.04.2022	3.594.704	0,25 %
Zurich Finance UK plc^	1.609.000	6,63 %	02.10.2166	1.907.476	0,13 %
				33.718.490	2,34 %
Vereinigtes Königreich 33,26 % (2016: 28,65 %)					
United Kingdom Gilt	43.000.000	4,50 %	07.03.2019	45.055.173	3,13 %
United Kingdom Gilt	27.500.000	0,50 %	22.07.2022	27.227.108	1,89 %
Barclays Bank plc	16.445.000	10,00 %	21.05.2021	20.650.371	1,43 %
Santander UK plc	10.445.000	5,13 %	14.04.2021	11.827.521	0,82 %
United Kingdom Gilt	10.500.000	4,75 %	07.03.2020	11.480.700	0,80 %
Barclays Bank plc	8.799.000	4,25 %	12.01.2022	9.904.339	0,69 %
Imperial Brands Finance plc	7.500.000	9,00 %	17.02.2022	9.695.250	0,67 %
SSE plc^	7.800.000	3,88 %	10.09.2166	8.102.250	0,56 %
Barclays plc^	8.000.000	2,38 %	06.10.2023	8.089.232	0,56 %
Bank of Scotland plc	5.700.000	9,38 %	15.05.2021	7.100.587	0,49 %
Friends Life Holdings plc	5.500.000	8,25 %	21.04.2022	7.039.521	0,49 %
Santander UK plc	6.650.000	1,88 %	17.02.2020	6.767.346	0,47 %
AA Bond Co., Ltd.	6.469.000	2,88 %	31.01.2022	6.516.418	0,45 %
Investec Bank plc	5.156.000	9,63 %	17.02.2022	6.429.893	0,45 %
Aviva plc^	5.326.000	5,90 %	27.07.2166	5.773.384	0,40 %
BAT International Finance plc	5.690.000	1,75 %	05.07.2021	5.770.741	0,40 %
Aviva plc^	5.000.000	6,63 %	03.06.2041	5.716.365	0,40 %
Co.-Operative Bank plc	5.077.000	4,75 %	11.11.2021	5.560.137	0,39 %
Cadent Finance plc	5.588.000	1,13 %	22.09.2021	5.553.153	0,39 %
Heathrow Funding Ltd.	4.900.000	6,00 %	20.03.2020	5.396.605	0,37 %
Nationwide Building Society	4.900.000	5,63 %	09.09.2019	5.281.372	0,37 %
Nationwide Building Society	5.070.000	2,25 %	29.04.2022	5.268.658	0,37 %
Rolls-Royce plc	4.750.000	6,75 %	30.04.2019	5.112.615	0,35 %
Firstgroup plc	4.100.000	8,75 %	08.04.2021	5.002.861	0,35 %
Phoenix Group Holdings	4.650.000	4,13 %	20.07.2022	4.956.965	0,34 %
Imperial Brands Finance plc	4.500.000	7,75 %	24.06.2019	4.932.527	0,34 %
Coventry Building Society	4.500.000	6,00 %	16.10.2019	4.893.930	0,34 %
FCE Bank plc	4.700.000	2,76 %	13.11.2019	4.835.407	0,34 %
Centrica plc	3.900.000	6,38 %	10.03.2022	4.659.556	0,32 %
BAT International Finance plc	4.150.000	6,38 %	12.12.2019	4.567.316	0,32 %
GKN Holdings plc	3.918.000	5,38 %	19.09.2022	4.490.533	0,31 %
TSB Banking Group plc^	3.999.000	5,75 %	06.05.2026	4.425.789	0,31 %
Legal & General Group plc^	4.200.000	5,88 %	01.10.2166	4.409.651	0,31 %
Lloyds Bank plc^	4.000.000	5,75 %	09.07.2025	4.381.724	0,30 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Lloyds Bank plc	4.200.000	1,75 %	31.03.2022	4.310.712	0,30 %
Nestle Holdings, Inc.	4.300.000	1,00 %	11.06.2021	4.309.159	0,30 %
CYBG plc^	4.000.000	5,00 %	09.02.2026	4.255.976	0,30 %
Marks & Spencer plc	3.900.000	6,13 %	02.12.2019	4.250.914	0,29 %
Coventry Building Society	4.200.000	1,00 %	05.05.2020	4.190.512	0,29 %
G4S plc	3.800.000	7,75 %	13.05.2019	4.127.226	0,29 %
Porterbrook Rail Finance Ltd.	3.607.000	6,50 %	20.10.2020	4.103.832	0,28 %
Prudential plc^	3.600.000	11,38 %	29.05.2039	4.096.332	0,28 %
United Utilities Water Ltd.	3.300.000	5,75 %	25.03.2022	3.898.488	0,27 %
Sky plc	3.650.000	2,88 %	24.11.2020	3.821.806	0,26 %
Kennedy Wilson Europe Real Estate plc	3.600.000	3,95 %	30.06.2022	3.782.592	0,26 %
Eastern Power Networks plc	3.300.000	4,75 %	30.09.2021	3.709.682	0,26 %
AA Bond Co., Ltd.	3.500.000	4,25 %	31.07.2020	3.693.634	0,26 %
EE Finance plc	3.550.000	4,38 %	28.03.2019	3.692.284	0,26 %
Motability Operations Group plc	3.110.000	5,38 %	28.06.2022	3.676.039	0,25 %
Southern Water Services Finance Ltd.	3.200.000	5,00 %	31.03.2021	3.579.328	0,25 %
SSE plc	3.220.000	4,25 %	14.09.2021	3.568.520	0,25 %
BUFA Finance plc	3.299.000	3,38 %	17.06.2021	3.516.332	0,24 %
Aviva plc^	3.000.000	6,13 %	29.09.2166	3.442.500	0,24 %
Great Rolling Stock Co., Ltd.	3.000.000	6,25 %	27.07.2020	3.358.641	0,23 %
Global Switch Holdings Ltd.	3.000.000	4,38 %	13.12.2022	3.358.200	0,23 %
BUFA Finance plc^	3.000.000	6,13 %	16.09.2166	3.299.520	0,23 %
InterContinental Hotels Group plc	3.000.000	3,88 %	28.11.2022	3.295.452	0,23 %
RELX Investments plc	3.200.000	2,75 %	01.08.2019	3.268.608	0,23 %
SSE plc	2.682.000	5,88 %	22.09.2022	3.220.057	0,22 %
GKN Holdings plc	2.900.000	6,75 %	28.10.2019	3.182.686	0,22 %
FCE Bank plc	3.000.000	2,73 %	03.06.2022	3.114.540	0,22 %
Dwr Cymru Financing Ltd.	2.600.000	6,91 %	31.03.2021	3.082.929	0,21 %
Standard Life Aberdeen plc^	2.800.000	6,55 %	06.01.2167	3.059.980	0,21 %
Fidelity International Ltd.	2.654.000	6,75 %	19.10.2020	3.006.929	0,21 %
Coventry Building Society	2.500.000	5,88 %	28.09.2022	2.985.510	0,21 %
Motability Operations Group plc	2.681.000	6,63 %	10.12.2019	2.976.393	0,21 %
Legal & General Group plc^	2.300.000	10,00 %	23.07.2041	2.932.180	0,20 %
Marks & Spencer plc	2.500.000	6,13 %	06.12.2021	2.900.135	0,20 %
Southern Water Services Finance Ltd.	2.730.000	6,13 %	31.03.2019	2.900.000	0,20 %
CPUK Finance Ltd.	2.800.000	2,67 %	28.02.2020	2.871.271	0,20 %
Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd.^	2.500.000	5,75 %	13.09.2030	2.870.030	0,20 %
Arqiva Financing plc	2.700.000	4,04 %	30.06.2020	2.843.483	0,20 %
Next plc	2.500.000	5,38 %	26.10.2021	2.837.945	0,20 %
Wellcome Trust Finance plc	2.500.000	4,75 %	28.05.2021	2.817.780	0,20 %
BAE Systems plc	2.440.000	4,13 %	08.06.2022	2.712.223	0,19 %
Virgin Money plc	2.615.000	2,25 %	21.04.2020	2.660.525	0,18 %
Anglian Water Services Financing plc	2.200.000	5,84 %	30.07.2022	2.636.044	0,18 %
Investec plc	2.400.000	4,50 %	05.05.2022	2.595.343	0,18 %
Wessex Water Services Finance plc	2.350.000	4,00 %	24.09.2021	2.581.917	0,18 %
Skipton Building Society	2.500.000	1,75 %	30.06.2022	2.491.383	0,17 %
Southern Gas Networks plc	2.200.000	4,88 %	21.12.2020	2.433.838	0,17 %
Close Brothers Finance plc	2.240.000	3,88 %	27.06.2021	2.417.094	0,17 %
Experian Finance plc	2.219.000	3,50 %	15.10.2021	2.392.433	0,17 %
Wales & West Utilities Finance plc	2.000.000	6,25 %	30.11.2021	2.374.868	0,16 %
Firstgroup plc	2.000.000	5,25 %	29.11.2022	2.299.840	0,16 %
Segro plc	2.000.000	5,63 %	07.12.2020	2.245.340	0,16 %
FCE Bank plc	2.000.000	3,25 %	19.11.2020	2.095.964	0,15 %
Eversholt Funding plc	1.764.000	5,83 %	02.12.2020	1.986.271	0,14 %
Severn Trent Utilities Finance plc	2.000.000	1,13 %	07.09.2021	1.985.816	0,14 %
Barclays Bank plc	1.500.000	9,50 %	07.08.2021	1.871.223	0,13 %
Yorkshire Water Services Bradford Finance Ltd.	1.700.000	6,00 %	21.08.2019	1.836.007	0,13 %
Northern Powergrid Yorkshire plc	1.500.000	9,25 %	17.01.2020	1.743.913	0,12 %
BAT International Finance plc	1.400.000	6,00 %	29.06.2022	1.666.381	0,12 %
Severn Trent Utilities Finance plc	1.500.000	1,63 %	04.12.2022	1.504.506	0,10 %
British Telecommunications plc	1.290.000	8,63 %	26.03.2020	1.500.801	0,10 %
Heathrow Funding Ltd.	1.000.000	9,20 %	29.03.2021	1.244.973	0,09 %
Direct Line Insurance Group plc^	953.000	9,25 %	27.04.2042	1.234.600	0,09 %
WPP Finance SA	1.041.000	6,38 %	06.11.2020	1.188.532	0,08 %
Marston's Issuer plc^	1.140.000	5,16 %	15.10.2027	1.136.059	0,08 %
Southern Water Services Finance Ltd.^	1.000.000	4,50 %	31.03.2038	1.093.576	0,08 %

	Kapital GBP (£)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Northern Gas Networks Finance plc	830.000	5,88 %	08.07.2019	890.383	0,06 %
Leeds Building Society	500.000	4,88 %	16.11.2020	556.991	0,04 %
ENW Finance plc	400.000	6,13 %	21.07.2021	465.517	0,03 %
				478.925.496	33,26 %
USA 6,13 % (2016: 7,41 %)					
Bank of America Corp.	8.200.000	6,13 %	15.09.2021	9.584.882	0,67 %
International Business Machines Corp.	7.550.000	2,75 %	21.12.2020	7.929.856	0,55 %
Wells Fargo & Co.	6.900.000	2,13 %	22.04.2022	7.060.080	0,49 %
Citigroup, Inc.	6.655.000	5,13 %	12.12.2018	6.909.248	0,48 %
Goldman Sachs Group, Inc.	5.000.000	5,50 %	12.10.2021	5.690.650	0,39 %
JPMorgan Chase & Co.	5.250.000	1,88 %	10.02.2020	5.346.936	0,37 %
General Electric Co.	4.200.000	5,50 %	07.06.2021	4.792.502	0,33 %
GE Capital UK Funding Unlimited Co.	4.200.000	5,88 %	04.11.2020	4.745.160	0,33 %
Bank of America Corp.	3.750.000	5,50 %	04.12.2019	4.067.512	0,28 %
New York Life Global Funding	4.000.000	1,00 %	15.12.2021	3.980.156	0,28 %
Metropolitan Life Global Funding I	4.001.000	1,13 %	15.12.2021	3.977.218	0,28 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	3.700.000	2,88 %	20.11.2020	3.856.107	0,27 %
Wells Fargo & Co.	3.494.000	1,38 %	30.06.2022	3.467.040	0,24 %
PepsiCo, Inc.	3.188.000	2,50 %	01.11.2022	3.383.648	0,23 %
GE Capital UK Funding Unlimited Co.	3.150.000	4,38 %	31.07.2019	3.312.269	0,23 %
MetLife, Inc.	2.780.000	5,25 %	29.06.2020	3.057.666	0,21 %
Metropolitan Life Global Funding I	2.013.000	2,63 %	05.12.2022	2.120.472	0,15 %
Fidelity National Information Services, Inc.	1.990.000	1,70 %	30.06.2022	1.991.592	0,14 %
American Honda Finance Corp.	1.500.000	2,63 %	14.10.2022	1.579.131	0,11 %
International Business Machines Corp.	1.300.000	2,63 %	05.08.2022	1.377.217	0,10 %
				88.229.342	6,13 %
Summe Anleihen				1.418.669.721	98,52 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				1.418.669.721	98,52 %
		Anzahl der Kontrakte	Nominal- betrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente					
Futures (0,00 %) (2016: (0,00 %))					
Long Gilt Futures März 2018		79	9.889.220	(1.580)	(0,00 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente				(1.580)	(0,00 %)
				Marktwert GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva				21.304.052	1,48 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)				1.439.972.193	100,00 %
				GBP (£)	% des Gesamt- nettovermögens
Analyse des Gesamtvermögens					
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind				1.410.688.145	97,97 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere				7.981.576	0,55 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				—	—
(d) Derivative Finanzinstrumente				(1.580)	(0,00 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva				21.304.052	1,48 %
Gesamtvermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)				1.439.972.193	100,00 %

^ Zinsvariable Anleihe (FRN). Der Effektivzins zum 31. Dezember 2017.

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Kapital GBP (£)	Kosten GBP (£)		Kapital GBP (£)	Erlöse GBP (£)
Käufe			Verkäufe		
United Kingdom Gilt 0,50 % 22.07.2022	148.820.000	147.719.525	United Kingdom Gilt 0,50 % 22.07.2022	121.320.000	120.660.457
United Kingdom Gilt 4,50 % 07.03.2019	47.000.000	49.332.830	European Investment Bank 1,38 % 15.01.2018	37.550.000	37.910.545
United Kingdom Gilt 1,75 % 07.09.2022	34.200.000	35.816.812	United Kingdom Gilt 1,75 % 07.09.2022	34.200.000	35.872.999
European Investment Bank 2,50 % 31.10.2022	18.000.000	19.239.840	United Kingdom Gilt 1,75 % 22.07.2019	27.000.000	27.981.189
KFW 0,38 % 15.12.2020	18.000.000	17.771.210	European Investment Bank 4,75 % 15.10.2018	26.550.000	27.951.271
Barclays Bank plc 4,25 % 12.01.2022	14.699.000	16.859.570	KFW 1,38 % 1.2.2021	26.073.000	26.679.916
Imperial Brands Finance plc 9,00 % 17.2.2022	11.500.000	15.552.560	United Kingdom Gilt 1,25 % 22.07.2018	20.000.000	20.334.134
KFW 0,88 % 15.3.2022	15.000.000	15.096.750	European Investment Bank 2,25 % 07.03.2020	19.200.000	20.060.745
FMS Wertmanagement AoeR 0,63 % 6.3.2020	15.000.000	14.942.850	United Kingdom Gilt 3,75 % 07.09.2021	17.000.000	19.467.245
European Investment Bank 4,25 % 07.12.2021	10.000.000	11.550.140	European Investment Bank 1,50 % 01.02.2019	19.000.000	19.204.760
United Kingdom Gilt 4,75 % 07.03.2020	10.500.000	11.483.325	FMS Wertmanagement AoeR 1,00 % 10.4.2018	17.600.000	17.696.470
FMS Wertmanagement AoeR 0,88 % 14.2.2022	10.500.000	10.568.260	KFW 2,00 % 6.12.2018	15.200.000	15.437.872
Deutsche Telekom International Finance BV 6,50 % 8.4.2022	8.310.000	10.367.301	FMS Wertmanagement AoeR 1,88 % 7.12.2018	15.000.000	15.225.120
Deutsche Bank AG 1,88 % 28.02.2020	9.500.000	9.478.475	Bank Nederlandse Gemeenten NV 1,88 % 7.12.2018	14.450.000	14.662.089
Co.-Operative Bank plc 4,75 % 11.11.2021	8.427.000	9.445.686	Barclays Bank plc 10,00 % 21.05.2021	9.800.000	12.579.470
Wells Fargo & Co. 2,13 % 22.4.2022	8.900.000	9.300.184	UBS AG 6,63 % 11.4.2018	11.700.000	12.375.287
FMS Wertmanagement AoeR 1,88 % 7.12.2018	9.000.000	9.222.400	European Investment Bank 5,38 % 07.06.2021	10.200.000	12.073.633
Dexia Credit Local SA 1,13 % 15.6.2022	9.200.000	9.218.216	KFW 2,00 % 6.12.2018	11.500.000	11.756.217
KFW 1,13 % 23.12.2019	9.000.000	9.167.430	Bank of America Corp. 7,75 % 30.4.2018	10.650.000	11.403.170
European Investment Bank 1,13 % 07.09.2021	9.000.000	9.145.140	Export Development Canada 1,88 % 17.12.2018	11.000.000	11.178.160

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	GBP (£) Zum 31. Dezember 2017	GBP (£) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.418.669.721	1.329.401.934
Barmittel und liquide Vermögenswerte	30.709.841	69.489.415
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	20.376.257	19.962.856
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	6.488.955	15.075.507
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	4.250.337	—
Bareinschüsse für Futures	12.809	—
Summe Umlaufvermögen	1.480.507.920	1.433.929.712
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	1.580	—
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	38.998.985	73.207.990
Zahlbare Dividenden	696.403	677.629
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	674.590	400.538
An Broker zu zahlende Bareinschüsse	—	32.403
Zahlbare Verwaltungsgebühren	164.169	126.962
Summe kurzfristige Passiva	40.535.727	74.445.522
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	1.439.972.193	1.359.484.190

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Thesaurierende GBP-Anteile (£)			
Nettovermögen	1.069.940.663	677.152.284	681.579.642
Anzahl der umlaufenden Anteile	9.666.843	6.206.001	6.493.161
Nettoinventarwert je Anteil	110,68	109,11	104,97
Ausschüttende GBP-Anteile (£)			
Nettovermögen	186.041.943	176.549.432	213.746.053
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.822.758	1.731.491	2.143.920
Nettoinventarwert je Anteil	102,07	101,96	99,70
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile (£)			
Nettovermögen	156.586.051	485.602.686	1.135.529
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.443.160	4.544.410	11.057
Nettoinventarwert je Anteil	108,50	106,86	102,69
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)			
Nettovermögen	27.403.536	20.179.788	5.956.801
Anzahl der umlaufenden Anteile	268.177	197.683	59.670
Nettoinventarwert je Anteil	102,18	102,08	99,83

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	GBP (£) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	GBP (£) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	21.942.961	19.228.691
Verschiedene Erträge	180.367	9.991
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	(1.108.497)	20.194.594
Summe Anlageerträge/(-verluste)	21.014.831	39.433.276
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	1.756.376	1.324.014
Transaktionsgebühren und Provisionen	2.208	1.495
Sonstige Aufwendungen	—	17
Summe Aufwendungen	1.758.584	1.325.526
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	55	—
Ausgezahlte Ausschüttungen	2.629.874	2.948.551
Ertragsausgleich	(69.202)	20.945
Summe Finanzierungskosten	2.560.727	2.969.496
Nettoanlageerträge/(-verluste)	16.695.520	35.138.254
Ausländische Quellensteuer	—	(169.714)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	16.695.520	34.968.540

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	GBP (£) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	GBP (£) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	16.695.520	34.968.540
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	633.054.049	939.855.549
Rücknahmen	(569.267.045)	(517.765.053)
Reinvestitionen	5.479	7.129
Summe Kapitalgeschäfte ¹	63.792.483	422.097.625
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	80.488.003	457.066.165
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	1.359.484.190	902.418.025
Zum Jahresende	1.439.972.193	1.359.484.190

¹ Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

U.S. Government Bond Index Fund

Verwaltet durch The Vanguard Group, Inc.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds strebt eine Rendite an, die der Wertentwicklung des Bloomberg Barclays U.S. Government Float Adjusted Bond Index entspricht, eines marktgewichteten Index, der das gesamte Spektrum der auf US-Dollar lautenden US-Schatztitel und regierungsnahen Wertpapiere mit Laufzeiten von mehr als einem Jahr widerspiegeln soll.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	376	537
Rendite auf Endfälligkeit	2,2 % ³	2,2 %
Durchschnittlicher Kupon	2,1 %	2,1 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	7,6 Jahre	7,6 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	Aaa	Aaa
Durchschnittliche Duration	6,0 Jahre	6,0 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,20 %	
Anlegeranteile	0,25 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %	
Thesaurierende Anteile	0,25 %	
Kurzfristige Reserven	0,8 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
R ²	1,00	1,00
Beta	1,04	1,00

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

Treasury-Titel	96,2 %
Agency-Titel	3,8

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	99,5 %
nicht eingestuft	0,5

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	58,1 %
5-10 Jahre	25,0
Mehr als 10 Jahre	16,9

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit

Durchschnittliche Fälligkeit	Kurz	Mittel	Lang
Kreditqualität Staats-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays U.S. Government Float Adjusted Bond Index.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

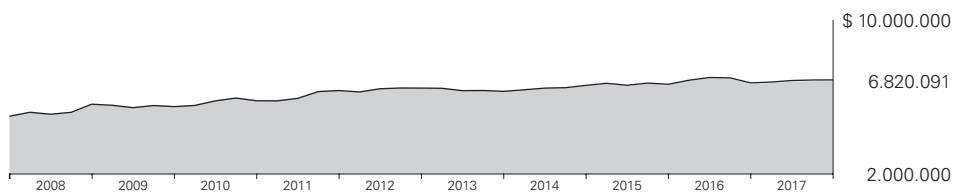
Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

U.S. Government Bond Index Fund
Benchmark: Bloomberg Barclays U.S. Government Float Adjusted Bond Index

In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000



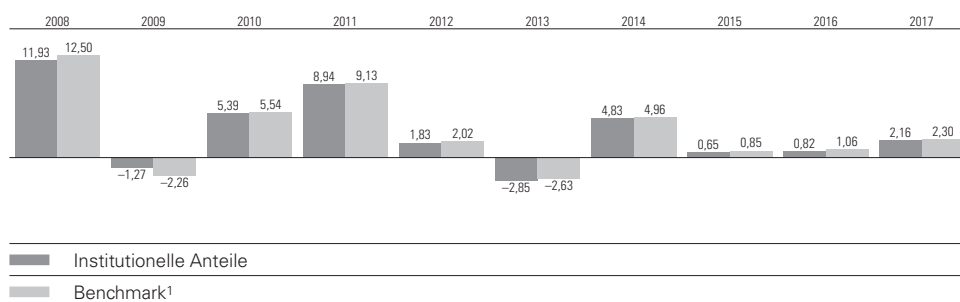
	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 5,000,000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
— Institutionelle Anteile	2,16 %	1,09 %	3,15 %	\$ 6.820.091
— Benchmark ¹	2,30	1,28	3,25	6.883.651

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen			Endwert einer Anlage von \$ 100,000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Anlegeranteile	2,10 %	1,03 %	3,07 %	\$ 135.323
Benchmark ¹	2,30	1,28	3,25	137.673

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen		Endwert einer Anlage von \$ 200.000,000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ²	
Institutionelle Plus-Anteile	2,26 %	2,03 %	\$ 217.001.600
Benchmark	2,30	2,14	218.006.088

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,14 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,20 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,04 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.³

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



1 Bloomberg Barclays U.S. Government Bond Index bis 30. Juni 2010; danach Bloomberg Barclays U.S. Government Float Adjusted Bond Index.

2 6. Dezember 2013.

3 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

U.S. Government Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays U.S. Government Float Adjusted Bond Index Euro-Hedged

Abgesichert in Euro

Kumulative Wertentwicklung: 31. März 2016–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. € 5.000.000

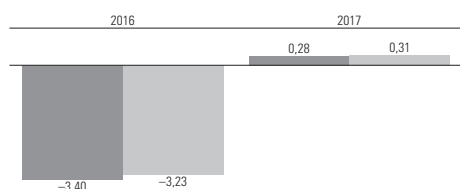


	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenden Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 5.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
— Institutionelle Anteile, abgesichert in Euro	0,28 %	-1,80 %	€ 4.843.550
— Benchmark	0,31	-1,68	4.853.556

	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von € 200.000.000
Institutionelle Plus-Anteile	-0,41 %	€ 199.174.248
Benchmark	-0,32	199.359.371

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,03 Prozentpunkte für in Euro abgesicherte institutionelle Anteile und 0,09 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. März 2016–31. Dezember 2017



■ Institutionelle Anteile, abgesichert in Euro
■ Benchmark

¹ 31. März 2016.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

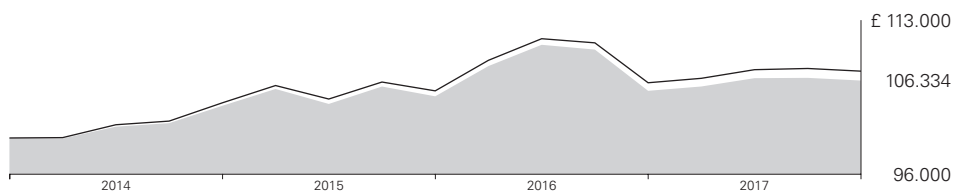
U.S. Government Bond Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays U.S. Government Float Adjusted Bond Index GBP-Hedged

Abgesichert in GBP

Kumulative Wertentwicklung: 31. Januar 2014–31. Dezember 2017

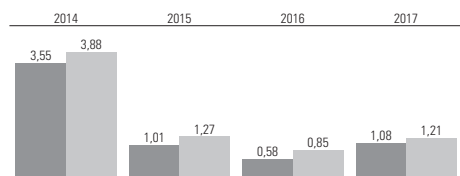
Erstanlage i.H.v. £ 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenden Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP	1,08 %	1,58 %	£ 106.334
Benchmark	1,21	1,83	107.370

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,13 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte Thesaurierungsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Januar 2014–31. Dezember 2017



Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP
Benchmark

¹ 31. Januar 2014.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 99,16 % (2016: 99,54 %)					
USA 99,11 % (2016: 99,43 %)					
US Treasury Note	27.250.000	1,75 %	30.11.2019	27.181.875	1,53 %
US Treasury Note	23.027.000	0,88 %	15.05.2019	22.728.367	1,28 %
US Treasury Note	20.630.000	1,63 %	31.08.2022	20.114.250	1,14 %
US Treasury Note	20.005.000	1,38 %	30.04.2021	19.570.515	1,10 %
US Treasury Note	19.731.000	1,50 %	15.07.2020	19.521.358	1,10 %
US Treasury Note	18.998.000	2,25 %	15.08.2027	18.724.904	1,06 %
US Treasury Note	18.650.000	2,00 %	30.11.2022	18.483.899	1,04 %
US Treasury Note	18.040.000	2,38 %	15.05.2027	17.986.443	1,02 %
US Treasury Note	16.729.000	2,25 %	15.11.2024	16.637.512	0,94 %
US Treasury Note	17.602.000	1,63 %	15.02.2026	16.617.388	0,94 %
US Treasury Note	16.315.000	1,50 %	15.06.2020	16.149.302	0,91 %
US Treasury Note	15.700.000	1,75 %	31.12.2020	15.589.610	0,88 %
US Treasury Note	15.000.000	2,00 %	31.07.2020	15.023.438	0,85 %
US Treasury Note	15.300.000	1,75 %	31.01.2023	14.958.140	0,84 %
US Treasury Note	14.800.000	1,50 %	15.05.2020	14.656.625	0,83 %
US Treasury Note	14.500.000	1,50 %	15.04.2020	14.366.327	0,81 %
US Treasury Note	13.981.000	2,50 %	15.05.2024	14.138.286	0,80 %
US Treasury Note	14.420.000	1,75 %	30.09.2022	14.129.348	0,80 %
US Treasury Note	14.240.000	1,50 %	15.08.2020	14.084.250	0,80 %
US Treasury Note	14.157.000	2,00 %	15.08.2025	13.794.227	0,78 %
US Treasury Note	13.378.000	2,38 %	15.08.2024	13.415.626	0,76 %
US Treasury Note	13.400.000	2,25 %	31.01.2024	13.368.593	0,75 %
US Treasury Note	13.500.000	2,13 %	31.07.2024	13.337.579	0,75 %
US Treasury Note	13.485.000	2,13 %	15.05.2025	13.276.403	0,75 %
US Treasury Note	13.600.000	1,25 %	31.10.2021	13.175.000	0,74 %
US Treasury Note	13.180.000	2,00 %	31.12.2021	13.112.041	0,74 %
US Treasury Note	13.900.000	1,63 %	15.05.2026	13.092.063	0,74 %
US Treasury Note	13.375.000	2,00 %	15.02.2025	13.071.973	0,74 %
US Treasury Note	13.400.000	1,25 %	31.03.2021	13.069.188	0,74 %
US Treasury Bond	12.150.000	3,13 %	15.02.2043	13.051.758	0,74 %
US Treasury Note	13.050.000	2,13 %	31.12.2022	12.994.945	0,73 %
US Treasury Note	13.010.000	2,13 %	30.09.2024	12.845.343	0,73 %
US Treasury Note	13.050.000	0,88 %	15.09.2019	12.831.820	0,72 %
US Treasury Note	13.200.000	1,63 %	30.04.2023	12.795.750	0,72 %
US Treasury Bond	12.041.000	3,00 %	15.05.2047	12.658.101	0,71 %
US Treasury Note	12.600.000	1,88 %	15.12.2020	12.562.593	0,71 %
US Treasury Note	12.650.000	2,25 %	15.11.2027	12.468.156	0,70 %
US Treasury Bond	12.380.000	2,75 %	15.08.2047	12.391.606	0,70 %
US Treasury Note	12.500.000	2,25 %	15.02.2027	12.332.031	0,70 %
US Treasury Note	12.400.000	1,75 %	31.05.2022	12.183.000	0,69 %
US Treasury Note	12.300.000	1,75 %	31.03.2022	12.096.281	0,68 %
US Treasury Note	12.100.000	1,88 %	31.07.2022	11.933.625	0,67 %
US Treasury Note	12.000.000	1,75 %	30.06.2022	11.782.500	0,67 %
US Treasury Bond	12.268.400	2,50 %	15.02.2046	11.674.149	0,66 %
US Treasury Note	11.500.000	1,50 %	31.05.2020	11.385.000	0,64 %
US Treasury Note	11.478.600	2,25 %	15.11.2025	11.374.575	0,64 %
US Treasury Bond	10.550.000	3,00 %	15.11.2045	11.080.797	0,63 %
US Treasury Note	11.100.000	1,63 %	31.12.2019	11.041.031	0,62 %
US Treasury Note	11.159.000	1,38 %	30.04.2020	11.021.256	0,62 %
US Treasury Note	11.100.000	1,00 %	15.11.2019	10.921.359	0,62 %
US Treasury Note	11.000.000	1,25 %	31.08.2019	10.888.282	0,61 %
US Treasury Bond	10.600.000	2,88 %	15.05.2043	10.888.187	0,61 %
US Treasury Note	10.925.000	1,38 %	31.05.2021	10.677.481	0,60 %
US Treasury Note	11.425.000	1,50 %	15.08.2026	10.625.250	0,60 %
US Treasury Note	10.745.000	2,00 %	31.05.2024	10.541.853	0,60 %
US Treasury Note	10.845.000	2,00 %	15.11.2026	10.492.538	0,59 %
US Treasury Bond	9.815.000	3,00 %	15.11.2044	10.307.283	0,58 %
US Treasury Bond	9.780.000	3,00 %	15.02.2047	10.281.225	0,58 %
US Treasury Note	10.150.000	2,25 %	30.04.2021	10.215.023	0,58 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
US Treasury Note	10.175.000	2,13 %	30.11.2024	10.039.864	0,57 %
US Treasury Bond	9.915.000	2,75 %	15.11.2042	9.969.223	0,56 %
US Treasury Note	10.075.000	1,88 %	30.09.2022	9.928.598	0,56 %
US Treasury Note	10.052.000	0,75 %	15.08.2019	9.874.520	0,56 %
US Treasury Note	9.450.000	2,13 %	29.02.2024	9.355.500	0,53 %
US Treasury Note	9.500.000	1,38 %	30.09.2020	9.354.531	0,53 %
US Treasury Note	9.447.000	1,38 %	31.01.2021	9.266.917	0,52 %
US Treasury Note	9.396.000	1,38 %	15.09.2020	9.262.400	0,52 %
US Treasury Note	8.898.000	0,75 %	30.09.2018	8.834.046	0,50 %
US Treasury Note	9.000.000	1,13 %	30.09.2021	8.683.594	0,49 %
US Treasury Note	8.725.000	1,50 %	30.11.2019	8.662.289	0,49 %
US Treasury Note	8.750.000	1,88 %	30.04.2022	8.644.727	0,49 %
US Treasury Bond	8.570.000	2,75 %	15.08.2042	8.622.224	0,49 %
US Treasury Note	8.460.000	2,63 %	15.11.2020	8.612.016	0,49 %
US Treasury Note	8.700.000	1,38 %	29.02.2020	8.602.125	0,49 %
US Treasury Bond	7.355.000	3,63 %	15.08.2043	8.583.514	0,48 %
US Treasury Bond	7.970.000	3,13 %	15.11.2041	8.562.769	0,48 %
US Treasury Bond	8.315.000	2,88 %	15.11.2046	8.528.072	0,48 %
US Treasury Note	8.474.000	1,13 %	15.01.2019	8.413.093	0,47 %
US Treasury Bond	8.400.000	2,75 %	15.11.2047	8.410.500	0,48 %
US Treasury Note	8.500.000	2,00 %	30.06.2024	8.332.656	0,47 %
US Treasury Note	8.350.000	0,88 %	15.04.2019	8.246.929	0,47 %
US Treasury Note	8.050.000	2,25 %	31.03.2021	8.102.828	0,46 %
US Treasury Note	8.203.000	1,75 %	30.11.2021	8.087.645	0,46 %
US Treasury Note	8.075.000	1,50 %	31.10.2019	8.020.746	0,45 %
US Treasury Note	7.780.000	2,75 %	15.02.2024	7.983.010	0,45 %
US Treasury Note	8.060.000	1,38 %	15.02.2020	7.971.844	0,45 %
US Treasury Note	8.149.500	1,75 %	15.05.2023	7.948.309	0,45 %
US Treasury Bond	6.945.000	3,38 %	15.05.2044	7.784.911	0,44 %
US Treasury Bond	6.625.000	3,63 %	15.02.2044	7.741.934	0,44 %
US Treasury Note	7.850.000	1,75 %	28.02.2022	7.727.344	0,44 %
US Treasury Note	7.735.000	2,25 %	31.10.2024	7.695.117	0,43 %
US Treasury Note	7.800.000	2,00 %	30.04.2024	7.658.625	0,43 %
US Treasury Bond	8.026.800	2,50 %	15.05.2046	7.634.240	0,43 %
US Treasury Note	8.000.000	1,25 %	31.07.2023	7.580.000	0,43 %
US Treasury Bond	5.370.000	6,25 %	15.05.2030	7.546.528	0,43 %
US Treasury Note	7.350.000	1,50 %	31.05.2019	7.313.250	0,41 %
US Treasury Note	7.450.000	1,38 %	30.06.2023	7.114.750	0,40 %
US Treasury Note	7.175.000	1,88 %	31.08.2024	6.979.930	0,39 %
US Treasury Note	7.000.000	1,38 %	15.01.2020	6.927.813	0,39 %
US Treasury Bond	6.757.000	2,88 %	15.08.2045	6.924.870	0,39 %
US Treasury Note	6.950.000	2,00 %	31.10.2022	6.889.187	0,39 %
US Treasury Note	7.076.000	1,13 %	31.08.2021	6.834.974	0,39 %
US Treasury Note	6.850.000	2,00 %	31.07.2022	6.797.555	0,38 %
US Treasury Note	6.725.000	1,63 %	31.07.2020	6.672.461	0,38 %
US Treasury Note	6.775.000	1,63 %	31.05.2023	6.561.164	0,37 %
US Treasury Bond	6.850.000	2,25 %	15.08.2046	6.176.774	0,35 %
US Treasury Bond	5.174.000	3,75 %	15.11.2043	6.159.486	0,35 %
US Treasury Note	6.175.000	2,00 %	15.11.2021	6.156.668	0,35 %
US Treasury Note	6.050.000	2,13 %	30.09.2021	6.052.836	0,34 %
US Treasury Note	6.050.000	1,50 %	31.01.2019	6.027.312	0,34 %
US Treasury Note	6.075.000	1,75 %	15.05.2022	5.976.281	0,34 %
US Treasury Bond	5.675.000	3,00 %	15.05.2045	5.959.636	0,34 %
US Treasury Note	6.000.000	0,75 %	31.10.2018	5.950.313	0,34 %
US Treasury Note	6.000.000	1,88 %	31.05.2022	5.930.625	0,33 %
US Treasury Bond	4.568.000	4,25 %	15.11.2040	5.797.077	0,33 %
US Treasury Note	5.787.000	2,13 %	15.08.2021	5.794.234	0,33 %
US Treasury Note	5.850.000	1,75 %	30.04.2022	5.748.539	0,32 %
US Treasury Note	5.460.000	3,63 %	15.02.2021	5.725.322	0,32 %
US Treasury Bond	4.306.000	4,63 %	15.02.2040	5.722.943	0,32 %
US Treasury Bond	4.300.000	5,38 %	15.02.2031	5.710.937	0,32 %
US Treasury Bond	4.170.000	4,75 %	15.02.2041	5.657.517	0,32 %
US Treasury Note	5.700.000	1,13 %	31.01.2019	5.657.250	0,32 %
US Treasury Note	5.900.000	1,38 %	31.08.2023	5.624.359	0,32 %
US Treasury Note	5.510.000	3,13 %	15.05.2019	5.603.842	0,32 %
US Treasury Note	5.800.000	1,50 %	28.02.2023	5.596.094	0,32 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
US Treasury Note	5.448.000	2,63 %	15.08.2020	5.542.489	0,31 %
US Treasury Note	5.700.000	1,13 %	30.06.2021	5.519.203	0,31 %
US Treasury Note	5.500.000	1,38 %	15.12.2019	5.446.719	0,31 %
US Treasury Note	5.500.000	1,38 %	31.01.2020	5.441.563	0,31 %
US Treasury Bond	5.015.000	3,13 %	15.08.2044	5.383.289	0,30 %
US Treasury Note	5.525.000	1,63 %	15.11.2022	5.382.559	0,30 %
US Treasury Note	5.364.700	1,00 %	15.10.2019	5.283.392	0,30 %
US Treasury Bond	4.900.000	3,13 %	15.02.2042	5.264.437	0,30 %
US Treasury Note	5.250.000	2,00 %	30.11.2020	5.254.922	0,30 %
US Treasury Bond	4.320.000	3,88 %	15.08.2040	5.202.900	0,29 %
US Treasury Note	5.247.000	1,63 %	15.10.2020	5.200.269	0,29 %
US Treasury Note	5.245.000	1,88 %	31.08.2022	5.171.242	0,29 %
US Treasury Note	5.200.000	2,13 %	30.11.2023	5.157.750	0,29 %
US Treasury Note	5.300.000	1,63 %	31.10.2023	5.116.156	0,29 %
US Treasury Note	5.200.000	1,13 %	31.07.2021	5.028.562	0,28 %
US Treasury Note	5.083.000	0,88 %	15.06.2019	5.012.315	0,28 %
US Treasury Note	5.000.000	2,13 %	30.06.2022	4.989.063	0,28 %
US Treasury Note	5.094.000	1,50 %	31.01.2022	4.967.446	0,28 %
US Treasury Note	5.025.000	1,25 %	31.01.2020	4.959.832	0,28 %
US Treasury Note	4.919.000	0,75 %	15.02.2019	4.859.050	0,27 %
US Treasury Note	4.725.000	3,63 %	15.08.2019	4.855.676	0,27 %
US Treasury Bond	3.730.000	4,38 %	15.05.2040	4.805.872	0,27 %
US Treasury Note	4.750.000	1,63 %	31.03.2019	4.736.641	0,27 %
US Treasury Note	4.702.000	1,63 %	31.07.2019	4.684.368	0,26 %
US Treasury Note	4.650.000	1,88 %	31.10.2022	4.582.430	0,26 %
US Treasury Note	4.650.000	1,00 %	30.09.2019	4.581.703	0,26 %
US Treasury Note	4.550.000	2,00 %	31.08.2021	4.534.359	0,26 %
US Treasury Note	4.350.000	3,63 %	15.02.2020	4.504.969	0,25 %
US Treasury Bond	4.245.000	3,00 %	15.05.2042	4.465.872	0,25 %
US Treasury Bond	3.425.000	4,38 %	15.11.2039	4.405.406	0,25 %
US Treasury Note	4.224.000	3,38 %	15.11.2019	4.340.160	0,25 %
US Treasury Note	4.550.000	1,38 %	30.09.2023	4.333.164	0,25 %
US Treasury Note	4.300.000	1,25 %	31.12.2018	4.275.813	0,24 %
US Treasury Note	4.204.000	1,63 %	31.08.2019	4.186.921	0,24 %
US Treasury Note	4.175.000	1,38 %	28.02.2019	4.152.168	0,23 %
US Treasury Note	4.030.000	2,75 %	15.11.2023	4.138.306	0,23 %
US Treasury Note	4.158.000	1,00 %	30.11.2018	4.128.764	0,23 %
US Treasury Note	3.975.000	3,13 %	15.05.2021	4.113.504	0,23 %
US Treasury Note	4.147.000	0,75 %	15.07.2019	4.077.667	0,23 %
US Treasury Bond	3.545.000	3,50 %	15.02.2039	4.045.178	0,23 %
US Treasury Bond	3.380.000	3,75 %	15.08.2041	4.003.187	0,23 %
US Treasury Note	3.969.000	1,63 %	30.04.2019	3.957.217	0,22 %
US Treasury Note	4.000.000	1,38 %	31.03.2020	3.953.750	0,22 %
US Treasury Bond	4.100.000	2,50 %	15.02.2045	3.908.453	0,22 %
US Treasury Note	3.850.000	2,00 %	28.02.2021	3.846.992	0,22 %
US Treasury Note	3.837.000	1,63 %	30.06.2019	3.823.810	0,22 %
US Treasury Note	3.955.000	1,50 %	31.03.2023	3.812.249	0,22 %
US Treasury Bond	2.780.000	4,38 %	15.05.2041	3.595.322	0,20 %
US Treasury Note	3.550.000	1,63 %	30.11.2020	3.513.945	0,20 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	3.500.000	1,88 %	17.11.2020	3.483.053	0,20 %
US Treasury Note	3.500.000	1,25 %	15.12.2018	3.481.406	0,20 %
US Treasury Note	3.300.000	2,38 %	31.12.2020	3.336.610	0,19 %
US Treasury Note	3.391.000	1,13 %	30.04.2020	3.330.598	0,19 %
US Treasury Note	3.325.000	2,13 %	31.12.2021	3.325.000	0,19 %
US Treasury Note	3.250.000	2,00 %	31.10.2021	3.236.289	0,18 %
US Treasury Note	3.289.000	1,38 %	31.10.2020	3.235.554	0,18 %
US Treasury Note	3.200.000	1,38 %	31.05.2020	3.159.000	0,18 %
US Treasury Note	3.100.000	2,13 %	30.06.2021	3.105.328	0,18 %
US Treasury Bond	2.400.000	4,50 %	15.02.2036	3.090.000	0,17 %
US Treasury Bond	2.439.000	4,25 %	15.05.2039	3.081.524	0,17 %
US Treasury Note	3.075.000	2,25 %	31.12.2023	3.068.273	0,17 %
US Treasury Note	3.100.000	1,38 %	31.08.2020	3.054.953	0,17 %
US Treasury Note	3.000.000	1,38 %	30.09.2018	2.992.031	0,17 %
US Treasury Note	3.000.000	1,75 %	31.10.2020	2.983.125	0,17 %
Federal National Mortgage Association	3.000.000	2,00 %	05.01.2022	2.976.564	0,17 %
US Treasury Note	3.000.000	2,13 %	31.03.2024	2.969.063	0,17 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
US Treasury Note	3.000.000	1,13 %	31.03.2020	2.948.438	0,17 %
US Treasury Bond	2.240.000	4,50 %	15.08.2039	2.924.950	0,17 %
US Treasury Note	2.900.000	1,25 %	31.10.2018	2.887.765	0,16 %
US Treasury Note	2.908.000	1,88 %	30.11.2021	2.883.918	0,16 %
US Treasury Bond	2.350.000	7,88 %	15.02.2021	2.767.125	0,16 %
US Treasury Note	2.807.000	0,88 %	31.07.2019	2.764.457	0,16 %
US Treasury Note	2.775.000	1,00 %	31.08.2019	2.735.977	0,15 %
US Treasury Note	2.701.000	2,13 %	31.01.2021	2.709.863	0,15 %
US Treasury Note	2.700.000	1,88 %	31.01.2022	2.671.734	0,15 %
US Treasury Note	2.620.000	2,25 %	31.07.2021	2.634.738	0,15 %
US Treasury Bond	2.050.000	4,38 %	15.02.2038	2.619.516	0,15 %
US Treasury Note	2.575.000	2,50 %	15.08.2023	2.610.406	0,15 %
US Treasury Note	2.600.000	1,25 %	31.01.2019	2.583.344	0,15 %
US Treasury Bond	2.000.000	5,50 %	15.08.2028	2.574.062	0,15 %
US Treasury Note	2.600.000	1,88 %	28.02.2022	2.571.563	0,15 %
US Treasury Note	2.600.000	1,13 %	28.02.2021	2.527.688	0,14 %
US Treasury Note	2.508.000	2,00 %	30.09.2020	2.511.527	0,14 %
Federal Home Loan Banks	2.500.000	1,38 %	18.03.2019	2.485.735	0,14 %
Federal Home Loan Banks	2.500.000	1,38 %	15.11.2019	2.474.037	0,14 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	2.450.000	2,38 %	13.01.2022	2.466.001	0,14 %
US Treasury Note	2.350.000	3,50 %	15.05.2020	2.435.555	0,14 %
US Treasury Note	2.300.000	1,75 %	15.11.2020	2.286.703	0,13 %
US Treasury Bond	1.690.000	4,50 %	15.05.2038	2.196.208	0,12 %
Federal Home Loan Banks	2.200.000	1,50 %	21.10.2019	2.183.179	0,12 %
US Treasury Note	2.183.000	0,88 %	15.10.2018	2.168.333	0,12 %
US Treasury Note	2.000.000	3,75 %	15.11.2018	2.033.438	0,12 %
US Treasury Note	2.000.000	2,75 %	15.02.2019	2.019.688	0,11 %
US Treasury Note	2.000.000	1,88 %	30.06.2020	1.997.500	0,11 %
US Treasury Note	2.000.000	1,38 %	30.11.2018	1.992.188	0,11 %
US Treasury Note	2.000.000	1,50 %	28.02.2019	1.991.875	0,11 %
US Treasury Note	2.000.000	1,63 %	30.06.2020	1.985.312	0,11 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	2.000.000	1,50 %	17.01.2020	1.981.552	0,11 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	2.000.000	1,13 %	15.04.2019	1.981.316	0,11 %
US Treasury Note	2.000.000	1,25 %	29.02.2020	1.973.125	0,11 %
Federal National Mortgage Association	2.000.000	1,00 %	28.08.2019	1.970.372	0,11 %
Federal National Mortgage Association	2.000.000	0,88 %	02.08.2019	1.967.768	0,11 %
US Treasury Note	1.950.000	1,38 %	31.12.2018	1.941.469	0,11 %
US Treasury Note	1.932.000	1,25 %	15.11.2018	1.922.944	0,11 %
US Treasury Note	1.900.000	2,00 %	31.05.2021	1.896.438	0,11 %
US Treasury Bond	1.369.000	5,00 %	15.05.2037	1.877.027	0,11 %
US Treasury Note	1.875.000	1,13 %	31.12.2019	1.847.168	0,10 %
US Treasury Bond	1.664.000	8,13 %	15.08.2019	1.828.320	0,10 %
US Treasury Note	1.855.000	1,63 %	15.08.2022	1.810.654	0,10 %
US Treasury Note	1.800.000	1,00 %	15.03.2019	1.782.000	0,10 %
US Treasury Note	1.675.000	1,75 %	31.10.2018	1.674.738	0,09 %
Federal National Mortgage Association	1.775.000	1,88 %	24.09.2026	1.674.473	0,09 %
US Treasury Note	1.648.000	1,50 %	31.12.2018	1.642.850	0,09 %
Federal Home Loan Banks	1.600.000	1,13 %	21.06.2019	1.582.502	0,09 %
Federal National Mortgage Association	1.125.000	6,63 %	15.11.2030	1.582.114	0,09 %
US Treasury Bond	1.300.000	6,25 %	15.08.2023	1.573.812	0,09 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	1.555.000	1,38 %	01.05.2020	1.533.003	0,09 %
US Treasury Note	1.500.000	1,75 %	30.09.2019	1.496.719	0,08 %
Federal Home Loan Banks	1.500.000	1,88 %	29.11.2021	1.484.107	0,08 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	1.500.000	1,63 %	29.09.2020	1.483.905	0,08 %
US Treasury Bond	1.250.000	8,75 %	15.08.2020	1.465.234	0,08 %
US Treasury Note	1.400.000	1,25 %	31.10.2019	1.384.250	0,08 %
Federal National Mortgage Association	1.376.000	1,13 %	14.12.2018	1.367.070	0,08 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	1.400.000	1,13 %	12.08.2021	1.350.915	0,08 %
US Treasury Bond	1.000.000	6,38 %	15.08.2027	1.341.250	0,08 %
US Treasury Bond	1.000.000	4,75 %	15.02.2037	1.331.875	0,08 %
US Treasury Bond	1.000.000	7,50 %	15.11.2024	1.327.656	0,08 %
US Treasury Bond	1.000.000	6,88 %	15.08.2025	1.315.156	0,07 %
Federal National Mortgage Association	1.275.000	2,00 %	05.10.2022	1.259.273	0,07 %
US Treasury Bond	1.075.000	8,75 %	15.05.2020	1.245.992	0,07 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	1.135.000	0,88 %	19.07.2019	1.117.292	0,06 %
US Treasury Bond	750.000	6,13 %	15.08.2029	1.029.023	0,06 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
US Treasury Note	1.025.000	1,25 %	30.11.2018	1.019.875	0,06 %
Federal Home Loan Banks	1.000.000	1,63 %	14.06.2019	996.323	0,06 %
US Treasury Note	1.000.000	1,50 %	31.03.2019	995.625	0,06 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	710.000	6,25 %	15.07.2032	994.147	0,06 %
Federal National Mortgage Association	1.000.000	1,00 %	26.02.2019	990.559	0,06 %
Federal National Mortgage Association	1.000.000	1,25 %	06.05.2021	972.712	0,06 %
Federal National Mortgage Association	1.000.000	1,25 %	17.08.2021	969.146	0,06 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	940.000	1,25 %	01.08.2019	930.339	0,05 %
US Treasury Bond	900.000	9,13 %	15.05.2018	924.187	0,05 %
Federal Home Loan Banks	925.000	1,38 %	18.02.2021	905.649	0,05 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	875.000	1,25 %	02.10.2019	864.758	0,05 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	600.000	6,75 %	15.03.2031	856.395	0,05 %
Federal National Mortgage Association	800.000	2,63 %	06.09.2024	810.038	0,05 %
US Treasury Note	800.000	1,25 %	30.06.2019	792.875	0,05 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	795.000	1,38 %	20.04.2020	784.178	0,04 %
US Treasury Note	776.000	2,00 %	15.02.2022	772.120	0,04 %
Tennessee Valley Authority	560.000	5,25 %	15.09.2039	751.947	0,04 %
Federal National Mortgage Association	750.000	1,38 %	26.02.2021	734.202	0,04 %
US Treasury Note	734.000	1,38 %	30.09.2019	727.692	0,04 %
Federal Home Loan Banks	750.000	1,13 %	14.07.2021	724.501	0,04 %
Federal National Mortgage Association	700.000	1,63 %	21.01.2020	695.260	0,04 %
US Treasury Note	675.000	1,13 %	31.05.2019	668.250	0,04 %
Federal National Mortgage Association	650.000	2,13 %	24.04.2026	629.682	0,04 %
US Treasury Bond	525.000	8,13 %	15.05.2021	627.949	0,04 %
US Treasury Note	625.000	1,00 %	30.11.2019	614.746	0,03 %
US Treasury Note	607.000	1,25 %	30.04.2019	602.163	0,03 %
Federal National Mortgage Association	600.000	1,75 %	26.11.2019	597.846	0,03 %
US Treasury Note	600.000	1,63 %	15.03.2020	596.438	0,03 %
Federal Home Loan Banks	600.000	1,38 %	28.05.2019	595.789	0,03 %
Federal National Mortgage Association	400.000	7,25 %	15.05.2030	583.182	0,03 %
Federal National Mortgage Association	400.000	5,63 %	15.07.2037	558.473	0,03 %
Federal National Mortgage Association	570.000	0,00 %	09.10.2019	549.575	0,03 %
US Treasury Bond	400.000	6,50 %	15.11.2026	530.938	0,03 %
Tennessee Valley Authority	375.000	5,38 %	01.04.2056	528.303	0,03 %
US Treasury Bond	386.000	6,13 %	15.11.2027	511.329	0,03 %
Tennessee Valley Authority	500.000	2,88 %	01.02.2027	508.838	0,03 %
US Treasury Note	499.000	2,13 %	31.08.2020	501.339	0,03 %
Federal Home Loan Banks	500.000	1,00 %	26.09.2019	492.166	0,03 %
Federal Home Loan Banks	500.000	0,88 %	05.08.2019	491.900	0,03 %
Federal National Mortgage Association	500.000	1,00 %	24.10.2019	491.734	0,03 %
US Treasury Note	475.000	1,88 %	31.03.2022	469.582	0,03 %
Federal Home Loan Banks	475.000	1,38 %	28.09.2020	466.761	0,03 %
Federal Home Loan Banks	400.000	2,88 %	14.06.2024	410.562	0,02 %
Federal National Mortgage Association	400.000	1,75 %	12.09.2019	398.848	0,02 %
Federal Home Loan Banks	375.000	4,13 %	13.03.2020	392.260	0,02 %
Federal National Mortgage Association	400.000	1,38 %	07.10.2021	388.860	0,02 %
Federal National Mortgage Association	375.000	1,88 %	05.04.2022	369.846	0,02 %
Federal National Mortgage Association	250.000	7,13 %	15.01.2030	359.054	0,02 %
Iraq Government AID Bond	350.000	2,15 %	18.01.2022	348.846	0,02 %
Federal National Mortgage Association	350.000	1,88 %	28.12.2020	348.143	0,02 %
Federal National Mortgage Association	325.000	1,75 %	20.06.2019	324.377	0,02 %
Tennessee Valley Authority	250.000	4,63 %	15.09.2060	314.463	0,02 %
Federal Home Loan Banks	225.000	5,50 %	15.07.2036	308.275	0,02 %
US Treasury Bond	250.000	7,25 %	15.08.2022	305.937	0,02 %
Tennessee Valley Authority	200.000	6,15 %	15.01.2038	293.058	0,02 %
Tennessee Valley Authority	200.000	7,13 %	01.05.2030	287.208	0,02 %
Tennessee Valley Authority	200.000	5,88 %	01.04.2036	279.307	0,02 %
US Treasury Bond	200.000	6,75 %	15.08.2026	268.156	0,02 %
Federal Home Loan Banks	250.000	5,13 %	15.08.2019	262.739	0,01 %
US Treasury Note	259.000	1,00 %	30.06.2019	255.803	0,01 %
Federal Home Loan Banks	250.000	2,25 %	11.06.2021	251.163	0,01 %
US Treasury Bond	200.000	7,63 %	15.11.2022	250.312	0,01 %
Tunisia Government AID Bonds	250.000	1,42 %	05.08.2021	241.260	0,01 %
Hashemite Kingdom of Jordan Government AID Bond	200.000	2,58 %	30.06.2022	200.958	0,01 %
Federal National Mortgage Association	150.000	6,25 %	15.05.2029	200.011	0,01 %
Federal Farm Credit Banks	200.000	1,68 %	13.10.2020	198.067	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Tennessee Valley Authority	150.000	4,88 %	15.01.2048	194.675	0,01 %
Private Export Funding Corp.	175.000	4,30 %	15.12.2021	188.178	0,01 %
Tennessee Valley Authority	125.000	4,25 %	15.09.2065	147.195	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	100.000	3,75 %	27.03.2019	102.306	0,01 %
Private Export Funding Corp.	100.000	2,25 %	15.03.2020	100.386	0,01 %
Federal National Mortgage Association	100.000	1,88 %	19.02.2019	100.046	0,01 %
Tennessee Valley Authority	80.000	2,88 %	15.09.2024	81.788	0,00 %
US Treasury Bond	60.000	7,63 %	15.02.2025	80.775	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	56.000	6,75 %	15.09.2029	77.842	0,00 %
Federal Home Loan Banks	75.000	3,38 %	12.06.2020	77.450	0,00 %
Tennessee Valley Authority	50.000	5,50 %	15.06.2038	68.317	0,00 %
Federal Farm Credit Banks	50.000	3,50 %	20.12.2023	53.097	0,00 %
Private Export Funding Corp.	50.000	3,55 %	15.01.2024	53.067	0,01 %
Tennessee Valley Authority	50.000	3,88 %	15.02.2021	52.620	0,00 %
Private Export Funding Corp.	50.000	2,45 %	15.07.2024	49.760	0,00 %
Tennessee Valley Authority	35.000	6,75 %	01.11.2025	45.102	0,00 %
Private Export Funding Corp.	25.000	4,38 %	15.03.2019	25.708	0,00 %
Private Export Funding Corp.	25.000	2,80 %	15.05.2022	25.459	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	25.000	1,75 %	30.05.2019	24.954	0,00 %
Federal Home Loan Banks	25.000	1,88 %	13.03.2020	24.947	0,00 %
Private Export Funding Corp.	25.000	1,45 %	15.08.2019	24.769	0,00 %
Private Export Funding Corp.	25.000	2,05 %	15.11.2022	24.618	0,00 %
Tennessee Valley Authority	25.000	1,88 %	15.08.2022	24.575	0,00 %
Petroleos Mexicanos	18.750	2,38 %	15.04.2025	18.640	0,00 %
Petroleos Mexicanos	16.250	2,29 %	15.02.2024	16.193	0,00 %
				1.755.945.586	99,11 %
Nicht-US-Bonds					
Israel 0,02 % (2016: 0,03 %)					
Israel Government AID Bond	325.000	5,50 %	26.04.2024	382.022	0,02 %
				382.022	0,02 %
Jordanien 0,01 % (2016: 0,04 %)					
Hashemite Kingdom of Jordan Government AID Bond	200.000	1,95 %	23.06.2019	199.700	0,01 %
Hashemite Kingdom of Jordan Government AID Bond	75.000	2,50 %	30.10.2020	75.497	0,00 %
				275.197	0,01 %
Ukraine 0,02 % (2016: 0,02 %)					
Ukraine Government AID Bonds	200.000	1,85 %	29.05.2020	198.317	0,01 %
Ukraine Government AID Bonds	175.000	1,47 %	29.09.2021	169.713	0,01 %
				368.030	0,02 %
Summe Anleihen				1.756.970.835	99,16 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				1.756.970.835	99,16 %

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) % des Gesamt- US-Dollar (\$) nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente						
Offene Devisenterminkontrakte zu Absicherungszwecken auf Ebene der Anteilsklasse 0,03 % (2016: (0,25 %))						
EUR	157.688.039	USD	(188.432.476)	BNP Paribas	03.01.2018	919.355 0,05 %
EUR	20.829.618	USD	(24.736.783)	BNP Paribas	03.01.2018	275.426 0,02 %
GBP	5.642.583	USD	(7.545.953)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	87.050 0,01 %
GBP	7.459.761	USD	(10.013.461)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	77.729 0,01 %
GBP	4.353.108	USD	(5.841.053)	BNP Paribas	03.01.2018	47.613 0,00 %
GBP	2.278.113	USD	(3.040.864)	BNP Paribas	03.01.2018	40.853 0,00 %
GBP	1.965.258	USD	(2.628.081)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	30.422 0,00 %
EUR	178.103.814	USD	(214.243.749)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	30.398 0,00 %
GBP	3.303.668	USD	(4.442.773)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	26.264 0,00 %
GBP	413.825.416	USD	(560.370.514)	JP Morgan Chase	02.02.2018	25.309 0,00 %
GBP	1.286.159	USD	(1.715.952)	BNP Paribas	03.01.2018	23.899 0,00 %
GBP	1.457.087	USD	(1.949.029)	BNP Paribas	03.01.2018	22.045 0,00 %
EUR	1.530.093	USD	(1.818.128)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	19.207 0,00 %
GBP	1.350.920	USD	(1.809.543)	BNP Paribas	03.01.2018	17.914 0,00 %
EUR	2.554.830	USD	(3.052.912)	BNP Paribas	03.01.2018	14.928 0,00 %
EUR	1.117.026	USD	(1.334.544)	BNP Paribas	03.01.2018	6.781 0,00 %
GBP	668.339	USD	(898.158)	BNP Paribas	03.01.2018	5.937 0,00 %

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf- betrag)	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
GBP	527.716	USD	(708.739)	BNP Paribas	03.01.2018	5.129	0,00 %
GBP	257.674	USD	(344.910)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	3.659	0,00 %
GBP	243.270	USD	(325.637)	BNP Paribas	03.01.2018	3.447	0,00 %
GBP	297.825	USD	(400.161)	BNP Paribas	03.01.2018	2.721	0,00 %
EUR	203.995	USD	(243.003)	BNP Paribas	03.01.2018	1.954	0,00 %
EUR	69.895	USD	(82.586)	BNP Paribas	03.01.2018	1.344	0,00 %
EUR	74.956	USD	(88.875)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	1.132	0,00 %
GBP	190.092	USD	(256.170)	BNP Paribas	03.01.2018	977	0,00 %
GBP	271.623	USD	(366.573)	BNP Paribas	03.01.2018	865	0,00 %
EUR	31.990	USD	(37.699)	BNP Paribas	03.01.2018	714	0,00 %
GBP	291.185	USD	(393.847)	UBS	02.02.2018	471	0,00 %
EUR	1.058.764	USD	(1.273.587)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	197	0,00 %
USD	236.813	GBP	(174.916)	BNP Paribas	03.01.2018	196	0,00 %
GBP	805.803	USD	(1.091.025)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	181	0,00 %
EUR	209.204	USD	(251.562)	UBS	02.02.2018	129	0,00 %
GBP	106.566	USD	(144.050)	BNP Paribas	03.01.2018	107	0,00 %
USD	560.370.514	GBP	(414.245.436)	JP Morgan Chase	03.01.2018	82	0,00 %
GBP	5.753	USD	(7.704)	BNP Paribas	03.01.2018	78	0,00 %
EUR	59.947	USD	(72.110)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	11	0,00 %
GBP	38.911	USD	(52.684)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	9	0,00 %
EUR	157	USD	(187)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	2	0,00 %
USD	1.182.297	EUR	(984.591)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	—	0,00 %
GBP	462.369	USD	(625.470)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	—	0,00 %
USD	5.998	EUR	(5.024)	BNP Paribas	03.01.2018	(35)	(0,00 %)
USD	214.243.749	EUR	(178.417.512)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(38)	(0,00 %)
USD	8.912	EUR	(7.553)	BNP Paribas	03.01.2018	(158)	(0,00 %)
GBP	163.534	USD	(221.668)	BNP Paribas	03.01.2018	(448)	(0,00 %)
USD	98.060	EUR	(82.151)	BNP Paribas	03.01.2018	(587)	(0,00 %)
USD	890.411	GBP	(658.803)	BNP Paribas	03.01.2018	(785)	(0,00 %)
USD	39.154	EUR	(33.308)	BNP Paribas	03.01.2018	(842)	(0,00 %)
USD	73.058	EUR	(61.807)	BNP Paribas	03.01.2018	(1.159)	(0,00 %)
USD	319.622	EUR	(267.476)	BNP Paribas	03.01.2018	(1.563)	(0,00 %)
USD	328.175	EUR	(275.222)	BNP Paribas	03.01.2018	(2.312)	(0,00 %)
USD	387.629	GBP	(289.217)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(3.609)	(0,00 %)
USD	232.849	EUR	(197.714)	BNP Paribas	03.01.2018	(4.567)	(0,00 %)
GBP	2.226.348	USD	(3.016.456)	BNP Paribas	03.01.2018	(4.765)	(0,00 %)
USD	514.740	EUR	(436.143)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(8.980)	(0,00 %)
USD	805.344	EUR	(680.649)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(11.980)	(0,00 %)
GBP	5.268.183	USD	(7.140.638)	JP Morgan Chase	03.01.2018	(14.104)	(0,00 %)
USD	3.157.532	EUR	(2.651.445)	BNP Paribas	03.01.2018	(26.324)	(0,00 %)
GBP	375.582.421	USD	(509.067.794)	BNP Paribas	03.01.2018	(998.749)	(0,06 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente						613.530	0,03 %
						Marktwert US-Dollars (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva						14.351.049	0,81 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)						1.771.935.414	100,00 %
						% des Gesamt- US-Dollar (\$)	nettovermögens
Analyse des Gesamtvermögens							
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind						1.613.771.224	91,08 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						143.199.611	8,08 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente						613.530	0,03 %
(e) Sonstige Aktiva und Passiva						14.351.049	0,81 %
Gesamtvermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)						1.771.935.414	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Kapital US-Dollar (\$)	Kosten US-Dollar (\$)		Kapital US-Dollar (\$)	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
US Treasury Note 1,75 % 30.11.2019	27.250.000	27.198.262	US Treasury Note 0,75 % 30.4.2018	19.489.000	19.416.993
US Treasury Note 1,50 % 15.8.2020	25.220.000	25.215.450	US Treasury Note 1,38 % 15.12.2019	18.700.000	18.655.168
US Treasury Note 2,25 % 31.1.2024	24.150.000	24.162.837	US Treasury Note 1,00 % 30.11.2018	18.500.000	18.446.895
US Treasury Note 1,63 % 31.8.2022	22.880.000	22.705.256	US Treasury Note 1,63 % 15.3.2020	14.465.000	14.544.264
US Treasury Note 1,50 % 15.7.2020	21.731.000	21.712.223	US Treasury Note 1,88 % 31.1.2022	14.000.000	14.028.438
US Treasury Note 2,25 % 15.8.2027	21.348.000	21.304.685	US Treasury Note 1,75 % 30.11.2021	13.300.000	13.215.711
US Treasury Note 2,38 % 15.5.2027	20.525.000	20.718.206	US Treasury Note 1,38 % 31.5.2020	12.000.000	11.951.719
US Treasury Note 2,25 % 15.2.2027	20.800.000	20.600.900	US Treasury Note 1,88 % 28.2.2022	11.900.000	11.921.543
US Treasury Note 2,00 % 31.12.2021	20.500.000	20.517.852	US Treasury Note 2,00 % 31.12.2021	11.320.000	11.397.046
US Treasury Note 1,38 % 15.2.2020	18.375.000	18.293.736	US Treasury Note 0,75 % 31.1.2018	11.411.000	11.395.479
US Treasury Note 1,88 % 31.1.2022	16.700.000	16.648.802	US Treasury Note 0,75 % 15.4.2018	11.100.000	11.061.691
US Treasury Note 1,50 % 15.6.2020	16.315.000	16.303.716	US Treasury Note 1,50 % 15.8.2020	10.980.000	10.925.667
US Treasury Note 1,38 % 15.9.2020	15.750.000	15.638.309	US Treasury Bond 2,50 % 15.2.2045	12.000.000	10.865.156
US Treasury Bond 3,00 % 15.2.2047	14.950.000	15.200.872	US Treasury Note 2,25 % 31.1.2024	10.750.000	10.854.043
US Treasury Note 1,63 % 15.3.2020	15.065.000	15.111.744	US Treasury Note 1,38 % 15.2.2020	10.315.000	10.204.081
US Treasury Note 1,75 % 31.5.2022	15.025.000	15.009.128	US Treasury Note 1,63 % 30.4.2019	10.000.000	10.062.109
US Treasury Note 2,13 % 30.11.2024	15.125.000	14.943.975	US Treasury Note 1,63 % 30.4.2023	10.300.000	10.053.664
US Treasury Note 0,75 % 30.9.2018	15.000.000	14.896.289	US Treasury Note 0,75 % 31.10.2018	10.000.000	9.918.750
US Treasury Note 1,50 % 15.5.2020	14.800.000	14.810.176	US Treasury Note 3,50 % 15.5.2020	9.000.000	9.528.750
US Treasury Note 2,13 % 31.7.2024	14.500.000	14.579.250	US Treasury Note 2,13 % 30.11.2023	9.300.000	9.261.855
US Treasury Note 1,50 % 15.4.2020	14.500.000	14.507.070	US Treasury Note 1,38 % 30.9.2018	8.795.000	8.811.834
US Treasury Note 1,88 % 28.2.2022	14.500.000	14.463.512	US Treasury Bond 4,50 % 15.8.2039	6.550.000	8.344.678
US Treasury Bond 3,00 % 15.5.2047	13.741.000	14.224.074	US Treasury Note 2,25 % 15.2.2027	8.300.000	8.274.271
US Treasury Note 2,13 % 30.9.2024	14.010.000	13.952.095	US Treasury Note 0,75 % 28.2.2018	7.290.000	7.277.470
US Treasury Note 0,75 % 31.10.2018	14.000.000	13.893.906	US Treasury Note 1,50 % 31.8.2018	7.260.000	7.267.090
US Treasury Bond 2,75 % 15.8.2047	13.880.000	13.736.429	US Treasury Note 1,25 % 31.3.2019	7.000.000	7.000.758
US Treasury Note 2,13 % 29.2.2024	13.450.000	13.346.544	US Treasury Note 1,00 % 31.5.2018	6.999.000	6.986.424
US Treasury Note 1,38 % 31.5.2020	13.200.000	13.113.516	US Treasury Note 0,75 % 30.9.2018	7.000.000	6.949.883
US Treasury Note 1,88 % 15.12.2020	12.600.000	12.567.984	US Treasury Note 2,00 % 15.11.2026	7.105.000	6.856.177
US Treasury Note 2,25 % 15.11.2027	12.650.000	12.474.658	US Treasury Note 1,00 % 15.2.2018	6.700.000	6.707.125
US Treasury Note 1,88 % 31.7.2022	12.100.000	12.134.430	US Treasury Note 2,13 % 31.12.2021	6.625.000	6.696.904
US Treasury Note 2,00 % 30.11.2022	12.000.000	11.969.023	US Treasury Note 0,88 % 31.5.2018	6.561.000	6.539.728
US Treasury Note 2,00 % 31.5.2024	11.965.000	11.950.619	US Treasury Note 2,13 % 31.3.2024	6.400.000	6.419.141
US Treasury Note 1,75 % 30.6.2022	12.000.000	11.928.340	US Treasury Note 1,88 % 31.3.2022	6.375.000	6.392.080
US Treasury Note 1,88 % 30.9.2022	11.350.000	11.313.474	US Treasury Note 1,38 % 15.9.2020	6.354.000	6.287.869
US Treasury Note 1,25 % 31.8.2019	11.000.000	10.987.969	US Treasury Note 1,25 % 31.1.2020	6.225.000	6.186.732
US Treasury Note 1,75 % 30.9.2022	10.500.000	10.384.102			

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.756.970.835	1.337.944.520
Derivative Finanzinstrumente	1.694.535	345.932
Barmittel und liquide Vermögenswerte	10.783.976	16.622.916
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	9.388.586	6.522.060
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	4.492.961	28.469.855
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	9.943.716	7.127.518
Summe Umlaufvermögen	1.793.274.609	1.397.032.801
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	1.081.005	3.657.528
Überziehungskredit	—	46.654
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	9.477	53.073
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	12.927.523	46.346.614
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	7.004.722	2.615.349
Zahlbare Verwaltungsgebühren	316.468	216.538
Summe kurzfristige Passiva	21.339.195	52.935.756
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	1.771.935.414	1.344.097.045

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	886.981.396	932.693.024	517.912.110
Anzahl der umlaufenden Anteile	4.839.862	5.199.077	2.910.702
Nettoinventarwert je Anteil	183,27	179,40	177,93
USD-Anlegeranteile (\$)			
Nettovermögen	78.431.731	78.976.040	93.927.025
Anzahl der umlaufenden Anteile	434.541	446.772	535.454
Nettoinventarwert je Anteil	180,49	176,77	175,42
Institutionelle Plus USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	29.357.492	7.692.595	1.288.989
Anzahl der umlaufenden Anteile	270.564	72.498	12.260
Nettoinventarwert je Anteil	108,50	106,11	105,14
GBP-Anlegeranteile (£)			
Gegenwert in US (\$)	6.695	—	—
Nettovermögen	4.949	—	—
Anzahl der umlaufenden Anteile	50	—	—
Nettoinventarwert je Anteil	98,98	—	—
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR (€)			
Gegenwert in US (\$)	215.693.631	97.398.051	—
Nettovermögen	179.624.944	92.342.311	—
Anzahl der umlaufenden Anteile	1.854.204	955.900	—
Nettoinventarwert je Anteil	96,87	96,60	—
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in US (\$)	561.458.489	227.337.335	118.766.116
Nettovermögen	415.049.720	183.981.989	80.579.495
Anzahl der umlaufenden Anteile	3.903.130	1.748.811	770.397
Nettoinventarwert je Anteil	106,34	105,20	104,59
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in EUR (€)			
Gegenwert in US (\$)	5.980	—	—
Nettovermögen	4.980	—	—
Anzahl der umlaufenden Anteile	50	—	—
Nettoinventarwert je Anteil	99,60	—	—

1 Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	25.482.318	16.876.393
Verschiedene Erträge	561	26
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	46.114.203	(58.267.994)
Summe Anlageerträge/(-verluste)	71.597.082	(41.391.575)
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	3.017.547	2.255.731
Sonstige Aufwendungen	21	—
Summe Aufwendungen	3.017.568	2.255.731
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	19	4.968
Summe Finanzierungskosten	19	4.968
Nettoanlageerträge/(-verluste)	68.579.495	(43.652.274)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	68.579.495	(43.652.274)

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer
gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	68.579.495	(43.652.274)
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	942.685.510	1.110.987.319
Rücknahmen	(583.426.636)	(455.132.240)
Summe Kapitalgeschäfte	359.258.874	655.855.079
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	427.838.369	612.202.805
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	1.344.097.045	731.894.240
Zum Jahresende	1.771.935.414	1.344.097.045

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

U.S. Investment Grade Credit Index Fund

Verwaltet durch The Vanguard Group, Inc.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds strebt eine Rendite an, die der Wertentwicklung des Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Credit Float Adjusted Bond Index entspricht, eines marktgewichteten Index, der das gesamte Spektrum der auf US-Dollar lautenden festverzinslichen Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating und Laufzeiten von mehr als einem Jahr widerspiegeln soll, ausgenommen US-Schatztitel, regierungsnahe US-Titel und verbrieft Wertpapiere.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	6.662	11.234
Rendite auf Endfälligkeit	3,1 % ³	3,2 %
Durchschnittlicher Kupon	3,9 %	3,8 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	9,5 Jahre	9,5 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	A2	A2
Durchschnittliche Duration	6,6 Jahre	6,6 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Institutionelle Anteile	0,25 %	
Anlegeranteile	0,30 %	
Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,10 %	
Thesaurierende Anteile	0,10 %	
Kurzfristige Reserven	0,6 %	—

Volatilitätskennzahlen

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
R ²	0,99	1,00
Beta	1,04	1,00

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

Industriegüter	42,2 %
Finanzinstitute	24,6
Agency-Titel	10,3
Versorger	5,0
Staatlich	4,8
Commercial Mortgage-Backed Securities	4,1
Supranationale Anleihen	3,9
Forderungsbesicherte Wertpapiere	1,9
Municipals	1,7
Lokale Behörde	1,2
Barmittel	0,2
Treasury-Titel	0,1

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	13,9 %
Aa	10,6
A	34,6
Baa	40,8
nicht eingestuft	0,1

Diversifizierung nach effektiver Fälligkeit¹ (% des Portfolios)

Unter 5 Jahren	42,9 %
5-10 Jahre	30,7
Mehr als 10 Jahre	26,4

Anlagefokus

Durchschnittliche Fälligkeit

Durchschnittliche Fälligkeit	Kurz	Mittel	Lang
Kreditqualität Staats-/ Agency-Titel			
Unternehmensanleihen mit Anlagequalität			
Ohne Anlagequalität			

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität, die Aufteilung nach Kreditqualität und die Aufteilung nach effektiver Fälligkeit sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Credit Float Adjusted Bond Index.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

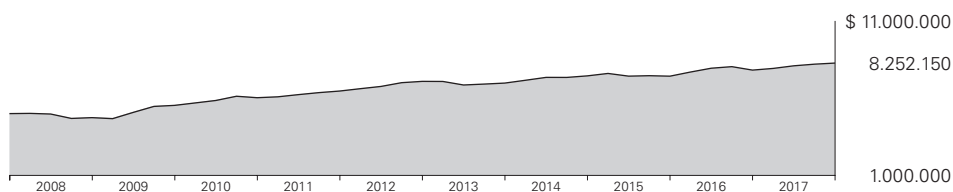
U.S. Investment Grade Credit Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Credit Float Adjusted Bond Index

In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
■ Institutionelle Anteile	5,84 %	3,10 %	5,14 %	\$ 8.252.150
— Benchmark ¹	5,83	3,14	5,16	8.271.270

	Ein Jahr		Endwert einer Anlage von \$ 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ²	
Anlegeranteile	5,78 %	3,34 %	\$ 109.674
Benchmark	5,83	3,45	109.989

	Ein Jahr		Endwert einer Anlage von \$ 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ²	
Institutionelle Plus-Anteile	6,00 %	4,41 %	\$ 238.393.000
Benchmark	5,83	4,35	237.840.772

	Ein Jahr		Endwert einer Anlage von \$ 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ²	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	6,00 %	4,71 %	\$ 222.002.416
Benchmark	5,83	4,63	221.608.370

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,01 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,05 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,17 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile und institutionelle Plus-Ertragsanteile.³

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,50 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

1 Bloomberg Barclays Global Aggregate U.S. Credit Index bis 30. Juni 2010; danach Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Credit Float Adjusted Bond Index.

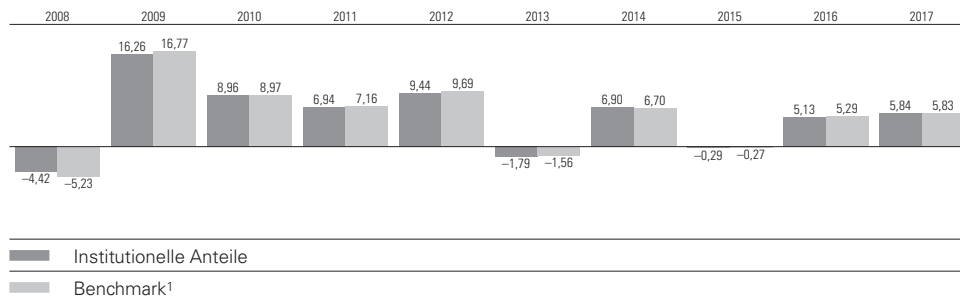
2 Für Anlegeranteile, 10. März 2015; für institutionelle Plus-Anteile, 6. Dezember 2013; für institutionelle Plus-Ertragsanteile, 24. September 2015.

3 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

U.S. Investment Grade Credit Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Credit Float Adjusted Bond Index

In US-Dollar

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017

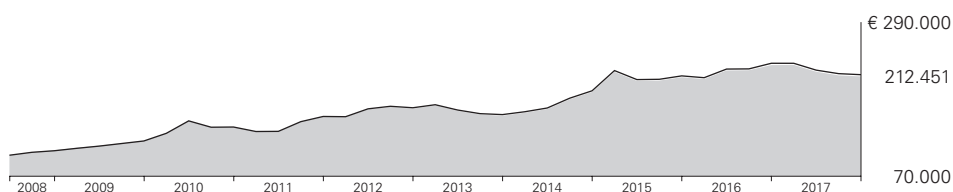


1 Bloomberg Barclays Global Aggregate U.S. Credit Index bis 30. Juni 2010; danach Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Credit Float Adjusted Bond Index.

U.S. Investment Grade Credit Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Credit Float Adjusted Bond Index

In Euro

Kumulative Wertentwicklung: 6. August 2008–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. € 100.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von € 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Seit Auflegung ¹	
■ Anlegeranteile	-7,08 %	4,99 %	8,34 %	€ 212.451
— Benchmark ²	-7,04	5,09	8,48	214.959

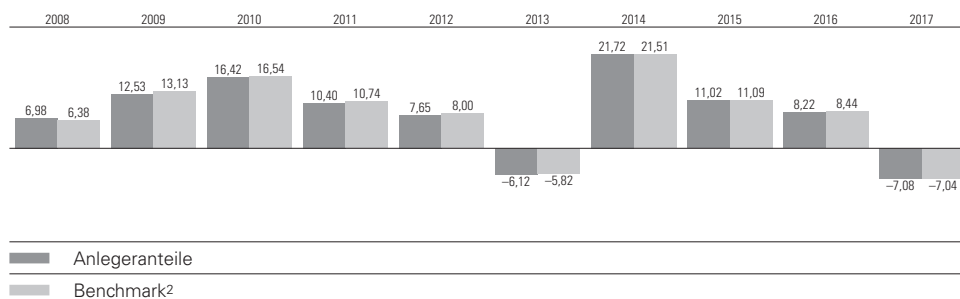
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von € 5.000.000
Benchmark	-7,04	-0,69	4.903.863

	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von € 200.000.000
Benchmark	-7,04	7,69	269.627.902

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,04 Prozentpunkte für institutionelle Anteile, 0,02 Prozentpunkte für Anlegeranteile und 0,14 Prozentpunkte für institutionelle Plus-Anteile.³

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,50 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 6. August 2008–31. Dezember 2017



1 Für Anlegeranteile, 6. August 2008; für institutionelle Anteile, 10. März 2015; für institutionelle Plus-Anteile, 19. Dezember 2013.
 2 Bloomberg Barclays Global Aggregate U.S. Credit Index bis 30. Juni 2010; danach Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Credit Float Adjusted Bond Index.
 3 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

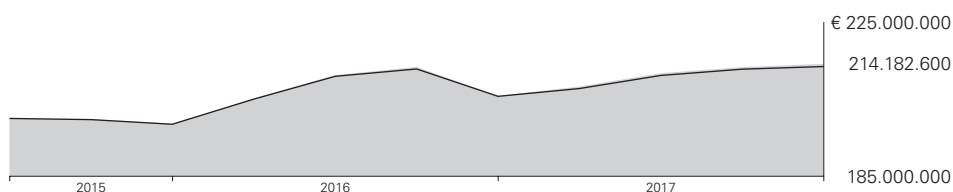
U.S. Investment Grade Credit Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Credit Float Adjusted Bond Index Euro-Hedged

Abgesichert in Euro

Kumulative Wertentwicklung: 24. September 2015–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. € 200.000.000

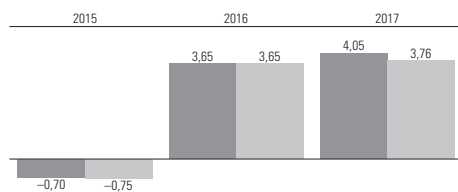


	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenden Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
■ Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in Euro	4,05 %	3,07 %	€ 214.182.600
— Benchmark	3,76	2,92	213.472.252

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,29 Prozentpunkte für institutionelle in Euro abgesicherte Plus-Anteile.²

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,50 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 24. September 2015–31. Dezember 2017



■ Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in Euro
■ Benchmark

1 24. September 2015

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

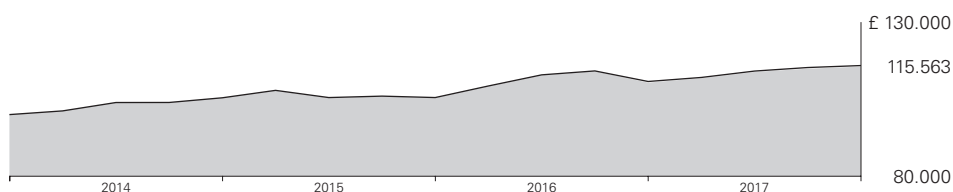
U.S. Investment Grade Credit Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Credit Float Adjusted Bond Index GBP-Hedged

Abgesichert in GBP

Kumulative Wertentwicklung: 31. Januar 2014–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. £ 100.000

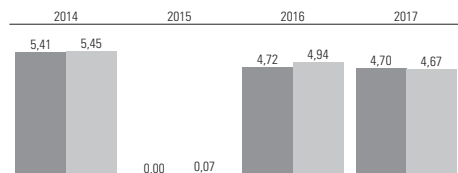


	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenden Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von £ 100.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP	4,70 %	3,76 %	£ 115.563
Benchmark	4,67	3,84	115.910
<hr/>			
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	4,93 %	1,17 %	£ 203.069.800
Benchmark	4,67	1,20	203.157.111
<hr/>			
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von £ 200.000.000
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	4,92 %	1,16 %	£ 203.060.251
Benchmark	4,67	1,20	203.157.111

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,03 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte Thesaurierungsanteile, 0,26 Prozentpunkte für institutionelle in GBP abgesicherte Plus-Thesaurierungsanteile und 0,25 Prozentpunkte für institutionelle in GBP abgesicherte Plus-Ertragsanteile.²

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,50 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 31. Januar 2014–31. Dezember 2017



Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP
Benchmark

1 Für thesaurierende GBP-Anteile, 31. Januar 2014; für institutionelle Plus-Thesaurierungs- und institutionelle Plus-Ertragsanteile, 8. September 2016.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

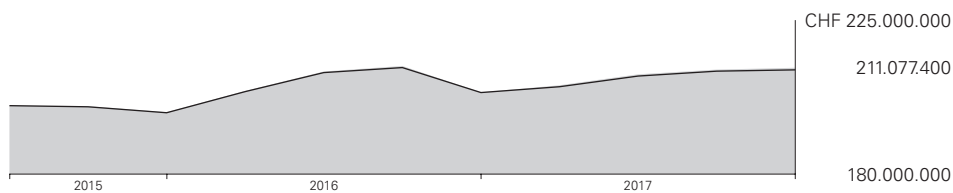
U.S. Investment Grade Credit Index Fund

Benchmark: Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Credit Float Adjusted Bond Index CHF-Hedged

Abgesichert in Schweizer Franken

Kumulative Wertentwicklung: 24. September 2015–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. CHF 200.000.000

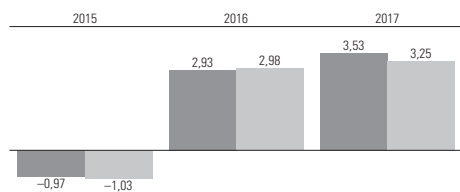


	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenden Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von CHF 200.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
■ Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in CHF	3,53 %	2,40 %	CHF 211.077.400
— Benchmark	3,25	2,27	210.458.143

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,28 Prozentpunkte für institutionelle in CHF abgesicherte Plus-Anteile.²

Die obigen Zahlen zur Wertentwicklung des Fonds wurden bis 2. Oktober 2017 um die Standard-Verwässerungsgebühr auf Zeichnungen von 0,50 % bereinigt. Nach diesem Datum wurde das Swing Pricing eingeführt.

Summe Anlagerenditen (%): 24. September 2015–31. Dezember 2017



■ Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in CHF
■ Benchmark

¹ 24. September 2015.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 99,00 % (2016: 99,12 %)					
USA 59,91 % (2016: 59,03 %)					
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	2.585.000	4,90 %	01.02.2046	2.992.673	0,15 %
GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	2.720.000	4,42 %	15.11.2035	2.942.654	0,15 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. ¹	2.685.000	3,65 %	01.02.2026	2.769.497	0,14 %
Bank of America Corp. [^]	2.563.000	3,00 %	20.12.2023	2.564.648	0,13 %
Bank of America Corp. [^]	2.393.000	3,42 %	20.12.2028	2.387.877	0,12 %
American Express Credit Account Master Trust	2.000.000	1,77 %	15.11.2022	1.982.572	0,10 %
State of Illinois	1.835.000	5,10 %	01.06.2033	1.831.954	0,09 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	1.780.000	2,65 %	01.02.2021	1.788.649	0,09 %
Verizon Communications, Inc.	1.600.000	5,15 %	15.09.2023	1.779.402	0,09 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015	1.620.000	3,04 %	15.10.2048	1.641.060	0,08 %
Medtronic, Inc.	1.325.000	4,63 %	15.03.2045	1.538.049	0,08 %
Verizon Communications, Inc.	1.433.000	5,01 %	21.08.2054	1.466.598	0,07 %
Medtronic, Inc.	1.400.000	3,50 %	15.03.2025	1.454.701	0,07 %
Wells Fargo & Co. ¹	1.444.000	2,50 %	04.03.2021	1.443.443	0,07 %
Goldman Sachs Group, Inc.	1.300.000	5,25 %	27.07.2021	1.409.110	0,07 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. ¹	1.375.000	3,30 %	01.02.2023	1.405.694	0,07 %
Goldman Sachs Group, Inc.	1.015.000	6,75 %	01.10.2037	1.359.060	0,07 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	1.195.000	4,70 %	01.02.2036	1.340.735	0,07 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014	1.265.000	3,67 %	15.11.2047	1.317.080	0,07 %
Apple, Inc. ¹	1.325.000	2,40 %	03.05.2023	1.310.902	0,07 %
Intel Corp.	1.237.000	3,73 %	08.12.2047	1.289.025	0,06 %
Goldman Sachs Group, Inc.	1.225.000	3,00 %	26.04.2022	1.229.885	0,06 %
US Bancorp	1.225.000	2,20 %	25.04.2019	1.226.976	0,06 %
Verizon Communications, Inc.	1.279.000	4,67 %	15.03.2055	1.222.128	0,06 %
Amgen, Inc.	1.092.000	4,66 %	15.06.2051	1.221.866	0,06 %
Medtronic, Inc.	1.215.000	2,50 %	15.03.2020	1.221.492	0,06 %
JPMorgan Chase & Co.	1.215.000	2,25 %	23.01.2020	1.214.047	0,06 %
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2013	1.198.000	3,14 %	15.12.2047	1.213.263	0,06 %
Dell International LLC/EMC Corp.	1.100.000	6,02 %	15.06.2026	1.212.880	0,06 %
AT&T, Inc.	1.200.000	5,15 %	14.02.2050	1.206.750	0,06 %
Abbott Laboratories	1.055.000	4,90 %	30.11.2046	1.204.207	0,06 %
Verizon Communications, Inc.	1.133.000	5,01 %	15.04.2049	1.187.905	0,06 %
Bank of New York Mellon Corp.	1.190.000	2,05 %	03.05.2021	1.174.003	0,06 %
GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	1.167.000	2,34 %	15.11.2020	1.162.268	0,06 %
Morgan Stanley [^]	1.150.000	3,59 %	22.07.2028	1.158.005	0,06 %
AT&T, Inc.	1.150.000	3,90 %	14.08.2027	1.157.815	0,06 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015	1.100.000	3,79 %	15.09.2048	1.151.194	0,06 %
Citigroup, Inc.	1.150.000	3,20 %	21.10.2026	1.138.256	0,06 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	1.150.000	2,40 %	23.09.2021	1.130.083	0,06 %
Verizon Communications, Inc.	1.075.000	4,86 %	21.08.2046	1.120.615	0,06 %
JPMorgan Chase & Co.	1.110.000	1,85 %	22.03.2019	1.105.687	0,06 %
UnitedHealth Group, Inc. ¹	1.050.000	3,75 %	15.07.2025	1.104.880	0,06 %
Allergan Funding SCS	1.085.000	3,80 %	15.03.2025	1.100.232	0,06 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	1.118.000	3,88 %	15.01.2027	1.099.616	0,06 %
Apple, Inc.	940.000	4,65 %	23.02.2046	1.096.424	0,05 %
Microsoft Corp.	1.050.000	3,70 %	08.08.2046	1.094.767	0,05 %
Dell International LLC/EMC Corp.	1.050.000	4,42 %	15.06.2021	1.094.120	0,05 %
Wells Fargo & Co.	1.100.000	2,63 %	22.07.2022	1.093.577	0,05 %
Goldman Sachs Group, Inc.	1.050.000	4,25 %	21.10.2025	1.093.509	0,05 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	1.030.000	4,91 %	23.07.2025	1.089.449	0,05 %
Mondelez International Holdings Netherlands BV	1.100.000	1,63 %	28.10.2019	1.084.920	0,05 %
AT&T, Inc.	1.100.000	3,40 %	15.05.2025	1.082.731	0,05 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015	1.050.000	3,36 %	15.11.2048	1.079.809	0,05 %
Wells Fargo & Co.	1.075.000	2,13 %	22.04.2019	1.074.730	0,05 %
AT&T, Inc.	1.050.000	4,90 %	14.08.2037	1.065.361	0,05 %
State of California	675.000	7,55 %	01.04.2039	1.062.187	0,05 %
GS Mortgage Securities Trust 2014	1.000.000	3,93 %	10.09.2047	1.059.490	0,05 %
Bank of America Corp.	1.000.000	4,25 %	22.10.2026	1.050.592	0,05 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014	1.000.000	3,82 %	15.08.2050	1.048.390	0,05 %
JPMorgan Chase & Co.	975.000	4,50 %	24.01.2022	1.040.773	0,05 %
Morgan Stanley Capital I Trust 2017	1.000.000	3,53 %	15.06.2050	1.032.480	0,05 %
Schlumberger Holdings Corp.	1.000.000	3,63 %	21.12.2022	1.029.347	0,05 %
Citigroup, Inc.	975.000	4,40 %	10.06.2025	1.027.133	0,05 %
Dell International LLC/EMC Corp.	950.000	5,45 %	15.06.2023	1.026.607	0,05 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	875.000	6,48 %	23.10.2045	1.023.082	0,05 %
Federal Home Loan Mortgage Corp	1.000.000	3,00 %	25.01.2024	1.022.129	0,05 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	1.000.000	3,46 %	15.06.2050	1.022.010	0,05 %
Federal Home Loan Mortgage Corp^	1.000.000	3,29 %	25.03.2029	1.021.318	0,05 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	1.040.000	2,88 %	23.09.2023	1.018.746	0,05 %
Home Depot, Inc.	750.000	5,88 %	16.12.2036	1.017.525	0,05 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013	1.000.000	3,09 %	10.04.2046	1.013.790	0,05 %
Morgan Stanley	925.000	5,50 %	28.07.2021	1.011.489	0,05 %
General Electric Co.	737.000	6,75 %	15.03.2032	1.009.139	0,05 %
Oracle Corp.	1.025.000	1,90 %	15.09.2021	1.008.207	0,05 %
American Express Credit Corp.	1.000.000	2,70 %	03.03.2022	1.003.328	0,05 %
AbbVie, Inc.	1.000.000	2,90 %	06.11.2022	1.002.914	0,05 %
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust 2012	1.000.000	2,85 %	10.12.2045	999.850	0,05 %
Mercedes-Benz Auto Lease Trust 2017	1.000.000	1,79 %	15.04.2020	997.581	0,05 %
AT&T, Inc.	1.065.000	4,50 %	09.03.2048	997.563	0,05 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	980.000	3,03 %	25.10.2020	996.905	0,05 %
Morgan Stanley	950.000	4,35 %	08.09.2026	995.127	0,05 %
Federal Home Loan Mortgage Corp^	1.000.000	3,12 %	25.10.2031	994.474	0,05 %
Morgan Stanley	1.000.000	2,75 %	19.05.2022	994.175	0,05 %
Visa, Inc.	960.000	3,15 %	14.12.2025	980.313	0,05 %
Bank of America Corp.	810.000	5,00 %	21.01.2044	978.129	0,05 %
Federal National Mortgage Association^	1.000.000	2,60 %	25.12.2026	973.780	0,05 %
Medtronic, Inc.	950.000	3,15 %	15.03.2022	973.129	0,05 %
Exxon Mobil Corp.	950.000	3,04 %	01.03.2026	964.626	0,05 %
Verizon Communications, Inc.	875.000	5,25 %	16.03.2037	961.846	0,05 %
CCRE11 Commercial Mortgage Trust 2013	897.000	4,26 %	10.08.2050	960.194	0,05 %
Pfizer, Inc.	625.000	7,20 %	15.03.2039	958.614	0,05 %
Citigroup, Inc.	950.000	2,55 %	08.04.2019	953.118	0,05 %
Citigroup, Inc.	950.000	3,40 %	01.05.2026	952.405	0,05 %
AT&T, Inc.	950.000	2,45 %	30.06.2020	949.111	0,05 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. ¹	950.000	1,90 %	01.02.2019	948.050	0,05 %
AT&T, Inc.	922.000	5,15 %	15.11.2046	942.458	0,05 %
Goldman Sachs Group, Inc.	850.000	5,75 %	24.01.2022	939.969	0,05 %
Verizon Communications, Inc.	900.000	4,50 %	10.08.2033	939.704	0,05 %
Pacific Gas & Electric Co.	750.000	6,05 %	01.03.2034	939.478	0,05 %
Dell International LLC/EMC Corp.	925.000	3,48 %	01.06.2019	936.588	0,05 %
Morgan Stanley	900.000	3,75 %	25.02.2023	933.143	0,05 %
Microsoft Corp.	900.000	3,30 %	06.02.2027	927.523	0,05 %
Abbott Laboratories	925.000	2,35 %	22.11.2019	926.467	0,05 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014	879.000	3,92 %	15.10.2047	925.112	0,05 %
Bank of America Corp.^	850.000	4,24 %	24.04.2038	918.840	0,05 %
Microsoft Corp.	950.000	2,40 %	08.08.2026	916.574	0,05 %
AbbVie, Inc.	890.000	3,60 %	14.05.2025	914.672	0,05 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	900.000	3,69 %	05.06.2028	912.632	0,05 %
ConocoPhillips	650.000	6,50 %	01.02.2039	909.612	0,05 %
US Treasury Note	910.000	1,75 %	30.11.2019	907.725	0,05 %
AbbVie, Inc.	900.000	2,50 %	14.05.2020	902.065	0,05 %
CCRE20 Commercial Mortgage Trust 2014	870.000	3,59 %	10.11.2047	900.598	0,05 %
Citigroup, Inc.	850.000	4,45 %	29.09.2027	896.390	0,04 %
Schlumberger Investment SA	875.000	3,30 %	14.09.2021	896.097	0,04 %
JPMorgan Chase & Co.	850.000	4,40 %	22.07.2020	892.943	0,04 %
Bank of America Corp.	855.000	4,00 %	22.01.2025	889.397	0,04 %
General Electric Co.	689.000	5,88 %	14.01.2038	888.810	0,04 %
JPMorgan Chase & Co.	850.000	3,88 %	10.09.2024	882.471	0,04 %
AT&T, Inc.	825.000	5,45 %	01.03.2047	881.104	0,04 %
Visa, Inc.	875.000	2,20 %	14.12.2020	874.525	0,04 %
Citibank NA	875.000	2,13 %	20.10.2020	865.966	0,04 %
Amazon.com, Inc.	800.000	4,05 %	22.08.2047	861.611	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	825.000	4,13 %	16.03.2027	860.977	0,04 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	865.000	3,00 %	15.01.2022	858.992	0,04 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Visa, Inc.	750.000	4,30 %	14.12.2045	853.040	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.	850.000	2,75 %	15.09.2020	853.012	0,04 %
PNC Bank NA	850.000	2,55 %	09.12.2021	849.005	0,04 %
Medtronic, Inc.	752.000	4,38 %	15.03.2035	846.466	0,04 %
Microsoft Corp.	725.000	4,45 %	03.11.2045	844.880	0,04 %
Amgen, Inc.	775.000	4,40 %	01.05.2045	841.972	0,04 %
CVS Health Corp.	725.000	5,13 %	20.07.2045	832.365	0,04 %
CVS Health Corp.	825.000	2,80 %	20.07.2020	828.448	0,04 %
Federal Home Loan Mortgage Corp^	800.000	3,35 %	25.11.2026	827.952	0,04 %
Gilead Sciences, Inc.	775.000	4,15 %	01.03.2047	822.002	0,04 %
Cisco Systems, Inc.	825.000	2,20 %	28.02.2021	821.133	0,04 %
UBS3 Commercial Mortgage Trust 2014	784.000	3,82 %	10.06.2047	820.566	0,04 %
Wells Fargo Bank NA	825.000	1,75 %	24.05.2019	820.228	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.	800.000	3,85 %	26.01.2027	819.824	0,04 %
Morgan Stanley	750.000	5,00 %	24.11.2025	819.692	0,04 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	800.000	3,22 %	25.03.2027	819.160	0,04 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	825.000	2,50 %	15.07.2022	817.837	0,04 %
AT&T, Inc.	812.000	4,30 %	15.02.2030	810.161	0,04 %
Abbott Laboratories	800.000	2,90 %	30.11.2021	808.417	0,04 %
AT&T, Inc.	800.000	3,40 %	14.08.2024	804.486	0,04 %
AT&T, Inc.	775.000	5,80 %	15.02.2019	804.424	0,04 %
Wells Fargo & Co.	675.000	5,38 %	02.11.2043	803.409	0,04 %
Morgan Stanley	770.000	3,88 %	29.04.2024	803.346	0,04 %
Amazon.com, Inc.	800.000	3,15 %	22.08.2027	801.009	0,04 %
Microsoft Corp.	700.000	4,25 %	06.02.2047	800.365	0,04 %
Morgan Stanley	800.000	2,50 %	21.04.2021	797.667	0,04 %
AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2017	800.000	1,98 %	20.12.2021	796.715	0,04 %
AT&T, Inc.	815.000	4,75 %	15.05.2046	793.431	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.	700.000	4,80 %	08.07.2044	793.061	0,04 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	775.000	3,60 %	15.10.2020	791.280	0,04 %
Apple, Inc.	775.000	3,25 %	23.02.2026	790.881	0,04 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014	775.000	3,41 %	15.08.2047	790.864	0,04 %
JPMorgan Chase & Co.^	775.000	3,54 %	01.05.2028	785.790	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	781.000	2,95 %	15.03.2022	785.631	0,04 %
Wells Fargo & Co.	800.000	3,00 %	22.04.2026	785.270	0,04 %
JPMorgan Chase & Co.	750.000	3,88 %	01.02.2024	785.160	0,04 %
Citigroup, Inc.	735.000	4,50 %	14.01.2022	781.954	0,04 %
Metropolitan Life Global Funding I	775.000	3,00 %	10.01.2023	781.314	0,04 %
Altria Group, Inc.	775.000	2,63 %	14.01.2020	779.675	0,04 %
Wells Fargo & Co.	700.000	4,75 %	07.12.2046	778.524	0,04 %
Cisco Systems, Inc.	750.000	4,95 %	15.02.2019	774.524	0,04 %
United Technologies Corp.	700.000	4,50 %	01.06.2042	773.487	0,04 %
JPMorgan Chase & Co.	775.000	2,40 %	07.06.2021	770.893	0,04 %
Oracle Corp.	725.000	4,00 %	15.07.2046	770.577	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.	725.000	7,50 %	15.02.2019	766.437	0,04 %
Bank of America Corp.^	755.000	3,12 %	20.01.2023	765.097	0,04 %
Citigroup, Inc.	675.000	5,50 %	13.09.2025	758.826	0,04 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013	750.000	3,07 %	15.06.2046	757.958	0,04 %
JPMorgan Chase & Co.	550.000	6,40 %	15.05.2038	753.833	0,04 %
Kinder Morgan, Inc.	750.000	3,05 %	01.12.2019	753.273	0,04 %
AbbVie, Inc.	673.000	4,70 %	14.05.2045	750.447	0,04 %
Citigroup, Inc.	750.000	2,45 %	10.01.2020	749.457	0,04 %
Cisco Systems, Inc.	750.000	1,60 %	28.02.2019	746.397	0,04 %
Teachers Insurance & Annuity Association of America	650.000	4,90 %	15.09.2044	746.207	0,04 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	750.000	1,82 %	15.09.2022	746.000	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.	700.000	5,38 %	15.03.2020	741.726	0,04 %
AT&T, Inc.	700.000	5,25 %	01.03.2037	740.601	0,04 %
JPMorgan Chase & Co.	725.000	3,25 %	23.09.2022	739.570	0,04 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	700.000	7,75 %	15.01.2019	739.372	0,04 %
Wells Fargo & Co.^	725.000	3,58 %	22.05.2028	738.864	0,04 %
Goldman Sachs Group, Inc.	750.000	2,35 %	15.11.2021	738.725	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	725.000	4,40 %	01.11.2034	738.488	0,04 %
Bank of America Corp.	700.000	4,20 %	26.08.2024	734.128	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	775.000	2,63 %	15.08.2026	729.645	0,04 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	700.000	4,46 %	23.07.2022	728.633	0,04 %
Apple, Inc.	700.000	3,85 %	04.05.2043	728.454	0,04 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Amgen, Inc.	700.000	3,63 %	22.05.2024	728.362	0,04 %
Morgan Stanley	700.000	3,88 %	27.01.2026	728.066	0,04 %
Federal Home Loan Mortgage Corp	700.000	3,41 %	25.12.2026	727.615	0,04 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017	700.000	3,60 %	15.05.2050	727.097	0,04 %
Bank of America Corp.^	715.000	3,59 %	21.07.2028	723.572	0,04 %
Citigroup, Inc.^	700.000	3,89 %	10.01.2028	721.098	0,04 %
Fifth Third Bancorp	700.000	3,50 %	15.03.2022	720.784	0,04 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	725.000	2,38 %	15.01.2020	720.664	0,04 %
General Electric Co.	501.000	6,88 %	10.01.2039	720.500	0,04 %
Verizon Communications, Inc.	724.000	4,27 %	15.01.2036	720.228	0,04 %
Morgan Stanley	725.000	3,13 %	27.07.2026	715.352	0,04 %
Morgan Stanley	700.000	3,63 %	20.01.2027	714.116	0,04 %
Microsoft Corp.	700.000	3,13 %	03.11.2025	713.686	0,04 %
Apple, Inc.	700.000	2,85 %	06.05.2021	711.519	0,04 %
Marathon Oil Corp.	700.000	3,85 %	01.06.2025	710.619	0,04 %
New Jersey Turnpike Authority	475.000	7,10 %	01.01.2041	709.617	0,04 %
Wells Fargo & Co.	675.000	4,10 %	03.06.2026	708.588	0,04 %
Allergan Funding SCS	700.000	3,00 %	12.03.2020	705.286	0,04 %
State Street Corp.	725.000	2,65 %	19.05.2026	704.504	0,04 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	525.000	6,13 %	01.04.2036	704.210	0,04 %
State of California	475.000	7,50 %	01.04.2034	703.389	0,04 %
Citigroup, Inc.	439.000	8,13 %	15.07.2039	700.042	0,03 %
General Electric Co.	700.000	2,70 %	09.10.2022	698.596	0,03 %
Chevron Corp.	700.000	2,95 %	16.05.2026	697.903	0,03 %
Verizon Communications, Inc.	707.000	4,52 %	15.09.2048	696.362	0,03 %
Kraft Heinz Foods Co.	700.000	4,38 %	01.06.2046	693.368	0,03 %
Ford Motor Credit Co. LLC	700.000	2,34 %	02.11.2020	692.865	0,03 %
Oracle Corp.	710.000	2,65 %	15.07.2026	692.223	0,03 %
Morgan Stanley	655.000	5,63 %	23.09.2019	690.476	0,03 %
AT&T, Inc.	675.000	4,13 %	17.02.2026	688.080	0,03 %
New Jersey Economic Development Authority	550.000	7,43 %	15.02.2029	687.863	0,03 %
Liberty Mutual Group, Inc.	515.000	6,50 %	01.05.2042	687.337	0,03 %
Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017	675.000	3,12 %	15.02.2050	685.543	0,03 %
AT&T, Inc.	733.000	4,35 %	15.06.2045	679.398	0,03 %
AbbVie, Inc.	631.000	4,40 %	06.11.2042	676.302	0,03 %
Cintas Corp.No 2	650.000	3,70 %	01.04.2027	675.572	0,03 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	675.000	2,65 %	01.02.2019	675.256	0,03 %
Gilead Sciences, Inc.	650.000	3,65 %	01.03.2026	672.998	0,03 %
Wal-Mart Stores, Inc.	475.000	6,20 %	15.04.2038	670.141	0,03 %
Prudential Financial, Inc.^	625.000	5,38 %	15.05.2045	669.267	0,03 %
Oracle Corp.	525.000	5,38 %	15.07.2040	662.000	0,03 %
Reynolds American, Inc.	530.000	5,85 %	15.08.2045	660.695	0,03 %
Morgan Stanley	475.000	6,38 %	24.07.2042	660.123	0,03 %
Allergan Funding SCS	650.000	3,45 %	15.03.2022	659.780	0,03 %
CBRE Services, Inc.	600.000	5,25 %	15.03.2025	659.694	0,03 %
Oracle Corp.	650.000	3,25 %	15.11.2027	659.628	0,03 %
Metropolitan Life Global Funding I	658.000	2,30 %	10.04.2019	659.195	0,03 %
Allergan Funding SCS	625.000	4,55 %	15.03.2035	658.442	0,03 %
Verizon Communications, Inc.	625.000	4,15 %	15.03.2024	657.967	0,03 %
Wells Fargo & Co.	675.000	3,00 %	23.10.2026	657.877	0,03 %
Bank of America Corp.	650.000	2,65 %	01.04.2019	654.488	0,03 %
Wells Fargo & Co.	600.000	4,65 %	04.11.2044	653.860	0,03 %
Amazon.com, Inc.	600.000	4,25 %	22.08.2057	653.255	0,03 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012	635.000	3,44 %	15.04.2045	652.723	0,03 %
AT&T, Inc.	650.000	5,30 %	14.08.2058	651.715	0,03 %
Apple, Inc.	650.000	2,10 %	06.05.2019	651.596	0,03 %
Apple, Inc.	650.000	2,25 %	23.02.2021	649.117	0,03 %
Cisco Systems, Inc.	475.000	5,90 %	15.02.2039	649.030	0,03 %
Bank of America Corp.	510.000	6,11 %	29.01.2037	649.015	0,03 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012	640.115	2,88 %	15.12.2045	644.769	0,03 %
ONEOK Partners LP	525.000	6,65 %	01.10.2036	644.587	0,03 %
Pfizer, Inc.	650.000	1,95 %	03.06.2021	642.884	0,03 %
Microsoft Corp.	575.000	4,10 %	06.02.2037	642.036	0,03 %
AT&T, Inc.	625.000	3,60 %	17.02.2023	639.242	0,03 %
State of California	400.000	7,60 %	01.11.2040	638.772	0,03 %
Reynolds American, Inc.	600.000	4,45 %	12.06.2025	638.487	0,03 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Wyeth LLC	475.000	5,95 %	01.04.2037	637.441	0,03 %
Bank of America Corp.	600.000	4,10 %	24.07.2023	636.638	0,03 %
ERAC USA Finance LLC	475.000	7,00 %	15.10.2037	635.939	0,03 %
State of California	425.000	7,30 %	01.10.2039	634.040	0,03 %
Caterpillar Financial Services Corp.	600.000	7,15 %	15.02.2019	633.023	0,03 %
Microsoft Corp.	650.000	1,55 %	08.08.2021	632.934	0,03 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	600.000	4,90 %	15.10.2025	632.310	0,03 %
Gilead Sciences, Inc.	550.000	4,75 %	01.03.2046	632.153	0,03 %
Wal-Mart Stores, Inc.	500.000	5,25 %	01.09.2035	630.939	0,03 %
Bank of America Corp.	420.000	7,75 %	14.05.2038	629.092	0,03 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	600.000	3,53 %	25.10.2023	628.626	0,03 %
Wells Fargo & Co.	625.000	2,60 %	22.07.2020	627.935	0,03 %
Wells Fargo Bank NA	450.000	6,60 %	15.01.2038	627.528	0,03 %
Wal-Mart Stores, Inc.	625.000	2,55 %	11.04.2023	626.994	0,03 %
Pfizer, Inc.	620.000	3,00 %	15.12.2026	624.146	0,03 %
Merck & Co., Inc.	625.000	2,75 %	10.02.2025	622.014	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.^	600.000	3,78 %	01.02.2028	620.872	0,03 %
Celgene Corp.	600.000	3,88 %	15.08.2025	620.415	0,03 %
General Electric Co.	560.000	4,50 %	11.03.2044	620.359	0,03 %
Bank of America Corp.^	600.000	3,82 %	20.01.2028	618.980	0,03 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	600.000	5,38 %	01.05.2047	618.854	0,03 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013	581.000	4,13 %	15.11.2045	618.689	0,03 %
Sempra Energy	625.000	1,63 %	07.10.2019	617.401	0,03 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	620.000	1,92 %	07.04.2022	616.739	0,03 %
Wells Fargo & Co.	500.000	5,61 %	15.01.2044	616.552	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	600.000	4,02 %	31.10.2038	614.679	0,03 %
Bank of America Corp.	600.000	3,30 %	11.01.2023	613.900	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.^	600.000	3,88 %	24.07.2038	613.808	0,03 %
Bank of America Corp.	575.000	4,45 %	03.03.2026	613.720	0,03 %
FirstEnergy Corp.	600.000	3,90 %	15.07.2027	613.705	0,03 %
Bank of America Corp.	600.000	3,50 %	19.04.2026	613.246	0,03 %
Dell International LLC/EMC Corp.	475.000	8,35 %	15.07.2046	612.058	0,03 %
CVS Health Corp.	594.000	3,88 %	20.07.2025	611.659	0,03 %
Exxon Mobil Corp.	550.000	4,11 %	01.03.2046	611.260	0,03 %
Enterprise Products Operating LLC	550.000	4,90 %	15.05.2046	608.264	0,03 %
Citigroup, Inc.^	600.000	3,67 %	24.07.2028	607.415	0,03 %
MassMutual Global Funding II	612.000	2,75 %	22.06.2024	607.172	0,03 %
Cisco Systems, Inc.	575.000	3,63 %	04.03.2024	606.215	0,03 %
UnitedHealth Group, Inc.	600.000	2,70 %	15.07.2020	606.182	0,03 %
Newmont Mining Corp.	500.000	5,88 %	01.04.2035	605.914	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	600.000	2,75 %	23.06.2020	605.161	0,03 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	600.000	5,40 %	01.10.2047	604.935	0,03 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	592.000	3,80 %	18.11.2024	604.770	0,03 %
Berkshire Hathaway, Inc.	600.000	2,75 %	15.03.2023	603.911	0,03 %
Morgan Stanley	600.000	2,65 %	27.01.2020	602.411	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	600.000	3,30 %	01.04.2026	602.374	0,03 %
Oracle Corp.	600.000	2,95 %	15.05.2025	601.789	0,03 %
Citigroup, Inc.	600.000	2,70 %	30.03.2021	601.058	0,03 %
AT&T, Inc.	600.000	3,00 %	30.06.2022	600.884	0,03 %
Williams Partners LP/ACMP Finance Corp.	575.000	4,88 %	15.03.2024	600.875	0,03 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	600.000	2,15 %	15.07.2021	600.779	0,03 %
Oracle Corp.	600.000	2,50 %	15.05.2022	600.369	0,03 %
American Express Credit Corp.	600.000	2,25 %	15.08.2019	600.344	0,03 %
McDonald's Corp.	600.000	2,63 %	15.01.2022	600.232	0,03 %
Wells Fargo Bank NA	600.000	2,15 %	06.12.2019	598.718	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	600.000	2,88 %	31.10.2022	598.504	0,03 %
PNC Bank NA	600.000	1,95 %	04.03.2019	598.452	0,03 %
AT&T, Inc.	602.000	4,50 %	15.05.2035	598.115	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	600.000	3,20 %	15.06.2026	597.158	0,03 %
Apple, Inc.	575.000	3,45 %	06.05.2024	596.074	0,03 %
Toyota Auto Receivables 2017-B Owner Trust	600.000	1,76 %	15.07.2021	596.045	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	575.000	3,63 %	13.05.2024	595.843	0,03 %
PNC Bank NA	595.000	2,45 %	05.11.2020	595.486	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	600.000	3,27 %	29.09.2025	595.311	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.^	600.000	2,91 %	24.07.2023	594.748	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	600.000	2,30 %	15.08.2021	594.694	0,03 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
American Express Credit Corp.	600.000	2,25 %	05.05.2021	594.365	0,03 %
Citigroup, Inc.	575.000	3,75 %	16.06.2024	594.166	0,03 %
Wells Fargo & Co.	600.000	3,00 %	19.02.2025	593.734	0,03 %
American Express Co.	600.000	2,50 %	01.08.2022	592.758	0,03 %
New York Life Global Funding	600.000	1,50 %	24.10.2019	592.137	0,03 %
Becton Dickinson and Co.	550.000	4,67 %	06.06.2047	591.984	0,03 %
Andeavor	550.000	4,75 %	15.12.2023	591.250	0,03 %
Microsoft Corp.	550.000	4,00 %	12.02.2055	590.849	0,03 %
AT&T, Inc.	600.000	4,80 %	15.06.2044	589.941	0,03 %
ConocoPhillips Holding Co.	450.000	6,95 %	15.04.2029	589.017	0,03 %
Morgan Stanley	550.000	7,30 %	13.05.2019	586.363	0,03 %
Microsoft Corp.	550.000	3,95 %	08.08.2056	585.928	0,03 %
HP, Inc.	550.000	4,65 %	09.12.2021	584.585	0,03 %
United Parcel Service, Inc.	568.000	3,13 %	15.01.2021	582.581	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	550.000	4,35 %	15.08.2021	582.378	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.	575.000	3,50 %	23.01.2025	582.162	0,03 %
Phillips 66	550.000	4,30 %	01.04.2022	580.867	0,03 %
Becton Dickinson and Co.	575.000	3,70 %	06.06.2027	579.345	0,03 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014	572.864	3,05 %	15.04.2047	578.220	0,03 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	525.000	5,63 %	01.03.2025	577.500	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.	575.000	2,63 %	31.01.2019	577.275	0,03 %
AbbVie, Inc.	525.000	4,50 %	14.05.2035	576.749	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	575.000	2,55 %	01.03.2021	575.637	0,03 %
Morgan Stanley	575.000	2,38 %	23.07.2019	575.183	0,03 %
AT&T, Inc.	573.000	4,10 %	15.02.2028	574.687	0,03 %
Energy Transfer LP	575.000	4,05 %	15.03.2025	574.458	0,03 %
Oracle Corp.	575.000	2,50 %	15.10.2022	574.353	0,03 %
Aflac, Inc.	550.000	3,63 %	15.06.2023	573.215	0,03 %
Ford Motor Co.	550.000	4,35 %	08.12.2026	573.207	0,03 %
Philip Morris International, Inc.	425.000	6,38 %	16.05.2038	573.101	0,03 %
QUALCOMM, Inc.	575.000	1,85 %	20.05.2019	572.948	0,03 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	575.000	3,63 %	15.01.2024	572.237	0,03 %
Morgan Stanley	525.000	4,38 %	22.01.2047	570.492	0,03 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	485.000	6,38 %	23.10.2035	568.330	0,03 %
Microsoft Corp.	575.000	1,10 %	08.08.2019	567.143	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.	550.000	3,63 %	22.01.2023	565.682	0,03 %
Abbott Laboratories	550.000	3,75 %	30.11.2026	564.912	0,03 %
Sammons Financial Group, Inc.	550.000	4,45 %	12.05.2027	564.190	0,03 %
Apple, Inc.	550.000	3,35 %	09.02.2027	563.259	0,03 %
Apple, Inc.	500.000	4,38 %	13.05.2045	562.963	0,03 %
MetLife, Inc.	480.000	4,88 %	13.11.2043	562.439	0,03 %
Merck & Co., Inc.	540.000	3,70 %	10.02.2045	560.360	0,03 %
United Technologies Corp.	550.000	3,10 %	01.06.2022	560.124	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	550.000	3,20 %	25.01.2023	559.210	0,03 %
Cisco Systems, Inc.	425.000	5,50 %	15.01.2040	559.166	0,03 %
Visa, Inc.	550.000	2,80 %	14.12.2022	557.253	0,03 %
Express Scripts Holding Co.	525.000	4,50 %	25.02.2026	557.146	0,03 %
Amazon.com, Inc.	525.000	3,88 %	22.08.2037	557.101	0,03 %
UBS6 Commercial Mortgage Trust 2014	534.000	4,05 %	10.12.2047	557.079	0,03 %
Ford Motor Co.	550.000	4,75 %	15.01.2043	556.018	0,03 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	500.000	5,75 %	15.05.2024	553.750	0,03 %
Kraft Heinz Foods Co.	535.000	3,95 %	15.07.2025	552.448	0,03 %
Citigroup, Inc.	550.000	2,90 %	08.12.2021	552.350	0,03 %
HSBC USA, Inc.	550.000	2,38 %	13.11.2019	550.904	0,03 %
Bank of America Corp.	550.000	2,25 %	21.04.2020	549.882	0,03 %
General Electric Co.	512.000	4,65 %	17.10.2021	548.575	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.	475.000	5,15 %	22.05.2045	548.401	0,03 %
Merck & Co., Inc.	550.000	2,40 %	15.09.2022	547.936	0,03 %
Molson Coors Brewing Co.	560.000	3,00 %	15.07.2026	547.817	0,03 %
Microsoft Corp.	550.000	2,70 %	12.02.2025	547.718	0,03 %
Microsoft Corp.	550.000	2,00 %	03.11.2020	547.454	0,03 %
UnitedHealth Group, Inc.	460.000	4,75 %	15.07.2045	543.564	0,03 %
Newell Brands Inc.	525.000	3,85 %	01.04.2023	543.012	0,03 %
Dow Chemical Co.	500.000	8,55 %	15.05.2019	541.338	0,03 %
Morgan Stanley	525.000	3,70 %	23.10.2024	541.101	0,03 %
Microsoft Corp.	525.000	3,45 %	08.08.2036	540.763	0,03 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Lockheed Martin Corp.	520.000	3,55 %	15.01.2026	539.733	0,03 %
Liberty Mutual Group, Inc.	500.000	4,95 %	01.05.2022	539.599	0,03 %
Wal-Mart Stores, Inc.	400.000	5,63 %	01.04.2040	539.318	0,03 %
Chevron Corp.	525.000	3,19 %	24.06.2023	538.179	0,03 %
Express Scripts Holding Co.	550.000	3,40 %	01.03.2027	537.910	0,03 %
Northwestern Mutual Life Insurance Co.	400.000	6,06 %	30.03.2040	537.707	0,03 %
21st Century Fox America, Inc.	400.000	6,15 %	15.02.2041	537.499	0,03 %
Procter & Gamble Co.	550.000	1,70 %	03.11.2021	537.067	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	510.000	6,30 %	23.04.2019	536.924	0,03 %
FirstEnergy Corp.	400.000	7,38 %	15.11.2031	536.749	0,03 %
Kraft Heinz Foods Co.	500.000	5,00 %	04.06.2042	536.507	0,03 %
State of California	500.000	6,20 %	01.10.2019	535.875	0,03 %
Brooklyn Union Gas Co.	525.000	3,41 %	10.03.2026	535.625	0,03 %
MPLX LP	500.000	4,88 %	01.06.2025	535.250	0,03 %
Tyson Foods, Inc.	500.000	4,50 %	15.06.2022	533.712	0,03 %
NBCUniversal Media LLC	500.000	5,15 %	30.04.2020	531.493	0,03 %
Microsoft Corp.	450.000	4,50 %	06.02.2057	529.956	0,03 %
Mylan NV	525.000	3,95 %	15.06.2026	529.712	0,03 %
Berkshire Hathaway, Inc.	525.000	3,13 %	15.03.2026	529.555	0,03 %
Teachers Insurance & Annuity Association of America	500.000	4,27 %	15.05.2047	529.153	0,03 %
Intel Corp.	500.000	3,70 %	29.07.2025	527.901	0,03 %
Honda Auto Receivables 2017-2 Owner Trust	532.000	1,68 %	16.08.2021	527.303	0,03 %
Oracle Corp.	525.000	2,25 %	08.10.2019	527.138	0,03 %
Mylan NV	525.000	3,15 %	15.06.2021	527.135	0,03 %
Pfizer, Inc.	525.000	2,10 %	15.05.2019	525.819	0,03 %
Federal National Mortgage Association^	525.000	2,90 %	25.01.2025	525.787	0,03 %
Metropolitan Edison Co.	500.000	7,70 %	15.01.2019	525.758	0,03 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	525.000	3,55 %	01.04.2025	525.164	0,03 %
General Electric Co.	500.000	4,13 %	09.10.2042	523.995	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.	525.000	2,30 %	13.12.2019	523.638	0,03 %
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017	500.000	3,69 %	15.03.2050	522.875	0,03 %
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A	525.000	2,07 %	15.05.2022	522.612	0,03 %
Valero Energy Corp.	395.000	6,63 %	15.06.2037	522.496	0,03 %
Williams Partners LP	500.000	4,30 %	04.03.2024	522.442	0,03 %
Morgan Stanley	500.000	4,00 %	23.07.2025	521.717	0,03 %
Northrop Grumman Corp.	520.000	3,25 %	15.01.2028	521.063	0,03 %
Kinder Morgan, Inc.	500.000	4,30 %	01.06.2025	520.447	0,03 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	525.000	1,90 %	23.09.2019	520.424	0,03 %
Caterpillar Financial Services Corp.	525.000	1,35 %	18.05.2019	520.229	0,03 %
Port Authority of New York & New Jersey	450.000	4,46 %	01.10.2062	519.629	0,03 %
Morgan Stanley	500.000	4,10 %	22.05.2023	519.522	0,03 %
Oracle Corp.	500.000	3,40 %	08.07.2024	519.126	0,03 %
Ford Motor Co.	400.000	7,45 %	16.07.2031	518.906	0,03 %
Bank 2018-BNK ⁹	500.000	3,63 %	15.05.2050	518.730	0,03 %
Halliburton Co.	500.000	3,80 %	15.11.2025	518.431	0,03 %
Praxair, Inc.	500.000	4,50 %	15.08.2019	518.294	0,03 %
TD Ameritrade Holding Corp.	500.000	3,63 %	01.04.2025	517.847	0,03 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	500.000	3,28 %	25.06.2025	517.690	0,03 %
Bank of America Corp.	500.000	3,95 %	21.04.2025	516.826	0,03 %
Synchrony Financial	525.000	3,70 %	04.08.2026	516.467	0,03 %
CD 2017-CD4 Mortgage Trust^	500.000	3,51 %	10.05.2050	516.180	0,03 %
Halliburton Co.	450.000	5,00 %	15.11.2045	515.799	0,03 %
Georgia-Pacific LLC	500.000	3,60 %	01.03.2025	514.488	0,03 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	505.000	3,58 %	23.07.2020	514.144	0,03 %
Morgan Stanley^	500.000	3,97 %	22.07.2038	514.137	0,03 %
Oracle Corp.	520.000	2,40 %	15.09.2023	513.571	0,03 %
AbbVie, Inc.	475.000	4,45 %	14.05.2046	513.260	0,03 %
CBS Corp.	500.000	3,70 %	15.08.2024	513.152	0,03 %
GS Mortgage Securities Trust 2017	500.000	3,43 %	10.05.2050	512.575	0,03 %
Verizon Communications, Inc.	508.000	2,63 %	21.02.2020	511.950	0,03 %
Federal Home Loan Mortgage Corp^	500.000	3,06 %	25.11.2023	511.800	0,03 %
Bank of America Corp.^	500.000	3,71 %	24.04.2028	511.483	0,03 %
CD 2017-CD4 Mortgage Trust	500.000	3,75 %	10.05.2050	510.670	0,03 %
Oracle Corp.	475.000	4,13 %	15.05.2045	510.071	0,03 %
CFCRE Commercial Mortgage Trust 2017	500.000	3,57 %	15.06.2050	509.870	0,03 %
Chubb INA Holdings, Inc.	500.000	3,35 %	03.05.2026	509.677	0,03 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
JPMorgan Chase & Co.^	475.000	4,26 %	22.02.2048	509.323	0,03 %
State of California	325.000	7,63 %	01.03.2040	508.446	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	500.000	3,38 %	01.05.2023	508.360	0,03 %
GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.	500.000	3,37 %	15.11.2025	507.896	0,03 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	475.000	5,63 %	01.02.2021	507.656	0,03 %
Citigroup, Inc.	500.000	3,50 %	15.05.2023	507.523	0,03 %
Southern Co.	475.000	4,40 %	01.07.2046	506.817	0,03 %
Microsoft Corp.	500.000	2,88 %	06.02.2024	505.877	0,03 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	500.000	2,68 %	07.06.2023	505.517	0,03 %
Exelon Generation Co. LLC	500.000	2,95 %	15.01.2020	505.036	0,03 %
Wells Fargo & Co.	475.000	4,60 %	01.04.2021	504.935	0,03 %
Oracle Corp.	475.000	4,00 %	15.11.2047	504.727	0,03 %
Apple, Inc.	525.000	2,45 %	04.08.2026	504.265	0,03 %
Comcast Corp.	500.000	3,15 %	01.03.2026	504.136	0,03 %
Biogen, Inc.	425.000	5,20 %	15.09.2045	504.022	0,03 %
Morgan Stanley	500.000	2,80 %	16.06.2020	503.794	0,03 %
Wells Fargo & Co.	500.000	3,07 %	24.01.2023	503.548	0,03 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	400.000	5,88 %	01.08.2033	502.663	0,03 %
Oracle Corp.	500.000	2,38 %	15.01.2019	502.147	0,03 %
Morgan Stanley	500.000	2,50 %	24.01.2019	502.008	0,03 %
Lowe's Cos, Inc.	500.000	3,10 %	03.05.2027	501.825	0,03 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	450.000	5,88 %	30.06.2026	501.750	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.^	500.000	3,22 %	01.03.2025	501.539	0,03 %
JPMorgan Chase & Co.	500.000	2,55 %	29.10.2020	501.459	0,03 %
Morgan Stanley	500.000	2,45 %	01.02.2019	500.983	0,03 %
Goldman Sachs Group, Inc.	500.000	2,55 %	23.10.2019	500.925	0,03 %
Cox Communications, Inc.	500.000	3,25 %	15.12.2022	500.569	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	500.000	2,31 %	25.03.2020	500.410	0,02 %
Oracle Corp.	450.000	4,30 %	08.07.2034	500.024	0,02 %
Discover Card Execution Note Trust	500.000	2,39 %	15.07.2024	499.998	0,02 %
Kroger Co.	500.000	2,30 %	15.01.2019	499.831	0,02 %
Chubb INA Holdings, Inc.	500.000	2,30 %	03.11.2020	498.917	0,02 %
SunTrust Bank	500.000	2,25 %	31.01.2020	498.656	0,02 %
Mercedes-Benz Auto Lease Trust 2017	500.000	2,01 %	17.01.2023	498.474	0,02 %
United Technologies Corp.	375.000	6,13 %	15.07.2038	498.272	0,02 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	500.000	2,43 %	15.01.2025	498.131	0,02 %
American Express Credit Account Master Trust	500.000	2,04 %	15.05.2023	497.634	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	475.000	4,00 %	03.03.2024	497.603	0,02 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	500.000	2,00 %	17.01.2023	497.499	0,02 %
Apple, Inc.	480.000	3,85 %	04.08.2046	497.480	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	500.000	2,37 %	25.05.2022	497.440	0,02 %
Ford Motor Credit Co. LLC	500.000	2,02 %	03.05.2019	497.368	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	500.000	1,73 %	25.07.2019	497.180	0,02 %
Southern Co.	500.000	1,85 %	01.07.2019	497.128	0,02 %
Morgan Stanley	500.000	2,63 %	17.11.2021	497.126	0,02 %
Johnson & Johnson	475.000	3,70 %	01.03.2046	496.816	0,02 %
Citigroup, Inc.	450.000	4,75 %	18.05.2046	496.735	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	500.000	2,70 %	18.05.2023	496.717	0,02 %
Bank of America Corp.^	500.000	3,09 %	01.10.2025	496.378	0,02 %
International Business Machines Corp.	475.000	3,63 %	12.02.2024	495.916	0,02 %
Gilead Sciences, Inc.	475.000	3,70 %	01.04.2024	495.871	0,02 %
Bank of America Corp.^	500.000	2,33 %	01.10.2021	495.636	0,02 %
Aon plc	475.000	3,88 %	15.12.2025	495.495	0,02 %
Altria Group, Inc.	500.000	3,88 %	16.09.2046	494.950	0,02 %
Apple, Inc.	500.000	2,40 %	13.01.2023	494.948	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	370.000	6,25 %	01.02.2041	494.313	0,02 %
GS Mortgage Securities Corp.II	491.000	2,94 %	10.02.2046	494.265	0,02 %
PepsiCo, Inc.	500.000	1,35 %	04.10.2019	493.805	0,02 %
Apple, Inc.	500.000	2,90 %	12.09.2027	492.311	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	475.000	3,85 %	08.07.2024	492.018	0,02 %
Apache Corp.	475.000	4,75 %	15.04.2043	491.827	0,02 %
Intel Corp.	475.000	3,30 %	01.10.2021	491.511	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	500.000	2,95 %	01.10.2026	490.966	0,02 %
Chevron Corp.	475.000	4,95 %	03.03.2019	490.547	0,02 %
Capital One Na	500.000	2,25 %	13.09.2021	490.537	0,02 %
Sherwin-Williams Co.	450.000	4,50 %	01.06.2047	490.022	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Wells Fargo & Co.	475.000	3,50 %	08.03.2022	489.873	0,02 %
Wal-Mart Stores, Inc. 1	475.000	3,25 %	25.10.2020	489.446	0,02 %
Philip Morris International, Inc.	500.000	2,75 %	25.02.2026	489.087	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	475.000	3,50 %	01.11.2021	488.812	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	487.746	2,32 %	25.10.2018	488.614	0,02 %
Aviation Capital Group LLC	500.000	3,50 %	01.11.2027	487.990	0,02 %
Federal National Mortgage Association	500.000	2,47 %	25.04.2026	487.280	0,02 %
Comcast Corp.	475.000	3,38 %	15.08.2025	487.219	0,02 %
Altria Group, Inc.	400.000	5,38 %	31.01.2044	486.722	0,02 %
Johnson & Johnson	500.000	2,45 %	01.03.2026	486.429	0,02 %
Kraft Heinz Foods Co.	475.000	3,50 %	06.06.2022	486.059	0,02 %
American Tower Corp.	475.000	3,50 %	31.01.2023	485.050	0,02 %
Amazon.com, Inc.	400.000	4,95 %	05.12.2044	484.470	0,02 %
AT&T, Inc.	475.000	4,25 %	01.03.2027	484.215	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	425.000	4,75 %	21.10.2045	484.148	0,02 %
Wells Fargo & Co.	475.000	3,45 %	13.02.2023	484.095	0,02 %
Federal National Mortgage Association	500.000	2,49 %	25.05.2026	483.710	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	482.530	2,41 %	25.08.2018	483.356	0,02 %
Federal National Mortgage Association^	500.000	2,49 %	25.12.2026	482.740	0,02 %
American International Group, Inc.	375.000	6,25 %	01.05.2036	481.911	0,02 %
Biogen, Inc.	475.000	2,90 %	15.09.2020	481.675	0,02 %
Boeing Co.	500.000	1,88 %	15.06.2023	480.830	0,02 %
Time Warner Cable LLC	461.000	5,00 %	01.02.2020	480.764	0,02 %
Apple, Inc.	475.000	3,20 %	11.05.2027	480.577	0,02 %
Federal National Mortgage Association^	500.000	2,42 %	25.10.2026	480.405	0,02 %
Metropolitan Transportation Authority	310.000	7,34 %	15.11.2039	479.691	0,02 %
American Express Credit Corp.	475.000	3,30 %	03.05.2027	479.542	0,02 %
Walt Disney Co.	445.000	4,13 %	01.12.2041	479.016	0,02 %
Oracle Corp.	475.000	2,95 %	15.11.2024	478.391	0,02 %
Phillips 66	375.000	5,88 %	01.05.2042	477.978	0,02 %
Kinder Morgan, Inc.	450.000	5,30 %	01.12.2034	477.787	0,02 %
Becton Dickinson and Co.	475.000	3,36 %	06.06.2024	476.590	0,02 %
Citigroup, Inc.^	475.000	3,52 %	27.10.2028	476.433	0,02 %
Wells Fargo & Co.	450.000	4,40 %	14.06.2046	476.035	0,02 %
Actavis, Inc.	475.000	3,25 %	01.10.2022	475.717	0,02 %
GS Mortgage Securities Trust 2017	467.000	3,43 %	10.08.2050	475.593	0,02 %
Pacific LifeCorp	423.000	5,13 %	30.01.2043	475.291	0,02 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2016	478.000	2,21 %	15.05.2024	475.051	0,02 %
AT&T, Inc.	450.000	5,35 %	01.09.2040	474.719	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	450.000	4,13 %	15.12.2026	474.473	0,02 %
Southern Copper Corp.	350.000	7,50 %	27.07.2035	474.274	0,02 %
AbbVie, Inc.	475.000	3,20 %	14.05.2026	473.452	0,02 %
Johnson & Johnson	475.000	2,25 %	03.03.2022	473.405	0,02 %
General Electric Co.	447.000	4,63 %	07.01.2021	473.390	0,02 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2017	475.000	2,01 %	15.03.2022	473.287	0,02 %
MidAmerican Energy Co.	350.000	6,75 %	30.12.2031	472.923	0,02 %
Oracle Corp.	450.000	3,80 %	15.11.2037	472.247	0,02 %
Chevron Corp.	475.000	2,36 %	05.12.2022	471.287	0,02 %
Kimberly-Clark Corp.	475.000	1,40 %	15.02.2019	470.968	0,02 %
Alphabet, Inc.	500.000	2,00 %	15.08.2026	470.789	0,02 %
Amgen, Inc.	450.000	3,88 %	15.11.2021	470.043	0,02 %
Bank of America Corp.	475.000	2,50 %	21.10.2022	469.913	0,02 %
Citigroup, Inc.	475.000	2,70 %	27.10.2022	469.858	0,02 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	450.000	4,30 %	01.05.2024	468.325	0,02 %
Nationwide Mutual Insurance Co.	275.000	9,38 %	15.08.2039	467.720	0,02 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	475.000	2,70 %	14.03.2023	466.652	0,02 %
Wells Fargo & Co.	475.000	2,10 %	26.07.2021	466.610	0,02 %
Ford Motor Credit Co. LLC	450.000	4,13 %	04.08.2025	465.985	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	460.000	3,13 %	16.03.2022	465.974	0,02 %
Gilead Sciences, Inc.	400.000	4,80 %	01.04.2044	463.579	0,02 %
QUALCOMM, Inc.	475.000	3,25 %	20.05.2027	463.537	0,02 %
Hartford Financial Services Group, Inc.	425.000	5,13 %	15.04.2022	463.445	0,02 %
Principal Financial Group, Inc.	455.000	3,40 %	15.05.2025	461.682	0,02 %
Anadarko Petroleum Corp.	375.000	6,45 %	15.09.2036	461.179	0,02 %
Procter & Gamble Co.	450.000	3,10 %	15.08.2023	460.858	0,02 %
Kraft Heinz Foods Co.	450.000	3,50 %	15.07.2022	460.145	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Bank of America Corp.	350.000	5,88 %	07.02.2042	459.619	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	400.000	4,95 %	01.06.2045	459.601	0,02 %
Apache Corp.	455.000	3,25 %	15.04.2022	458.347	0,02 %
NBCUniversal Media LLC	350.000	5,95 %	01.04.2041	456.867	0,02 %
Union Pacific Corp.	425.000	4,05 %	01.03.2046	456.834	0,02 %
CVS Health Corp.	450.000	3,50 %	20.07.2022	456.720	0,02 %
Chubb INA Holdings, Inc.	325.000	6,70 %	15.05.2036	456.085	0,02 %
UnitedHealth Group, Inc.	450.000	2,88 %	15.12.2021	455.888	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	450.000	3,45 %	10.04.2022	455.839	0,02 %
Morgan Stanley	425.000	4,30 %	27.01.2045	455.831	0,02 %
CCRE3 Commercial Mortgage Trust 2012	455.000	2,82 %	15.10.2045	455.746	0,02 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	458.000	2,63 %	17.01.2023	455.434	0,02 %
Apple, Inc.	450.000	3,00 %	09.02.2024	455.147	0,02 %
Amazon.com, Inc.	450.000	2,60 %	05.12.2019	454.612	0,02 %
Merck & Co., Inc.	410.000	4,15 %	18.05.2043	454.285	0,02 %
Discovery Communications LLC	450.000	3,30 %	15.05.2022	453.919	0,02 %
Bank of America Corp.	450.000	2,63 %	19.10.2020	453.454	0,02 %
Synchrony Financial	450.000	3,00 %	15.08.2019	453.270	0,02 %
New York Life Insurance Co.	315.000	6,75 %	15.11.2039	451.931	0,02 %
Caterpillar Financial Services Corp.	462.000	1,93 %	01.10.2021	451.766	0,02 %
Apple, Inc.	450.000	2,85 %	11.05.2024	451.437	0,02 %
Bank of America Corp.	425.000	4,13 %	22.01.2024	451.171	0,02 %
QUALCOMM, Inc.	450.000	3,45 %	20.05.2025	451.024	0,02 %
QUALCOMM, Inc.	450.000	3,00 %	20.05.2022	450.456	0,02 %
Time Warner, Inc.	450.000	3,60 %	15.07.2025	450.159	0,02 %
Ally Auto Receivables Trust 2017	453.000	1,75 %	15.12.2021	449.587	0,02 %
American International Group, Inc.	450.000	3,88 %	15.01.2035	449.537	0,02 %
Newell Brands Inc.	375.000	5,50 %	01.04.2046	449.283	0,02 %
Comcast Corp.	400.000	4,60 %	15.08.2045	449.023	0,02 %
Caterpillar, Inc.	421.000	3,80 %	15.08.2042	448.855	0,02 %
DR Horton, Inc.	400.000	5,75 %	15.08.2023	448.662	0,02 %
Ford Motor Credit Co. LLC	450.000	2,98 %	03.08.2022	448.404	0,02 %
Citizens Bank NA	450.000	2,55 %	13.05.2021	448.380	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	350.000	5,60 %	15.07.2041	448.364	0,02 %
Chevron Corp.	450.000	1,96 %	03.03.2020	448.213	0,02 %
Time Warner Cable LLC	375.000	6,75 %	15.06.2039	447.787	0,02 %
Caterpillar Financial Services Corp.	450.000	2,00 %	05.03.2020	447.727	0,02 %
Becton Dickinson and Co.	450.000	2,89 %	06.06.2022	447.575	0,02 %
Honeywell International, Inc.	350.000	5,38 %	01.03.2041	447.468	0,02 %
Kraft Heinz Foods Co.	465.000	3,00 %	01.06.2026	447.373	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.^	450.000	2,78 %	25.04.2023	447.343	0,02 %
Cardinal Health, Inc.	450.000	1,95 %	14.06.2019	447.292	0,02 %
Precision Castparts Corp.	450.000	2,50 %	15.01.2023	446.529	0,02 %
Kraft Heinz Foods Co.	405.000	5,20 %	15.07.2045	446.509	0,02 %
Home Depot, Inc.	400.000	4,25 %	01.04.2046	446.356	0,02 %
American Tower Corp.	420.000	5,05 %	01.09.2020	445.399	0,02 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	408.000	4,44 %	06.10.2048	445.340	0,02 %
American Express Credit Corp.	445.000	2,38 %	26.05.2020	444.645	0,02 %
Discover Bank	450.000	3,45 %	27.07.2026	443.929	0,02 %
ConocoPhillips Co.	450.000	2,40 %	15.12.2022	443.890	0,02 %
Visa, Inc.	400.000	4,15 %	14.12.2035	443.856	0,02 %
General Motors Co.	375.000	6,25 %	02.10.2043	442.105	0,02 %
Philip Morris International, Inc.	450.000	1,88 %	25.02.2021	441.879	0,02 %
Gilead Sciences, Inc.	450.000	2,95 %	01.03.2027	441.662	0,02 %
Norfolk Southern Corp.	325.000	7,80 %	15.05.2027	441.230	0,02 %
Devon Energy Corp.	375.000	5,60 %	15.07.2041	440.958	0,02 %
Swiss Re America Holding Corp.	360.000	7,00 %	15.02.2026	440.513	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	475.000	4,13 %	15.08.2046	439.012	0,02 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	450.000	3,75 %	15.07.2042	438.442	0,02 %
Crown Castle International Corp.	400.000	5,25 %	15.01.2023	437.941	0,02 %
Republic Services, Inc.	425.000	3,55 %	01.06.2022	437.871	0,02 %
Constellation Brands, Inc.	425.000	3,88 %	15.11.2019	436.579	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	425.000	4,00 %	15.01.2025	436.421	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	425.000	3,75 %	25.02.2026	435.980	0,02 %
Dell International LLC/EMC Corp.	345.000	8,10 %	15.07.2036	435.663	0,02 %
CVS Health Corp.	375.000	5,30 %	05.12.2043	435.620	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Kinder Morgan, Inc.	400.000	5,55 %	01.06.2045	435.536	0,02 %
Energy Transfer LP/Regency Energy Finance Corp.	400.000	5,88 %	01.03.2022	435.500	0,02 %
American International Group, Inc.	400.000	4,88 %	01.06.2022	434.299	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	425.000	4,75 %	01.11.2041	433.911	0,02 %
Oracle Corp.	425.000	2,80 %	08.07.2021	432.210	0,02 %
Devon Financing Co. LLC	315.000	7,88 %	30.09.2031	431.920	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	425.000	2,87 %	25.12.2021	431.804	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	400.000	6,00 %	15.06.2020	431.786	0,02 %
CVS Health Corp.	450.000	2,88 %	01.06.2026	431.736	0,02 %
AT&T, Inc.	460.000	4,55 %	09.03.2049	430.630	0,02 %
Western Digital Corp.	400.000	7,38 %	01.04.2023	430.500	0,02 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	330.000	5,75 %	01.05.2040	429.603	0,02 %
Conagra Brands, Inc.	424.000	3,20 %	25.01.2023	428.453	0,02 %
Intel Corp.	425.000	2,45 %	29.07.2020	427.863	0,02 %
Forest Laboratories LLC	400.000	5,00 %	15.12.2021	427.358	0,02 %
AT&T, Inc.	425.000	2,85 %	14.02.2023	426.508	0,02 %
AT&T, Inc.	454.000	4,30 %	15.12.2042	425.968	0,02 %
Citigroup, Inc.	425.000	2,50 %	29.07.2019	425.951	0,02 %
Berkshire Hathaway, Inc.	425.000	2,10 %	14.08.2019	425.917	0,02 %
Anthem, Inc.	400.000	4,38 %	01.12.2047	425.738	0,02 %
Wells Fargo & Co.	400.000	4,30 %	22.07.2027	425.638	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	400.000	4,60 %	01.04.2021	425.561	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	425.000	2,60 %	23.04.2020	425.462	0,02 %
BB&T Corp.	405.000	5,25 %	01.11.2019	425.331	0,02 %
Ecolab, Inc.	425.000	3,25 %	01.12.2027	425.189	0,02 %
Express Scripts Holding Co.	400.000	4,80 %	15.07.2046	424.926	0,02 %
American International Group, Inc.	425.000	2,30 %	16.07.2019	424.742	0,02 %
New Jersey Turnpike Authority	275.000	7,41 %	01.01.2040	424.468	0,02 %
Time Warner Cable LLC	340.000	7,30 %	01.07.2038	424.224	0,02 %
Wells Fargo & Co.	425.000	2,15 %	30.01.2020	424.063	0,02 %
AT&T, Inc.	400.000	5,88 %	01.10.2019	423.853	0,02 %
Morgan Stanley	400.000	5,50 %	26.01.2020	423.828	0,02 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	400.000	5,38 %	15.01.2020	423.565	0,02 %
Biogen, Inc.	400.000	4,05 %	15.09.2025	423.462	0,02 %
NBCUniversal Media LLC	400.000	4,38 %	01.04.2021	423.288	0,02 %
GM Financial Automobile Leasing Trust 2017	425.000	2,12 %	20.09.2021	423.152	0,02 %
Procter & Gamble Co. ¹	425.000	2,30 %	06.02.2022	423.107	0,02 %
Bank of America Corp.	420.000	2,63 %	19.04.2021	422.143	0,02 %
Wal-Mart Stores, Inc.	310.000	5,63 %	15.04.2041	421.917	0,02 %
Microsoft Corp.	400.000	3,75 %	12.02.2045	421.464	0,02 %
Discovery Communications LLC	425.000	3,95 %	20.03.2028	420.947	0,02 %
US Bancorp	400.000	3,70 %	30.01.2024	420.103	0,02 %
Bank of America Corp.	425.000	3,25 %	21.10.2027	419.834	0,02 %
PepsiCo, Inc.	400.000	3,60 %	01.03.2024	419.730	0,02 %
Loews Corp.	425.000	2,63 %	15.05.2023	419.541	0,02 %
Kroger Co.	450.000	2,65 %	15.10.2026	419.511	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	400.000	4,25 %	15.10.2020	419.368	0,02 %
Omnicom Group, Inc.	400.000	4,45 %	15.08.2020	419.121	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	400.000	4,81 %	15.03.2039	418.376	0,02 %
Allergan Funding SCS	393.000	4,75 %	15.03.2045	417.660	0,02 %
EOG Resources, Inc.	400.000	4,10 %	01.02.2021	417.332	0,02 %
Newell Brands Inc.	400.000	4,20 %	01.04.2026	417.132	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	410.000	3,13 %	25.06.2021	416.609	0,02 %
Pfizer, Inc.	375.000	4,13 %	15.12.2046	416.431	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	325.000	6,45 %	01.05.2036	416.089	0,02 %
Apple, Inc.	425.000	3,45 %	09.02.2045	415.185	0,02 %
Los Angeles Unified School District	325.000	5,75 %	01.07.2034	414.437	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	325.000	6,13 %	15.02.2033	414.074	0,02 %
JPMorgan Chase & Co. [^]	400.000	4,03 %	24.07.2048	413.835	0,02 %
Appalachian Power Co.	290.000	7,00 %	01.04.2038	413.292	0,02 %
Enterprise Products Operating LLC	400.000	4,45 %	15.02.2043	412.687	0,02 %
Ford Motor Credit Co. LLC	375.000	5,88 %	02.08.2021	410.770	0,02 %
Halliburton Co.	400.000	3,50 %	01.08.2023	410.512	0,02 %
United Parcel Service, Inc.	300.000	6,20 %	15.01.2038	409.433	0,02 %
HCP, Inc.	400.000	3,88 %	15.08.2024	409.149	0,02 %
Air Lease Corp.	400.000	3,38 %	01.06.2021	408.281	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Newmont Mining Corp.	400.000	3,50 %	15.03.2022	407.909	0,02 %
Regions Financial Corp.	400.000	3,20 %	08.02.2021	407.004	0,02 %
DBJPM 17-C6 Mortgage Trust	400.000	3,33 %	10.06.2050	406.992	0,02 %
Abbott Laboratories	400.000	3,40 %	30.11.2023	406.974	0,02 %
Lockheed Martin Corp.	350.000	4,70 %	15.05.2046	406.817	0,02 %
Chicago Transit Authority	300.000	6,90 %	01.12.2040	406.767	0,02 %
Cisco Systems, Inc.	400.000	2,90 %	04.03.2021	406.617	0,02 %
Pacific Gas & Electric Co.	325.000	5,80 %	01.03.2037	406.577	0,02 %
Bayer US Finance LLC	400.000	3,38 %	08.10.2024	406.544	0,02 %
Goldman Sachs Capital I	325.000	6,35 %	15.02.2034	406.250	0,02 %
Kaiser Foundation Hospitals	375.000	4,15 %	01.05.2047	406.176	0,02 %
PNC Bank NA	400.000	3,25 %	01.06.2025	406.154	0,02 %
Ford Motor Credit Co. LLC	400.000	3,34 %	18.03.2021	406.128	0,02 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	400.000	4,20 %	15.03.2028	406.000	0,02 %
Time Warner, Inc.	400.000	3,88 %	15.01.2026	405.811	0,02 %
Wells Fargo & Co.	400.000	3,30 %	09.09.2024	405.644	0,02 %
Ford Motor Credit Co. LLC	400.000	3,20 %	15.01.2021	405.643	0,02 %
Citigroup, Inc.	400.000	3,38 %	01.03.2023	405.538	0,02 %
McCormick & Co., Inc.	400.000	3,40 %	15.08.2027	405.425	0,02 %
eBay, Inc.	400.000	3,45 %	01.08.2024	405.065	0,02 %
American International Group, Inc.	375.000	4,50 %	16.07.2044	404.956	0,02 %
City of Chicago II	350.000	7,38 %	01.01.2033	404.943	0,02 %
Westlake Chemical Corp.	400.000	3,60 %	15.08.2026	404.594	0,02 %
Intel Corp.	400.000	2,70 %	15.12.2022	403.985	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	400.000	3,20 %	06.07.2021	403.813	0,02 %
Chubb INA Holdings, Inc.	400.000	2,88 %	03.11.2022	403.783	0,02 %
Bayer US Finance LLC	400.000	3,00 %	08.10.2021	403.700	0,02 %
KeyCorp	400.000	2,90 %	15.09.2020	403.424	0,02 %
International Business Machines Corp.	400.000	2,88 %	09.11.2022	403.251	0,02 %
Morgan Stanley	375.000	4,88 %	01.11.2022	403.186	0,02 %
Northrop Grumman Corp.	350.000	4,75 %	01.06.2043	403.045	0,02 %
State Street Corp.	400.000	2,55 %	18.08.2020	402.234	0,02 %
Duke Energy Florida LLC	415.000	3,40 %	01.10.2046	402.096	0,02 %
Citigroup, Inc.	400.000	2,65 %	26.10.2020	401.950	0,02 %
Altria Group, Inc.	375.000	4,75 %	05.05.2021	401.797	0,02 %
Eli Lilly & Co.	400.000	2,75 %	01.06.2025	401.746	0,02 %
Coca-Cola Co.	400.000	2,88 %	27.10.2025	401.680	0,02 %
Comcast Corp.	400.000	3,15 %	15.02.2028	401.538	0,02 %
PepsiCo, Inc.	400.000	2,25 %	07.01.2019	401.064	0,02 %
Bayer US Finance LLC	400.000	2,38 %	08.10.2019	400.695	0,02 %
21st Century Fox America, Inc.	300.000	6,40 %	15.12.2035	400.198	0,02 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. ¹	400.000	2,15 %	01.02.2019	400.069	0,02 %
Ford Motor Credit Co. LLC	400.000	2,38 %	12.03.2019	400.000	0,02 %
Microsoft Corp.	400.000	2,40 %	06.02.2022	399.923	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	400.000	2,09 %	25.03.2019	399.916	0,02 %
Pricoa Global Funding I	400.000	2,20 %	16.05.2019	399.711	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	375.000	4,63 %	10.05.2021	399.317	0,02 %
Time Warner, Inc.	400.000	3,80 %	15.02.2027	399.240	0,02 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	400.000	1,74 %	19.01.2021	399.198	0,02 %
PepsiCo, Inc.	400.000	2,15 %	14.10.2020	399.148	0,02 %
Santander Holdings USA, Inc.	400.000	2,65 %	17.04.2020	399.031	0,02 %
American Express Co.	400.000	3,00 %	30.10.2024	399.008	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	350.000	5,50 %	16.03.2047	398.845	0,02 %
Branch Banking & Trust Co.	400.000	2,10 %	15.01.2020	398.663	0,02 %
McDonald's Corp.	300.000	6,30 %	01.03.2038	398.661	0,02 %
PepsiCo, Inc.	400.000	3,00 %	15.10.2027	398.493	0,02 %
Gilead Sciences, Inc.	375.000	4,50 %	01.04.2021	398.044	0,02 %
Exxon Mobil Corp.	400.000	2,71 %	06.03.2025	397.611	0,02 %
Procter & Gamble Co.	400.000	1,90 %	23.10.2020	397.514	0,02 %
Chevron Corp.	400.000	1,56 %	16.05.2019	397.460	0,02 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	375.000	6,35 %	15.10.2045	397.142	0,02 %
American Express Co.	400.000	2,20 %	30.10.2020	396.860	0,02 %
Dow Chemical Co.	380.000	4,25 %	15.11.2020	396.679	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc. [^]	400.000	2,91 %	05.06.2023	396.644	0,02 %
Northrop Grumman Corp.	400.000	2,55 %	15.10.2022	396.522	0,02 %
Colgate-Palmolive Co.	400.000	2,25 %	15.11.2022	396.076	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Capital One Na	400.000	2,65 %	08.08.2022	395.852	0,02 %
Amazon.com, Inc.	400.000	2,40 %	22.02.2023	395.702	0,02 %
Federal National Mortgage Association^	400.000	2,78 %	25.02.2027	395.688	0,02 %
Brandywine Operating Partnership LP	400.000	3,95 %	15.11.2027	395.654	0,02 %
Comcast Corp.	364.000	4,25 %	15.01.2033	395.555	0,02 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	400.000	3,45 %	01.06.2026	395.543	0,02 %
American Water Capital Corp.	375.000	3,85 %	01.03.2024	395.383	0,02 %
Schlumberger Investment SA	400.000	2,40 %	01.08.2022	395.219	0,02 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.¹	400.000	1,50 %	01.11.2019	394.772	0,02 %
Comcast Corp.	350.000	4,65 %	15.07.2042	394.593	0,02 %
EOG Resources, Inc.	400.000	2,63 %	15.03.2023	394.437	0,02 %
CNA Financial Corp.	400.000	3,45 %	15.08.2027	394.183	0,02 %
Lockheed Martin Corp.	375.000	4,07 %	15.12.2042	394.095	0,02 %
Wells Fargo & Co.	375.000	4,13 %	15.08.2023	394.029	0,02 %
NVR, Inc.	375.000	3,95 %	15.09.2022	392.429	0,02 %
Southern Co.	400.000	3,25 %	01.07.2026	392.289	0,02 %
Duke Energy Indiana LLC	300.000	6,12 %	15.10.2035	391.940	0,02 %
Comcast Cable Communications Holdings, Inc.	300.000	9,46 %	15.11.2022	391.906	0,02 %
Citigroup, Inc.	312.000	6,13 %	25.08.2036	391.646	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	375.000	3,46 %	25.08.2023	391.534	0,02 %
Brighthouse Financial Inc.	400.000	3,70 %	22.06.2027	391.527	0,02 %
Xcel Energy, Inc.	375.000	4,70 %	15.05.2020	391.280	0,02 %
Cigna Corp.	375.000	4,00 %	15.02.2022	391.116	0,02 %
CVS Health Corp.	400.000	2,13 %	01.06.2021	390.781	0,02 %
Boston Properties LP	375.000	3,85 %	01.02.2023	390.717	0,02 %
Apple, Inc.	400.000	2,50 %	09.02.2025	390.688	0,02 %
Fiserv, Inc.	375.000	3,85 %	01.06.2025	390.095	0,02 %
QUALCOMM, Inc.	400.000	2,90 %	20.05.2024	390.077	0,02 %
Bank of America NA	300.000	6,00 %	15.10.2036	389.197	0,02 %
Wal-Mart Stores, Inc.	375.000	3,30 %	22.04.2024	388.955	0,02 %
ERAC USA Finance LLC	400.000	2,70 %	01.11.2023	388.802	0,02 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	350.000	6,25 %	15.03.2022	388.063	0,02 %
Enable Midstream Partners LP	390.000	2,40 %	15.05.2019	387.849	0,02 %
Welltower, Inc.	375.000	4,00 %	01.06.2025	387.275	0,02 %
Amazon.com, Inc.	375.000	3,30 %	05.12.2021	386.922	0,02 %
Oracle Corp.	275.000	6,50 %	15.04.2038	386.914	0,02 %
Wells Fargo & Co.	375.000	3,90 %	01.05.2045	386.812	0,02 %
Kinder Morgan, Inc.	300.000	7,80 %	01.08.2031	386.754	0,02 %
Sierra Pacific Power Co.	400.000	2,60 %	01.05.2026	386.141	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	375.000	3,95 %	13.04.2024	385.612	0,02 %
Fluor Corp.	375.000	3,50 %	15.12.2024	384.913	0,02 %
Municipal Electric Authority of Georgia	300.000	6,64 %	01.04.2057	384.552	0,02 %
John Deere Capital Corp.	375.000	3,15 %	15.10.2021	384.084	0,02 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates^	375.000	3,06 %	25.08.2024	383.426	0,02 %
Dominion Energy, Inc.	392.000	2,00 %	15.08.2021	383.201	0,02 %
MUFG Americas Holdings Corp.	375.000	3,50 %	18.06.2022	382.890	0,02 %
Anadarko Petroleum Corp.	300.000	6,60 %	15.03.2046	382.766	0,02 %
Lowe's Cos, Inc.	400.000	2,50 %	15.04.2026	382.733	0,02 %
PepsiCo, Inc.	375.000	3,00 %	25.08.2021	382.607	0,02 %
Intel Corp.	350.000	4,10 %	19.05.2046	382.366	0,02 %
LYB International Finance BV	350.000	4,88 %	15.03.2044	381.791	0,02 %
Baker Hughes a GE Co. LLC	325.000	5,13 %	15.09.2040	381.700	0,02 %
Prudential Financial, Inc.^	350.000	5,63 %	15.06.2043	381.500	0,02 %
Duke Energy Carolinas LLC	385.000	2,50 %	15.03.2023	381.378	0,02 %
John Deere Capital Corp.	370.000	3,35 %	12.06.2024	380.935	0,02 %
Amgen, Inc.	343.000	4,56 %	15.06.2048	380.453	0,02 %
Los Angeles Unified School District	275.000	6,76 %	01.07.2034	379.808	0,02 %
Commonwealth Edison Co.	375.000	3,65 %	15.06.2046	379.403	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	375.000	3,20 %	13.07.2020	379.193	0,02 %
Federal National Mortgage Association^	375.000	3,08 %	25.06.2027	379.106	0,02 %
21st Century Fox America, Inc.	275.000	6,65 %	15.11.2037	378.721	0,02 %
Time Warner Entertainment Co. LP	275.000	8,38 %	15.07.2033	378.692	0,02 %
Owens Corning	360.000	4,20 %	15.12.2022	377.285	0,02 %
ConocoPhillips Co.	360.000	4,20 %	15.03.2021	376.704	0,02 %
McDonald's Corp.	325.000	4,88 %	09.12.2045	376.562	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	375.000	2,97 %	15.01.2023	376.556	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
JPMorgan Chase & Co.	300.000	5,40 %	06.01.2042	376.507	0,02 %
Northrop Grumman Corp.	360.000	4,03 %	15.10.2047	376.399	0,02 %
Marathon Petroleum Corp.	300.000	6,50 %	01.03.2041	375.536	0,02 %
Eaton Corp.	375.000	2,75 %	02.11.2022	375.419	0,02 %
Celgene Corp.	325.000	5,25 %	15.08.2043	375.206	0,02 %
Allergan Funding SCS	350.000	4,85 %	15.06.2044	375.136	0,02 %
Nissan Auto Receivables 2017-B Owner Trust	378.000	1,75 %	15.10.2021	375.086	0,02 %
Public Service Enterprise Group, Inc.	381.000	1,60 %	15.11.2019	375.034	0,02 %
Viacom, Inc.	435.000	4,38 %	15.03.2043	374.861	0,02 %
VMware, Inc.	375.000	2,95 %	21.08.2022	374.272	0,02 %
Citigroup, Inc.	375.000	2,40 %	18.02.2020	374.232	0,02 %
Becton Dickinson and Co.	375.000	2,13 %	06.06.2019	374.213	0,02 %
Occidental Petroleum Corp.	375.000	2,70 %	15.02.2023	373.844	0,02 %
Walt Disney Co.	375.000	1,95 %	04.03.2020	373.738	0,02 %
American Express Credit Corp.	375.000	1,88 %	03.05.2019	373.633	0,02 %
Gilead Sciences, Inc.	375.000	1,85 %	20.09.2019	373.458	0,02 %
QUALCOMM, Inc.	345.000	4,80 %	20.05.2045	372.950	0,02 %
Amgen, Inc.	375.000	2,13 %	01.05.2020	372.935	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	372.000	3,38 %	15.02.2025	372.930	0,02 %
Lowe's Cos, Inc.	350.000	4,05 %	03.05.2047	372.892	0,02 %
Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017	360.000	3,57 %	15.02.2050	372.528	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	300.000	5,63 %	16.08.2043	372.381	0,02 %
Bank of America Corp.	352.000	4,00 %	01.04.2024	372.010	0,02 %
Viacom, Inc.	325.000	6,88 %	30.04.2036	371.936	0,02 %
Comcast Corp.	350.000	5,15 %	01.03.2020	371.596	0,02 %
Baxalta, Inc.	320.000	5,25 %	23.06.2045	371.361	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	350.000	4,25 %	01.10.2027	371.071	0,02 %
International Business Machines Corp.	352.000	4,00 %	20.06.2042	371.011	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	370.000	3,50 %	16.11.2026	370.986	0,02 %
Williams Partners LP	350.000	4,50 %	15.11.2023	369.837	0,02 %
Bay Area Toll Authority	250.000	6,26 %	01.04.2049	369.330	0,02 %
Charles Schwab Corp.	350.000	4,45 %	22.07.2020	369.004	0,02 %
Jefferies Group LLC	330.000	6,88 %	15.04.2021	368.889	0,02 %
LyondellBasell Industries NV	325.000	5,75 %	15.04.2024	368.875	0,02 %
HP, Inc.	350.000	4,38 %	15.09.2021	368.546	0,02 %
PepsiCo, Inc.	325.000	4,45 %	14.04.2046	367.889	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp	375.000	2,57 %	25.07.2026	367.459	0,02 %
Ascension Health	350.000	3,95 %	15.11.2046	367.435	0,02 %
Crown Castle International Corp.	350.000	4,45 %	15.02.2026	367.384	0,02 %
Ryder System, Inc.	365.000	2,88 %	01.09.2020	367.380	0,02 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015	370.000	3,41 %	15.05.2048	367.373	0,02 %
United Technologies Corp.	350.000	4,50 %	15.04.2020	367.030	0,02 %
General Motors Co.	350.000	5,20 %	01.04.2045	367.010	0,02 %
HSBC Bank USA NA	250.000	7,00 %	15.01.2039	366.298	0,02 %
Ford Motor Credit Co. LLC	350.000	4,39 %	08.01.2026	366.233	0,02 %
American Airlines 2013-2 Klasse A Pass Through Trust	346.503	4,95 %	15.01.2023	365.790	0,02 %
Merck & Co., Inc.	350.000	3,88 %	15.01.2021	365.383	0,02 %
Bank One Capital III	250.000	8,75 %	01.09.2030	365.332	0,02 %
Time Warner Cable LLC	350.000	5,50 %	01.09.2041	365.309	0,02 %
Abbott Laboratories	325.000	4,75 %	30.11.2036	365.249	0,02 %
McDonald's Corp.	350.000	3,70 %	30.01.2026	364.781	0,02 %
Fidelity National Information Services, Inc.	355.000	3,63 %	15.10.2020	364.421	0,02 %
Microsoft Corp.	375.000	2,00 %	08.08.2023	364.403	0,02 %
PepsiCo, Inc.	375.000	3,45 %	06.10.2046	364.060	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	350.000	4,35 %	17.01.2027	363.940	0,02 %
Capital One Bank USA NA	360.000	3,38 %	15.02.2023	363.585	0,02 %
Monsanto Co.	350.000	4,20 %	15.07.2034	363.407	0,02 %
Energy Transfer LP	350.000	4,75 %	15.01.2026	363.382	0,02 %
Microsoft Corp.	350.000	3,50 %	12.02.2035	363.098	0,02 %
American International Group, Inc.	350.000	3,90 %	01.04.2026	363.044	0,02 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014	350.000	3,60 %	15.06.2047	362.247	0,02 %
KKR Group Finance Co. III LLC	330.000	5,13 %	01.06.2044	362.008	0,02 %
Kraft Heinz Foods Co.	360.000	2,80 %	02.07.2020	361.913	0,02 %
Stryker Corp.	350.000	3,50 %	15.03.2026	361.225	0,02 %
Citigroup, Inc.	350.000	4,13 %	25.07.2028	360.906	0,02 %
UnitedHealth Group, Inc.	250.000	6,88 %	15.02.2038	360.857	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
State of Connecticut	300.000	5,85 %	15.03.2032	360.798	0,02 %
Gilead Sciences, Inc.	350.000	3,50 %	01.02.2025	360.753	0,02 %
Federal National Mortgage Association^	350.000	3,33 %	25.10.2023	360.360	0,02 %
Enterprise Products Operating LLC	350.000	3,75 %	15.02.2025	360.256	0,02 %
General Electric Co.	355.000	3,10 %	09.01.2023	360.206	0,02 %
Capital One Financial Corp.	350.000	4,20 %	29.10.2025	359.907	0,02 %
Constellation Brands, Inc.	350.000	3,70 %	06.12.2026	359.800	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	347.000	3,30 %	25.04.2023	359.273	0,02 %
Gilead Sciences, Inc.	350.000	3,25 %	01.09.2022	358.916	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	342.000	3,53 %	25.07.2023	358.443	0,02 %
Enterprise Products Operating LLC	350.000	3,70 %	15.02.2026	357.772	0,02 %
Fluor Corp.	350.000	3,38 %	15.09.2021	357.578	0,02 %
Williams Partners LP	350.000	3,90 %	15.01.2025	357.464	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	350.000	3,70 %	09.05.2023	357.111	0,02 %
Comcast Corp.	350.000	3,30 %	01.02.2027	357.042	0,02 %
Marriott International, Inc.	350.000	3,38 %	15.10.2020	356.860	0,02 %
Brighthouse Financial Inc.	350.000	4,70 %	22.06.2047	356.567	0,02 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	345.000	3,50 %	01.02.2025	355.822	0,02 %
Willis North America, Inc.	350.000	3,60 %	15.05.2024	355.483	0,02 %
Enterprise Products Operating LLC	275.000	6,65 %	15.10.2034	354.251	0,02 %
Santander Holdings USA, Inc.	350.000	3,70 %	28.03.2022	354.032	0,02 %
Omnicom Group, Inc.	350.000	3,60 %	15.04.2026	353.882	0,02 %
Sherwin-Williams Co.	355.000	2,25 %	15.05.2020	353.867	0,02 %
Microsoft Corp.	350.000	2,38 %	12.02.2022	353.563	0,02 %
Federal National Mortgage Association^	350.000	3,14 %	25.11.2027	353.286	0,02 %
Celgene Corp.	350.000	2,88 %	15.08.2020	353.220	0,02 %
Gilead Sciences, Inc.	350.000	2,55 %	01.09.2020	353.063	0,02 %
United Technologies Corp.	275.000	6,05 %	01.06.2036	352.827	0,02 %
Simon Property Group LP	350.000	3,38 %	15.06.2027	352.553	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	340.000	3,31 %	25.05.2023	352.532	0,02 %
Merck & Co., Inc.	350.000	2,80 %	18.05.2023	352.351	0,02 %
Intel Corp.	350.000	2,88 %	11.05.2024	352.323	0,02 %
Eastman Chemical Co.	350.000	2,70 %	15.01.2020	352.285	0,02 %
CBRE Services, Inc.	325.000	4,88 %	01.03.2026	352.282	0,02 %
QUALCOMM, Inc.	350.000	4,30 %	20.05.2047	352.100	0,02 %
SunTrust Banks, Inc.	350.000	2,90 %	03.03.2021	352.080	0,02 %
Altria Group, Inc.	350.000	2,85 %	09.08.2022	351.879	0,02 %
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC	360.000	3,20 %	23.09.2026	351.764	0,02 %
KLA-Tencor Corp.	325.000	4,65 %	01.11.2024	351.521	0,02 %
Time Warner, Inc.	350.000	4,65 %	01.06.2044	351.408	0,02 %
Southern California Edison Co.	300.000	4,65 %	01.10.2043	351.241	0,02 %
Mylan NV	325.000	5,25 %	15.06.2046	351.071	0,02 %
Jefferies Group LLC	325.000	5,13 %	20.01.2023	350.917	0,02 %
HSBC USA, Inc.	350.000	2,25 %	23.06.2019	350.839	0,02 %
Johnson & Johnson	350.000	2,90 %	15.01.2028	350.750	0,02 %
KeyBank NA	350.000	2,35 %	08.03.2019	350.548	0,02 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	350.000	2,70 %	01.04.2020	350.531	0,02 %
Capital One Financial Corp.	350.000	2,45 %	24.04.2019	350.488	0,02 %
PNC Bank NA	350.000	2,40 %	18.10.2019	350.384	0,02 %
Apple, Inc.	350.000	2,50 %	09.02.2022	350.339	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	350.000	2,40 %	09.05.2019	349.978	0,02 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	350.000	1,73 %	09.04.2020	349.925	0,02 %
Chase Issuance Trust	350.000	1,36 %	15.04.2020	349.640	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	350.000	3,15 %	30.06.2022	349.531	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	350.000	2,63 %	25.04.2021	349.489	0,02 %
Capital One Financial Corp.	350.000	2,50 %	12.05.2020	349.467	0,02 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	350.000	2,70 %	15.02.2023	349.418	0,02 %
Exxon Mobil Corp.	350.000	2,22 %	01.03.2021	349.350	0,02 %
Bank of America Corp.^	350.000	2,82 %	21.07.2023	349.312	0,02 %
Celgene Corp.	350.000	2,25 %	15.05.2019	349.233	0,02 %
LC19 Commercial Mortgage Trust 2015	345.000	3,18 %	10.02.2048	349.054	0,02 %
American Express Credit Corp.	350.000	2,20 %	03.03.2020	348.827	0,02 %
Capital One Na	350.000	2,35 %	31.01.2020	348.790	0,02 %
Raytheon Co.	350.000	2,50 %	15.12.2022	348.629	0,02 %
Xerox Corp.	350.000	2,80 %	15.05.2020	348.572	0,02 %
BA Credit Card Trust	350.000	1,95 %	15.08.2022	348.466	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Walgreens Boots Alliance, Inc.	325.000	4,80 %	18.11.2044	348.365	0,02 %
American Express Credit Account Master Trust	350.000	1,93 %	15.09.2022	348.360	0,02 %
Microsoft Corp.	350.000	1,85 %	12.02.2020	348.353	0,02 %
Citigroup, Inc.^	350.000	2,88 %	24.07.2023	348.276	0,02 %
Morgan Stanley	325.000	5,50 %	24.07.2020	348.269	0,02 %
Wal-Mart Stores, Inc.	350.000	2,35 %	15.12.2022	348.124	0,02 %
Kellogg Co.	350.000	3,25 %	01.04.2026	348.123	0,02 %
Apple, Inc.	350.000	3,00 %	13.11.2027	348.085	0,02 %
Reliance Standard Life Global Funding II	350.000	2,38 %	04.05.2020	347.993	0,02 %
MetLife, Inc.	300.000	4,72 %	15.12.2044	347.966	0,02 %
AT&T, Inc.	325.000	5,00 %	01.03.2021	347.954	0,02 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	350.000	1,99 %	17.07.2023	347.820	0,02 %
Coca-Cola Co.	350.000	1,88 %	27.10.2020	347.674	0,02 %
Capital One Financial Corp.	350.000	3,75 %	28.07.2026	347.598	0,02 %
Amazon.com, Inc.	350.000	1,90 %	21.08.2020	347.511	0,02 %
United Parcel Service, Inc.	350.000	2,50 %	01.04.2023	347.408	0,02 %
Bank of America Corp.	350.000	2,15 %	09.11.2020	347.332	0,02 %
Chevron Corp.	350.000	2,10 %	16.05.2021	347.237	0,02 %
Apple, Inc.	350.000	2,75 %	13.01.2025	347.224	0,02 %
Capital One Financial Corp.	325.000	4,75 %	15.07.2021	346.716	0,02 %
eBay, Inc.	350.000	2,60 %	15.07.2022	346.674	0,02 %
Northrop Grumman Corp.	350.000	2,93 %	15.01.2025	346.566	0,02 %
MetLife, Inc.	300.000	6,40 %	15.12.2036	346.500	0,02 %
Apple, Inc.	350.000	1,10 %	02.08.2019	346.451	0,02 %
Microsoft Corp.	350.000	1,85 %	06.02.2020	346.382	0,02 %
Honeywell International, Inc.	350.000	1,40 %	30.10.2019	346.234	0,02 %
US Bancorp	350.000	3,10 %	27.04.2026	346.079	0,02 %
Travelers Cos, Inc.	300.000	4,60 %	01.08.2043	345.850	0,02 %
Weyerhaeuser Co.	250.000	7,38 %	15.03.2032	345.204	0,02 %
WestRock MWV LLC	250.000	7,95 %	15.02.2031	345.196	0,02 %
Cardinal Health, Inc.	350.000	3,08 %	15.06.2024	344.446	0,02 %
Home Depot, Inc.	325.000	4,40 %	01.04.2021	344.382	0,02 %
PPL Capital Funding, Inc.	325.000	4,20 %	15.06.2022	343.704	0,02 %
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016	350.000	2,87 %	15.08.2049	343.535	0,02 %
Apple, Inc.	300.000	4,50 %	23.02.2036	343.348	0,02 %
Walt Disney Co.	375.000	1,85 %	30.07.2026	343.020	0,02 %
Oracle Corp.	250.000	6,13 %	08.07.2039	342.412	0,02 %
Cardinal Health, Inc.	350.000	3,41 %	15.06.2027	342.388	0,02 %
Phillips 66	300.000	4,88 %	15.11.2044	341.719	0,02 %
Molson Coors Brewing Co.	300.000	5,00 %	01.05.2042	341.615	0,02 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	325.000	4,40 %	15.10.2022	341.498	0,02 %
Time Warner, Inc.	325.000	4,88 %	15.03.2020	341.348	0,02 %
Dow Chemical Co.	200.000	9,40 %	15.05.2039	341.055	0,02 %
American Municipal Power, Inc.	200.000	8,08 %	15.02.2050	340.850	0,02 %
LyondellBasell Industries NV	332.000	5,00 %	15.04.2019	340.821	0,02 %
QUALCOMM, Inc.	350.000	2,60 %	30.01.2023	340.793	0,02 %
Enterprise Products Operating LLC	300.000	5,10 %	15.02.2045	340.635	0,02 %
ConocoPhillips Co.	300.000	4,95 %	15.03.2026	340.495	0,02 %
BB&T Corp.	340.000	2,25 %	01.02.2019	340.389	0,02 %
Pacific Gas & Electric Co.	350.000	2,95 %	01.03.2026	340.201	0,02 %
Anadarko Finance Co.	265.000	7,50 %	01.05.2031	339.853	0,02 %
State Board of Administration Finance Corp.	335.000	3,00 %	01.07.2020	339.385	0,02 %
Wells Fargo & Co.	300.000	4,90 %	17.11.2045	339.351	0,02 %
Celgene Corp.	300.000	5,00 %	15.08.2045	339.329	0,02 %
Cisco Systems, Inc.	350.000	2,50 %	20.09.2026	339.163	0,02 %
Noble Energy, Inc.	325.000	4,15 %	15.12.2021	339.108	0,02 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	250.000	6,15 %	01.05.2037	338.499	0,02 %
Fidelity National Information Services, Inc.	350.000	3,00 %	15.08.2026	338.479	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	338.224	3,15 %	25.02.2018	338.167	0,02 %
Williams Partners LP	300.000	5,40 %	04.03.2044	338.074	0,02 %
FedEx Corp.	300.000	4,75 %	15.11.2045	337.951	0,02 %
State of California	225.000	7,35 %	01.11.2039	337.662	0,02 %
Comcast Corp.	250.000	6,50 %	15.11.2035	337.613	0,02 %
Bank of New York Mellon Corp.	325.000	3,55 %	23.09.2021	337.000	0,02 %
Wal-Mart Stores, Inc.	339.000	1,90 %	15.12.2020	336.782	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	325.000	3,32 %	25.02.2023	336.297	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	325.000	3,25 %	25.04.2023	336.118	0,02 %
Zoetis, Inc.	300.000	4,70 %	01.02.2043	335.915	0,02 %
International Business Machines Corp.	325.000	3,38 %	01.08.2023	335.693	0,02 %
Andeavor	325.000	5,38 %	01.10.2022	335.563	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	335.000	2,65 %	13.04.2020	334.854	0,02 %
Celgene Corp.	325.000	3,63 %	15.05.2024	334.128	0,02 %
Oracle Corp.	300.000	4,38 %	15.05.2055	334.020	0,02 %
HollyFrontier Corp.	300.000	5,88 %	01.04.2026	333.928	0,02 %
Anthem, Inc.	300.000	4,65 %	15.08.2044	333.845	0,02 %
CGMS Commercial Mortgage Trust 2017	325.000	3,46 %	15.08.2050	333.690	0,02 %
LyondellBasell Industries NV	300.000	6,00 %	15.11.2021	333.487	0,02 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	210.000	8,20 %	15.01.2039	333.254	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	325.000	3,70 %	24.11.2020	332.891	0,02 %
Lockheed Martin Corp.	330.000	2,50 %	23.11.2020	332.485	0,02 %
Southern Copper Corp.	275.000	5,88 %	23.04.2045	332.441	0,02 %
AvalonBay Communities, Inc.	325.000	3,45 %	01.06.2025	332.378	0,02 %
AT&T, Inc.	325.000	3,95 %	15.01.2025	331.716	0,02 %
Molson Coors Brewing Co.	325.000	4,20 %	15.07.2046	331.328	0,02 %
VWV Grainger, Inc.	300.000	4,60 %	15.06.2045	331.248	0,02 %
PPL Capital Funding, Inc.	325.000	3,40 %	01.06.2023	331.204	0,02 %
Berkshire Hathaway, Inc.	325.000	3,00 %	11.02.2023	330.944	0,02 %
Western Gas Partners LP	325.000	4,00 %	01.07.2022	330.827	0,02 %
Devon Energy Corp.	325.000	3,25 %	15.05.2022	330.634	0,02 %
Philip Morris International, Inc.	325.000	3,25 %	10.11.2024	330.507	0,02 %
VMware, Inc.	325.000	3,90 %	21.08.2027	330.363	0,02 %
Realty Income Corp.	325.000	3,25 %	15.10.2022	330.260	0,02 %
Zoetis, Inc.	325.000	3,25 %	01.02.2023	330.104	0,02 %
Bank 2018-BNK ³	321.000	3,52 %	15.07.2060	330.094	0,02 %
Eli Lilly & Co.	325.000	3,10 %	15.05.2027	329.638	0,02 %
Duke Energy Carolinas LLC	250.000	6,10 %	01.06.2037	329.511	0,02 %
Royal Caribbean Cruises Ltd.	300.000	5,25 %	15.11.2022	329.250	0,02 %
Wachovia Corp.	275.000	5,50 %	01.08.2035	329.216	0,02 %
Enbridge Energy Partners LP	300.000	5,50 %	15.09.2040	329.095	0,02 %
Bank 2018-BNK ³	321.000	3,74 %	15.07.2060	329.089	0,02 %
Walt Disney Co.	325.000	2,75 %	16.08.2021	328.976	0,02 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	250.000	5,95 %	15.05.2037	328.764	0,02 %
Comcast Corp.	350.000	3,40 %	15.07.2046	328.459	0,02 %
Duke Energy Corp.	325.000	3,05 %	15.08.2022	328.424	0,02 %
Florida Power & Light Co.	300.000	4,05 %	01.10.2044	328.285	0,02 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	325.000	3,15 %	15.01.2023	328.250	0,02 %
State of Texas	250.000	5,52 %	01.04.2039	328.200	0,02 %
Alabama Power Co.	250.000	6,00 %	01.03.2039	328.000	0,02 %
Newell Brands Inc.	325.000	2,88 %	01.12.2019	327.966	0,02 %
Pharmacia LLC	250.000	6,60 %	01.12.2028	327.906	0,02 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	300.000	5,63 %	15.04.2023	327.750	0,02 %
Roper Technologies, Inc.	325.000	3,13 %	15.11.2022	327.632	0,02 %
American Tower Corp.	300.000	5,00 %	15.02.2024	327.431	0,02 %
21st Century Fox America, Inc.	250.000	6,15 %	01.03.2037	327.282	0,02 %
Time Warner Cable, Inc.	300.000	5,88 %	15.11.2040	327.271	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	260.000	5,50 %	15.10.2040	327.180	0,02 %
Capital One Financial Corp.	325.000	3,75 %	09.03.2027	327.128	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	325.000	3,10 %	15.01.2019	327.062	0,02 %
CCRE27 Commercial Mortgage Trust 2015	315.000	3,61 %	10.10.2048	326.961	0,02 %
Motorola Solutions, Inc.	325.000	3,50 %	01.03.2023	326.598	0,02 %
CF Industries, Inc.	325.000	3,40 %	01.12.2021	326.596	0,02 %
International Paper Co.	300.000	4,80 %	15.06.2044	326.393	0,02 %
Stanley Black & Decker, Inc.	325.000	2,90 %	01.11.2022	326.382	0,02 %
Georgia Power Co.	325.000	3,25 %	01.04.2026	325.353	0,02 %
Gilead Sciences, Inc.	325.000	2,05 %	01.04.2019	325.024	0,02 %
EnLink Midstream Partners LP	325.000	2,70 %	01.04.2019	324.744	0,02 %
Weyerhaeuser Co.	300.000	7,38 %	01.10.2019	324.458	0,02 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2017	327.000	1,69 %	15.11.2021	324.410	0,02 %
Massachusetts Mutual Life Insurance Co.	197.000	8,88 %	01.06.2039	324.099	0,02 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates	325.000	1,88 %	25.05.2019	324.083	0,02 %
Welltower, Inc.	300.000	6,13 %	15.04.2020	323.706	0,02 %
Apple, Inc.	325.000	1,80 %	13.11.2019	323.680	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Healthcare Trust of America Holdings LP	325.000	3,75 %	01.07.2027	323.641	0,02 %
Express Scripts Holding Co.	325.000	3,00 %	15.07.2023	323.608	0,02 %
Constellation Brands, Inc.	325.000	2,70 %	09.05.2022	323.214	0,02 %
Prudential Financial, Inc.	317.000	3,91 %	07.12.2047	323.213	0,02 %
3M Co.	325.000	2,88 %	15.10.2027	323.131	0,02 %
General Electric Co.	317.900	3,15 %	07.09.2022	322.953	0,02 %
QUALCOMM, Inc.	325.000	2,25 %	20.05.2020	322.617	0,02 %
US Bank NA	325.000	2,80 %	27.01.2025	322.431	0,02 %
Apple, Inc.	325.000	1,50 %	12.09.2019	322.291	0,02 %
Hyundai Capital America	350.000	2,75 %	27.09.2026	322.045	0,02 %
Valero Energy Corp.	300.000	6,13 %	01.02.2020	321.885	0,02 %
Energy Transfer LP	298.000	9,00 %	15.04.2019	321.531	0,02 %
Simon Property Group LP	325.000	2,35 %	30.01.2022	321.444	0,02 %
Home Depot, Inc.	325.000	2,00 %	01.04.2021	321.415	0,02 %
Apple, Inc.	325.000	1,55 %	07.02.2020	321.032	0,02 %
Consumers Energy Co.	300.000	6,70 %	15.09.2019	321.021	0,02 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013 [^]	300.000	4,16 %	15.12.2046	320.973	0,02 %
Federal National Mortgage Association	325.000	2,53 %	25.09.2024	320.960	0,02 %
Time Warner Cable LLC	300.000	8,25 %	01.04.2019	320.631	0,02 %
Florida Gas Transmission Co. LLC	300.000	4,35 %	15.07.2025	320.351	0,02 %
Time Warner Cable LLC	300.000	8,75 %	14.02.2019	320.309	0,02 %
CCRE21 Commercial Mortgage Trust 2014	310.267	3,53 %	10.12.2047	320.289	0,02 %
Johnson & Johnson	325.000	1,65 %	01.03.2021	320.011	0,02 %
Express Scripts Holding Co.	300.000	4,75 %	15.11.2021	319.987	0,02 %
Johnson & Johnson	300.000	3,75 %	03.03.2047	319.680	0,02 %
Duke Energy Corp.	325.000	2,40 %	15.08.2022	319.060	0,02 %
Wells Fargo Bank NA	250.000	5,85 %	01.02.2037	318.882	0,02 %
Honeywell International, Inc.	325.000	1,85 %	01.11.2021	318.792	0,02 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	300.000	5,00 %	15.04.2020	318.052	0,02 %
CCRE12 Commercial Mortgage Trust 2013	300.000	4,05 %	10.10.2046	317.925	0,02 %
BB&T Corp.	300.000	6,85 %	30.04.2019	317.848	0,02 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	250.000	7,00 %	15.12.2025	317.734	0,02 %
Regions Bank/Birmingham AL	250.000	6,45 %	26.06.2037	317.145	0,02 %
Time Warner, Inc.	300.000	4,70 %	15.01.2021	317.138	0,02 %
AT&T, Inc.	300.000	5,20 %	15.03.2020	317.097	0,02 %
Becton Dickinson and Co.	310.000	3,73 %	15.12.2024	317.043	0,02 %
Oracle Corp.	300.000	3,85 %	15.07.2036	317.014	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	350.000	3,85 %	01.11.2042	316.965	0,02 %
JPMorgan Chase & Co.	300.000	4,95 %	25.03.2020	316.964	0,02 %
Amazon.com, Inc.	300.000	3,80 %	05.12.2024	316.925	0,02 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	300.000	6,90 %	01.04.2029	316.922	0,02 %
Anadarko Petroleum Corp.	300.000	4,85 %	15.03.2021	316.851	0,02 %
PNC Financial Services Group, Inc.	300.000	5,13 %	08.02.2020	316.686	0,02 %
Great Plains Energy, Inc.	300.000	4,85 %	01.06.2021	316.616	0,02 %
MPLX LP	300.000	4,50 %	15.07.2023	316.534	0,02 %
Bay Area Toll Authority	200.000	7,04 %	01.04.2050	315.964	0,02 %
Tyson Foods, Inc.	300.000	3,95 %	15.08.2024	315.794	0,02 %
Oracle Corp.	300.000	3,90 %	15.05.2035	315.758	0,02 %
Laboratory Corp. of America Holdings	300.000	4,63 %	15.11.2020	315.743	0,02 %
Microsoft Corp.	300.000	3,63 %	15.12.2023	315.583	0,02 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	225.000	6,50 %	15.09.2037	315.549	0,02 %
International Business Machines Corp.	325.000	1,88 %	01.08.2022	315.374	0,02 %
Laboratory Corp. of America Holdings	310.000	3,60 %	01.02.2025	315.146	0,02 %
Intercontinental Exchange, Inc.	300.000	3,75 %	01.12.2025	314.793	0,02 %
John Deere Capital Corp.	300.000	3,90 %	12.07.2021	314.451	0,02 %
Dow Chemical Co.	300.000	4,13 %	15.11.2021	314.410	0,02 %
Caterpillar, Inc.	300.000	3,90 %	27.05.2021	314.356	0,02 %
Ford Motor Credit Co. LLC	300.000	4,25 %	20.09.2022	314.042	0,02 %
Viacom, Inc.	300.000	5,63 %	15.09.2019	313.997	0,02 %
Bank of New York Mellon Corp.	300.000	4,60 %	15.01.2020	313.879	0,02 %
Federal National Mortgage Association [^]	301.000	3,51 %	25.12.2023	313.714	0,02 %
Johnson Controls International plc	300.000	3,90 %	14.02.2026	313.705	0,02 %
Celgene Corp.	300.000	4,00 %	15.08.2023	313.581	0,02 %
Occidental Petroleum Corp.	300.000	4,10 %	01.02.2021	313.254	0,02 %
Comcast Corp.	225.000	7,05 %	15.03.2033	313.199	0,02 %
Enterprise Products Operating LLC	300.000	3,90 %	15.02.2024	312.876	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Procter & Gamble Co.	325.000	2,45 %	03.11.2026	312.575	0,02 %
Federal Home Loan Mortgage Corp [^]	300.000	3,43 %	25.01.2027	312.222	0,02 %
DDR Corp.	300.000	4,70 %	01.06.2027	312.157	0,02 %
CVS Health Corp.	300.000	4,00 %	05.12.2023	312.114	0,02 %
Comcast Corp.	300.000	3,60 %	01.03.2024	312.030	0,02 %
Marathon Oil Corp.	250.000	6,60 %	01.10.2037	312.021	0,02 %
CNA Financial Corp.	300.000	3,95 %	15.05.2024	311.798	0,02 %
Comcast Corp.	250.000	5,65 %	15.06.2035	311.773	0,02 %
Comcast Corp.	305.000	4,05 %	01.11.2052	311.616	0,02 %
BlackRock, Inc.	300.000	3,50 %	18.03.2024	311.458	0,02 %
General Mills, Inc.	300.000	5,65 %	15.02.2019	311.303	0,02 %
McDonald's Corp.	250.000	5,70 %	01.02.2039	311.208	0,02 %
International Paper Co.	275.000	5,00 %	15.09.2035	311.007	0,02 %
Amgen, Inc.	300.000	5,70 %	01.02.2019	310.911	0,02 %
Motiva Enterprises LLC	250.000	6,85 %	15.01.2040	310.824	0,02 %
Caterpillar, Inc.	300.000	3,40 %	15.05.2024	310.770	0,02 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	311.000	2,35 %	15.06.2020	310.712	0,02 %
Los Angeles Department of Water & Power	200.000	6,60 %	01.07.2050	310.678	0,02 %
Energy Transfer LP	275.000	6,50 %	01.02.2042	310.520	0,02 %
Synchrony Financial	300.000	4,25 %	15.08.2024	310.413	0,02 %
Viacom, Inc.	300.000	5,85 %	01.09.2043	310.403	0,02 %
Howard Hughes Medical Institute	300.000	3,50 %	01.09.2023	309.887	0,02 %
Occidental Petroleum Corp.	300.000	3,50 %	15.06.2025	309.854	0,02 %
Energy Transfer LP	250.000	7,50 %	01.07.2038	309.827	0,02 %
Omnicom Group, Inc.	300.000	3,63 %	01.05.2022	309.708	0,02 %
Morgan Stanley	225.000	7,25 %	01.04.2032	309.629	0,02 %
Parker-Hannifin Corp.	300.000	3,50 %	15.09.2022	309.518	0,02 %
Kraft Heinz Foods Co.	292.000	5,38 %	10.02.2020	309.215	0,02 %
Southern California Edison Co.	275.000	4,50 %	01.09.2040	308.823	0,02 %
Union Electric Co.	190.000	8,45 %	15.03.2039	308.789	0,02 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017	300.000	3,85 %	15.05.2050	308.754	0,02 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015	300.000	3,41 %	15.09.2058	308.556	0,02 %
General Electric Co.	294.000	4,38 %	16.09.2020	308.477	0,02 %
Apple, Inc.	300.000	3,75 %	13.11.2047	308.450	0,02 %
ConocoPhillips Co.	300.000	3,35 %	15.11.2024	308.448	0,02 %
PepsiCo, Inc.	325.000	2,38 %	06.10.2026	308.376	0,02 %
Williams Partners LP	250.000	6,30 %	15.04.2040	308.283	0,02 %
Invesco Finance plc	250.000	5,38 %	30.11.2043	308.200	0,02 %
Time Warner Cable LLC	300.000	4,00 %	01.09.2021	308.141	0,02 %
Target Corp.	300.000	4,00 %	01.07.2042	307.903	0,02 %
Rohm & Haas Co.	225.000	7,85 %	15.07.2029	307.813	0,02 %
International Lease Finance Corp.	294.000	6,25 %	15.05.2019	307.597	0,02 %
Adobe Systems, Inc.	300.000	3,25 %	01.02.2025	307.552	0,02 %
Cargill, Inc.	300.000	3,25 %	15.11.2021	307.294	0,02 %
Raytheon Co.	300.000	3,13 %	15.10.2020	306.883	0,02 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	300.000	3,47 %	15.11.2050	306.858	0,02 %
Wm Wrigley Jr Co.	300.000	3,38 %	21.10.2020	306.812	0,02 %
Public Service Electric & Gas Co.	300.000	3,65 %	01.09.2042	306.695	0,02 %
Cimarex Energy Co.	300.000	3,90 %	15.05.2027	306.604	0,02 %
Ford Motor Credit Co. LLC	300.000	3,81 %	09.01.2024	306.409	0,02 %
Johnson & Johnson	300.000	3,40 %	15.01.2038	306.392	0,02 %
MPLX LP	300.000	4,13 %	01.03.2027	306.202	0,02 %
Host Hotels & Resorts LP	300.000	4,00 %	15.06.2025	306.114	0,02 %
TTX Co.	300.000	3,60 %	15.01.2025	306.089	0,02 %
Public Service Co. of Colorado	300.000	3,20 %	15.11.2020	305.861	0,02 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	300.000	3,50 %	01.03.2021	305.713	0,02 %
General Mills, Inc.	300.000	3,15 %	15.12.2021	305.648	0,02 %
New York State Urban Development Corp.	250.000	5,77 %	15.03.2039	305.643	0,02 %
Fifth Third Bancorp	200.000	8,25 %	01.03.2038	305.592	0,02 %
Halliburton Co.	300.000	3,25 %	15.11.2021	305.519	0,02 %
Baker Hughes a GE Co. LLC	300.000	3,20 %	15.08.2021	305.497	0,02 %
McKesson Corp.	250.000	6,00 %	01.03.2041	305.486	0,02 %
Becton Dickinson and Co.	300.000	3,25 %	12.11.2020	305.341	0,02 %
Comcast Corp.	225.000	6,45 %	15.03.2037	305.233	0,02 %
FMR LLC	225.000	6,45 %	15.11.2039	305.083	0,02 %
Anthem, Inc.	300.000	3,50 %	15.08.2024	305.062	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates	300.000	2,95 %	25.07.2024	304.992	0,02 %
Baker Hughes a GE Co. LLC/Baker Hughes Co.-Obligor, Inc.	300.000	4,08 %	15.12.2047	304.972	0,02 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	300.000	5,00 %	15.08.2042	304.948	0,02 %
Lockheed Martin Corp.	300.000	3,10 %	15.01.2023	304.695	0,02 %
Air Products & Chemicals, Inc.	300.000	3,00 %	03.11.2021	304.623	0,02 %
Rockwell Collins, Inc.	300.000	3,50 %	15.03.2027	304.611	0,02 %
Viacom, Inc.	300.000	4,25 %	01.09.2023	304.593	0,02 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	306.000	3,85 %	15.10.2023	304.418	0,02 %
General Electric Co.	229.000	6,15 %	07.08.2037	304.275	0,02 %
North Texas Tollway Authority	200.000	6,72 %	01.01.2049	304.258	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	300.000	4,00 %	06.10.2026	304.097	0,02 %
Northwestern Mutual Life Insurance Co.	300.000	3,85 %	30.09.2047	304.053	0,02 %
Wal-Mart Stores, Inc.	305.000	1,75 %	09.10.2019	303.928	0,02 %
Monsanto Co.	300.000	3,38 %	15.07.2024	303.877	0,02 %
Time Warner Entertainment Co. LP	250.000	8,38 %	15.03.2023	303.819	0,02 %
HCP, Inc.	300.000	3,75 %	01.02.2019	303.789	0,02 %
Abbott Laboratories	300.000	3,25 %	15.04.2023	303.562	0,02 %
Verizon Communications, Inc.	300.000	3,00 %	01.11.2021	303.522	0,02 %
General Motors Financial Co., Inc.	300.000	3,45 %	14.01.2022	303.468	0,02 %
Manufacturers & Traders Trust Co.	300.000	3,40 %	17.08.2027	303.327	0,02 %
AT&T, Inc.	300.000	3,20 %	01.03.2022	303.206	0,02 %
XLIT Ltd.	300.000	4,45 %	31.03.2025	303.206	0,02 %
John Deere Capital Corp.	300.000	2,80 %	04.03.2021	303.135	0,02 %
Nuveen Finance LLC	300.000	2,95 %	01.11.2019	302.858	0,02 %
UnitedHealth Group, Inc.	300.000	2,88 %	15.03.2022	302.842	0,02 %
Anthem, Inc.	300.000	3,13 %	15.05.2022	302.809	0,02 %
EnLink Midstream Partners LP	300.000	4,15 %	01.06.2025	302.700	0,02 %
Microsoft Corp.	300.000	2,65 %	03.11.2022	302.650	0,02 %
State Street Corp.	300.000	3,10 %	15.05.2023	302.626	0,02 %
Comcast Corp.	300.000	3,00 %	01.02.2024	302.249	0,02 %
Goldman Sachs Group, Inc.	300.000	2,88 %	25.02.2021	302.215	0,02 %
Digital Realty Trust LP	300.000	3,70 %	15.08.2027	302.059	0,02 %
Procter & Gamble Co.	300.000	3,50 %	25.10.2047	302.001	0,02 %
Exxon Mobil Corp.	300.000	2,73 %	01.03.2023	301.836	0,02 %
Lincoln National Corp.	300.000	3,35 %	09.03.2025	301.814	0,02 %
Dow Chemical Co.	300.000	3,00 %	15.11.2022	301.690	0,02 %
Wyeth LLC ¹	250.000	6,45 %	01.02.2024	301.683	0,02 %
New York State Dormitory Authority	235.000	5,60 %	15.03.2040	301.681	0,02 %
Reynolds American, Inc.	275.000	6,88 %	01.05.2020	301.579	0,02 %
Cisco Systems, Inc.	300.000	2,45 %	15.06.2020	301.571	0,02 %
Chevron Corp.	300.000	2,42 %	17.11.2020	301.324	0,02 %
Walgreen Co.	300.000	3,10 %	15.09.2022	301.236	0,02 %
Home Depot, Inc.	225.000	5,95 %	01.04.2041	301.192	0,01 %
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	300.000	4,00 %	15.08.2026	301.125	0,01 %
Cox Communications, Inc.	300.000	4,80 %	01.02.2035	300.902	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	300.000	2,45 %	27.11.2020	300.739	0,01 %
Stryker Corp.	300.000	2,63 %	15.03.2021	300.730	0,01 %
University of California	275.000	4,77 %	15.05.2115	300.682	0,01 %
State of Oregon	250.000	5,89 %	01.06.2027	300.673	0,01 %
John Deere Capital Corp.	300.000	2,25 %	17.04.2019	300.630	0,01 %
Cisco Systems, Inc.	300.000	2,13 %	01.03.2019	300.620	0,01 %
Corporate Office Properties LP	300.000	3,60 %	15.05.2023	300.504	0,01 %
Union Pacific Corp.	300.000	2,25 %	19.06.2020	300.435	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	300.000	2,68 %	09.01.2020	300.421	0,01 %
Oracle Corp.	300.000	2,63 %	15.02.2023	300.407	0,01 %
Federal National Mortgage Association [^]	300.000	2,92 %	25.10.2025	300.402	0,01 %
US Bancorp	300.000	3,15 %	27.04.2027	300.366	0,01 %
Prudential Financial, Inc.	300.000	2,35 %	15.08.2019	300.314	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	300.000	2,30 %	11.09.2019	300.311	0,01 %
Halliburton Co.	275.000	4,75 %	01.08.2043	300.241	0,01 %
Bank of America Corp. [^]	300.000	2,88 %	24.04.2023	300.220	0,01 %
Costco Wholesale Corp.	300.000	3,00 %	18.05.2027	300.129	0,01 %
Home Depot, Inc.	300.000	2,00 %	15.06.2019	300.114	0,01 %
Valero Energy Corp.	300.000	3,40 %	15.09.2026	300.114	0,01 %
Home Depot, Inc.	300.000	3,00 %	01.04.2026	300.112	0,01 %
Amgen, Inc.	300.000	2,20 %	22.05.2019	300.107	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
American Express Credit Corp.	300.000	2,13 %	18.03.2019	300.003	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	250.000	4,90 %	01.04.2044	299.937	0,01 %
Occidental Petroleum Corp.	300.000	2,60 %	15.04.2022	299.937	0,01 %
Exxon Mobil Corp.	300.000	2,40 %	06.03.2022	299.912	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	300.000	3,05 %	15.11.2027	299.889	0,01 %
Chase Issuance Trust	300.000	1,30 %	18.02.2020	299.860	0,01 %
US Bank NA	300.000	2,13 %	28.10.2019	299.844	0,01 %
John Deere Capital Corp.	300.000	1,95 %	04.03.2019	299.814	0,01 %
FedEx Corp.	300.000	2,30 %	01.02.2020	299.762	0,01 %
NBCUniversal Enterprise, Inc.	300.000	1,97 %	15.04.2019	299.358	0,01 %
Apple, Inc.	300.000	2,15 %	09.02.2022	299.357	0,01 %
AbbVie, Inc.	300.000	2,85 %	14.05.2023	299.332	0,01 %
Baker Hughes a GE Co. LLC/Baker Hughes Co.-Obligor, Inc.	300.000	3,34 %	15.12.2027	299.326	0,01 %
Exxon Mobil Corp.	300.000	1,71 %	01.03.2019	299.226	0,01 %
Procter & Gamble Co.	300.000	1,75 %	25.10.2019	299.131	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	300.000	2,35 %	04.10.2019	299.005	0,01 %
TTX Co.	300.000	2,25 %	01.02.2019	298.974	0,01 %
American Express Credit Account Master Trust	300.000	2,35 %	15.05.2025	298.950	0,01 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	300.000	1,70 %	15.03.2019	298.924	0,01 %
PNC Bank NA	300.000	3,10 %	25.10.2027	298.873	0,01 %
Protective Life Global Funding	300.000	1,72 %	15.04.2019	298.821	0,01 %
International Business Machines Corp.	300.000	1,90 %	27.01.2020	298.677	0,01 %
Time Warner, Inc.	300.000	2,10 %	01.06.2019	298.620	0,01 %
Bristol-Myers Squibb Co.	300.000	1,60 %	27.02.2019	298.596	0,01 %
Apple, Inc.	296.000	2,70 %	13.05.2022	298.369	0,01 %
Toyota Auto Receivables 2017-D Owner Trust	300.000	1,93 %	18.01.2022	298.326	0,01 %
Texas Instruments, Inc.	300.000	1,65 %	03.08.2019	298.263	0,01 %
Apple, Inc.	300.000	2,00 %	13.11.2020	298.103	0,01 %
Reynolds American, Inc.	250.000	5,70 %	15.08.2035	297.963	0,01 %
Air Lease Corp.	300.000	2,13 %	15.01.2020	297.906	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	225.000	6,20 %	15.08.2036	297.903	0,01 %
AmerisourceBergen Corp.	300.000	3,45 %	15.12.2027	297.881	0,01 %
Costco Wholesale Corp.	300.000	1,70 %	15.12.2019	297.871	0,01 %
Starbucks Corp.	300.000	2,10 %	04.02.2021	297.824	0,01 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	300.000	2,29 %	15.07.2025	297.811	0,01 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	300.000	4,20 %	15.03.2028	297.721	0,01 %
Aetna, Inc.	225.000	6,63 %	15.06.2036	297.567	0,01 %
Deere & Co.	275.000	3,90 %	09.06.2042	297.512	0,01 %
JPMorgan Chase Bank NA	300.000	1,65 %	23.09.2019	297.506	0,01 %
Abbott Laboratories	300.000	2,00 %	15.03.2020	297.446	0,01 %
VMware, Inc.	300.000	2,30 %	21.08.2020	297.425	0,01 %
Walt Disney Co.	300.000	2,35 %	01.12.2022	297.316	0,01 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	300.000	5,35 %	15.05.2045	297.288	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	300.000	2,50 %	22.08.2022	296.949	0,01 %
Fifth Third Bank	300.000	2,25 %	14.06.2021	296.731	0,01 %
Prudential Financial, Inc.	290.000	3,94 %	07.12.2049	296.401	0,01 %
Sempra Energy	295.000	2,85 %	15.11.2020	296.378	0,01 %
Discovery Communications LLC	300.000	2,95 %	20.03.2023	296.350	0,01 %
Noble Energy, Inc.	250.000	6,00 %	01.03.2041	296.216	0,01 %
Hess Corp.	275.000	5,60 %	15.02.2041	296.136	0,01 %
International Business Machines Corp.	300.000	1,63 %	15.05.2020	296.116	0,01 %
PerkinElmer, Inc.	275.000	5,00 %	15.11.2021	296.026	0,01 %
WestRock Co.	300.000	3,00 %	15.09.2024	295.960	0,01 %
Hess Corp.	300.000	3,50 %	15.07.2024	295.953	0,01 %
Compass Bank	300.000	2,88 %	29.06.2022	295.679	0,01 %
Mylan, Inc.	300.000	3,13 %	15.01.2023	295.600	0,01 %
AT&T, Inc.	250.000	6,38 %	01.03.2041	295.529	0,01 %
New York Life Global Funding	300.000	2,30 %	10.06.2022	295.325	0,01 %
Georgia Power Co.	275.000	4,30 %	15.03.2042	295.089	0,01 %
General Electric Co.	279.000	6,00 %	07.08.2019	294.960	0,01 %
Kerr-McGee Corp.	250.000	6,95 %	01.07.2024	294.718	0,01 %
Aetna, Inc.	300.000	2,80 %	15.06.2023	294.560	0,01 %
Cox Communications, Inc.	300.000	3,15 %	15.08.2024	294.456	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	282.000	3,87 %	25.04.2021	294.442	0,01 %
Unilever Capital Corp.	300.000	2,90 %	05.05.2027	294.336	0,01 %
International Business Machines Corp.	250.000	4,70 %	19.02.2046	293.768	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Progress Energy, Inc.	225.000	6,00 %	01.12.2039	293.627	0,01 %
Citigroup, Inc.	225.000	5,88 %	30.01.2042	293.332	0,01 %
Cox Communications, Inc.	300.000	3,35 %	15.09.2026	293.016	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	275.000	5,20 %	01.09.2020	292.975	0,01 %
Georgia Power Co.	275.000	4,30 %	15.03.2043	292.821	0,01 %
Coca-Cola Co.	300.000	1,55 %	01.09.2021	292.711	0,01 %
GS Mortgage Securities Trust 2016	300.000	2,85 %	10.10.2049	292.302	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	255.000	4,75 %	15.09.2044	292.041	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	300.000	1,70 %	09.08.2021	291.939	0,01 %
Newell Brands Inc.	250.000	5,38 %	01.04.2036	291.931	0,01 %
Microsoft Corp.	250.000	4,50 %	01.10.2040	291.831	0,01 %
Amazon.com, Inc.	250.000	4,80 %	05.12.2034	291.798	0,01 %
EOG Resources, Inc.	275.000	4,15 %	15.01.2026	291.685	0,01 %
President & Fellows of Harvard College	300.000	3,15 %	15.07.2046	291.517	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	225.000	5,80 %	15.03.2036	291.252	0,01 %
International Paper Co.	300.000	3,00 %	15.02.2027	290.781	0,01 %
Duke Energy Corp.	250.000	4,80 %	15.12.2045	290.731	0,01 %
Union Pacific Corp.	270.000	4,05 %	15.11.2045	290.597	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	300.000	2,20 %	16.08.2023	290.511	0,01 %
AT&T, Inc.	275.000	4,45 %	01.04.2024	290.247	0,01 %
HSBC Bank USA NA	225.000	5,88 %	01.11.2034	289.993	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	225.000	6,20 %	15.12.2034	289.941	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	275.000	4,25 %	10.11.2044	289.825	0,01 %
PacifiCorp	225.000	5,75 %	01.04.2037	289.765	0,01 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	285.000	3,30 %	18.11.2021	289.723	0,01 %
SC Johnson & Son, Inc.	250.000	4,75 %	15.10.2046	289.707	0,01 %
Nissan Auto Lease Trust 2017	290.000	2,05 %	15.09.2020	289.182	0,01 %
Honeywell International, Inc.	300.000	2,50 %	01.11.2026	289.014	0,01 %
Amgen, Inc.	250.000	4,95 %	01.10.2041	288.959	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	300.000	4,90 %	15.02.2045	288.952	0,01 %
HP, Inc.	275.000	4,30 %	01.06.2021	288.465	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	200.000	7,55 %	15.02.2030	288.451	0,01 %
Entergy Texas, Inc.	275.000	7,13 %	01.02.2019	288.365	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	250.000	4,63 %	15.07.2035	288.287	0,01 %
Discovery Communications LLC	275.000	5,20 %	20.09.2047	288.097	0,01 %
Apollo Management Holdings LP	275.000	4,40 %	27.05.2026	287.957	0,01 %
Dow Chemical Co.	275.000	4,38 %	15.11.2042	287.864	0,01 %
Microsoft Corp.	225.000	5,30 %	08.02.2041	287.793	0,01 %
PepsiCo, Inc.	275.000	4,50 %	15.01.2020	287.738	0,01 %
Amgen, Inc.	300.000	2,60 %	19.08.2026	287.296	0,01 %
Kellogg Co.	275.000	4,00 %	15.12.2020	287.145	0,01 %
Mosaic Co.	290.000	3,25 %	15.11.2022	287.097	0,01 %
Amazon.com, Inc.	250.000	5,20 %	03.12.2025	286.875	0,01 %
Citigroup, Inc.	275.000	4,30 %	20.11.2026	286.653	0,01 %
Florida Power & Light Co.	275.000	3,80 %	15.12.2042	286.604	0,01 %
Home Depot, Inc.	285.000	2,63 %	01.06.2022	286.420	0,01 %
Archer-Daniels-Midland Co.	300.000	2,50 %	11.08.2026	286.393	0,01 %
SC Johnson & Son, Inc.	250.000	4,80 %	01.09.2040	286.348	0,01 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	275.000	4,40 %	01.04.2021	285.894	0,01 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	300.000	3,50 %	15.01.2028	285.872	0,01 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014	274.000	4,18 %	15.05.2047	285.623	0,01 %
Celgene Corp.	275.000	4,35 %	15.11.2047	285.614	0,01 %
Tosco Corp.	200.000	8,13 %	15.02.2030	285.427	0,01 %
Becton Dickinson and Co.	284.000	2,68 %	15.12.2019	285.245	0,01 %
Johnson & Johnson	250.000	4,38 %	05.12.2033	284.948	0,01 %
New York Life Global Funding	300.000	2,35 %	14.07.2026	284.885	0,01 %
Coca-Cola Co.	275.000	3,20 %	01.11.2023	284.849	0,01 %
Comcast Corp.	200.000	6,95 %	15.08.2037	284.699	0,01 %
McKesson Corp.	275.000	3,80 %	15.03.2024	284.698	0,01 %
El du Pont de Nemours & Co.	275.000	3,63 %	15.01.2021	284.677	0,01 %
AT&T, Inc.	275.000	3,80 %	15.03.2022	284.000	0,01 %
Discovery Communications LLC	275.000	5,00 %	20.09.2037	283.941	0,01 %
Stryker Corp.	250.000	4,63 %	15.03.2046	283.902	0,01 %
Oracle Corp.	250.000	4,50 %	08.07.2044	283.890	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	275.000	3,75 %	15.11.2047	283.760	0,01 %
AT&T, Inc.	275.000	5,15 %	15.03.2042	283.722	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
State of Illinois	275.000	5,88 %	01.03.2019	283.569	0,01 %
Microsoft Corp.	275.000	4,20 %	01.06.2019	283.322	0,01 %
Microsoft Corp.	250.000	4,20 %	03.11.2035	282.897	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	200.000	6,90 %	15.08.2039	282.545	0,01 %
Coca-Cola Co.	275.000	3,15 %	15.11.2020	282.300	0,01 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	280.000	2,70 %	18.11.2019	281.768	0,01 %
Duke Energy Florida LLC	200.000	6,40 %	15.06.2038	281.510	0,01 %
Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue	200.000	6,58 %	15.05.2049	281.346	0,01 %
Comcast Corp.	275.000	3,13 %	15.07.2022	281.198	0,01 %
Capital One Na	280.000	2,95 %	23.07.2021	280.992	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	250.000	4,60 %	01.09.2035	280.576	0,01 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates^	275.000	3,19 %	25.09.2027	280.508	0,01 %
Massachusetts Institute of Technology	200.000	5,60 %	01.07.2111	280.456	0,01 %
Kimberly-Clark Corp.	300.000	3,20 %	30.07.2046	280.022	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	275.000	3,50 %	01.11.2024	279.940	0,01 %
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	275.000	3,55 %	01.05.2027	279.931	0,01 %
NiSource Finance Corp.	275.000	3,49 %	15.05.2027	279.741	0,01 %
International Paper Co.	200.000	7,30 %	15.11.2039	279.386	0,01 %
Anthem, Inc.	275.000	3,30 %	15.01.2023	279.151	0,01 %
Applied Materials, Inc.	275.000	3,30 %	01.04.2027	279.063	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	225.000	5,40 %	01.10.2043	278.951	0,01 %
Walt Disney Co.	200.000	7,00 %	01.03.2032	278.876	0,01 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	250.000	5,95 %	01.12.2025	278.862	0,01 %
Basin Electric Power Cooperative	250.000	4,75 %	26.04.2047	278.762	0,01 %
Burlington Resources Finance Co.	200.000	7,40 %	01.12.2031	278.704	0,01 %
Dollar General Corp.	275.000	3,25 %	15.04.2023	278.534	0,01 %
Anthem, Inc.	275.000	3,35 %	01.12.2024	278.041	0,01 %
Pfizer, Inc.	250.000	4,30 %	15.06.2043	277.945	0,01 %
Xerox Corp.	275.000	4,07 %	17.03.2022	277.798	0,01 %
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2013	275.000	2,96 %	15.04.2046	277.464	0,01 %
Williams Partners LP	275.000	3,35 %	15.08.2022	277.402	0,01 %
Boston Properties LP	275.000	3,13 %	01.09.2023	277.275	0,01 %
Comcast Corp.	260.000	4,20 %	15.08.2034	277.248	0,01 %
FirstEnergy Corp.	250.000	4,85 %	15.07.2047	277.179	0,01 %
New York City Water & Sewer System	200.000	5,88 %	15.06.2044	276.682	0,01 %
Apple, Inc.	250.000	4,25 %	09.02.2047	276.565	0,01 %
Chevron Corp.	275.000	2,43 %	24.06.2020	276.502	0,01 %
Anthem, Inc.	250.000	4,65 %	15.01.2043	276.255	0,01 %
Anthem, Inc.	250.000	4,63 %	15.05.2042	276.106	0,01 %
Target Corp. ¹	275.000	2,30 %	26.06.2019	275.785	0,01 %
Comcast Corp.	275.000	2,75 %	01.03.2023	275.328	0,01 %
PPL Electric Utilities Corp.	250.000	4,13 %	15.06.2044	275.263	0,01 %
Molex Electronic Technologies LLC	275.000	2,88 %	15.04.2020	275.108	0,01 %
Anthem, Inc.	275.000	2,95 %	01.12.2022	275.059	0,01 %
Walt Disney Co.	275.000	2,30 %	12.02.2021	274.877	0,01 %
FedEx Corp.	250.000	4,55 %	01.04.2046	274.783	0,01 %
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	275.000	2,30 %	01.04.2019	274.751	0,01 %
Express Scripts Holding Co.	275.000	2,25 %	15.06.2019	274.597	0,01 %
United Technologies Corp.	275.000	3,13 %	04.05.2027	274.563	0,01 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	250.000	4,30 %	01.12.2056	274.538	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp. [^]	275.000	2,66 %	16.05.2023	274.532	0,01 %
Amgen, Inc.	275.000	1,90 %	10.05.2019	274.402	0,01 %
Anthem, Inc.	275.000	2,50 %	21.11.2020	274.397	0,01 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	275.000	2,08 %	15.03.2023	274.312	0,01 %
Amgen, Inc.	275.000	2,65 %	11.05.2022	274.269	0,01 %
Discovery Communications LLC	275.000	4,88 %	01.04.2043	274.258	0,01 %
Amgen, Inc.	275.000	2,20 %	11.05.2020	274.063	0,01 %
Ford Motor Co.	225.000	6,63 %	01.10.2028	273.857	0,01 %
NiSource Finance Corp.	250.000	4,38 %	15.05.2047	273.713	0,01 %
Exelon Generation Co. LLC	250.000	5,60 %	15.06.2042	273.499	0,01 %
AT&T, Inc.	250.000	5,70 %	01.03.2057	273.316	0,01 %
General Mills, Inc.	275.000	3,20 %	10.02.2027	273.180	0,01 %
Florida Power & Light Co.	200.000	5,96 %	01.04.2039	272.793	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	275.000	3,30 %	01.12.2027	272.595	0,01 %
Deere & Co.	225.000	5,38 %	16.10.2029	272.368	0,01 %
Connecticut Light & Power Co.	275.000	2,50 %	15.01.2023	272.366	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Ohio Edison Co.	200.000	6,88 %	15.07.2036	271.757	0,01 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	275.000	1,33 %	15.06.2022	271.593	0,01 %
Cox Communications, Inc.	275.000	3,50 %	15.08.2027	270.915	0,01 %
Travelers Cos, Inc.	200.000	6,25 %	15.06.2037	270.839	0,01 %
Texas Transportation Commission State Highway Fund	225.000	5,18 %	01.04.2030	270.324	0,01 %
AT&T, Inc.	250.000	5,55 %	15.08.2041	270.236	0,01 %
Pepsi-Cola Metropolitan Bottling Co., Inc.	200.000	7,00 %	01.03.2029	269.850	0,01 %
HP, Inc.	250.000	6,00 %	15.09.2041	269.765	0,01 %
International Lease Finance Corp.	235.000	8,25 %	15.12.2020	269.662	0,01 %
Enbridge Energy Partners LP	250.000	9,88 %	01.03.2019	269.591	0,01 %
Realty Income Corp.	250.000	4,65 %	01.08.2023	269.508	0,01 %
EQT Corp.	250.000	8,13 %	01.06.2019	269.359	0,01 %
Home Depot, Inc.	225.000	4,88 %	15.02.2044	268.880	0,01 %
Intel Corp.	275.000	2,60 %	19.05.2026	268.608	0,01 %
Federal National Mortgage Association^	267.921	2,32 %	25.11.2018	268.344	0,01 %
Illinois Tool Works, Inc.	275.000	2,65 %	15.11.2026	268.086	0,01 %
Five Corners Funding Trust	250.000	4,42 %	15.11.2023	267.768	0,01 %
PacifiCorp	200.000	6,00 %	15.01.2039	267.749	0,01 %
Citigroup, Inc.	250.000	5,38 %	09.08.2020	267.724	0,01 %
Flex Ltd.	250.000	4,75 %	15.06.2025	267.717	0,01 %
American Tower Corp.	275.000	2,25 %	15.01.2022	267.681	0,01 %
Apple, Inc.	275.000	1,55 %	04.08.2021	266.876	0,01 %
MetLife Capital Trust IV	200.000	7,88 %	15.12.2037	266.750	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	225.000	4,85 %	01.02.2044	266.561	0,01 %
General Motors Co.	250.000	5,15 %	01.04.2038	266.402	0,01 %
Reinsurance Group of America, Inc.	250.000	5,00 %	01.06.2021	266.386	0,01 %
Discovery Communications LLC	250.000	4,90 %	11.03.2026	266.385	0,01 %
Advance Auto Parts, Inc.	250.000	5,75 %	01.05.2020	266.328	0,01 %
Exelon Corp.	250.000	5,15 %	01.12.2020	266.172	0,01 %
Devon Energy Corp.	250.000	4,75 %	15.05.2042	265.963	0,01 %
Illinois Tool Works, Inc.	250.000	3,90 %	01.09.2042	265.831	0,01 %
Ingersoll-Rand Global Holding Co., Ltd.	250.000	4,25 %	15.06.2023	265.411	0,01 %
McDonald's Corp.	200.000	6,30 %	15.10.2037	265.285	0,01 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	275.000	2,65 %	15.01.2023	265.197	0,01 %
Starbucks Corp.	250.000	3,85 %	01.10.2023	265.132	0,01 %
Altria Group, Inc.	250.000	4,00 %	31.01.2024	265.127	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	250.000	4,15 %	01.02.2024	265.083	0,01 %
Intercontinental Exchange, Inc.	250.000	4,00 %	15.10.2023	264.917	0,01 %
Constellation Brands, Inc.	250.000	4,25 %	01.05.2023	264.834	0,01 %
Ameriprise Financial, Inc.	250.000	4,00 %	15.10.2023	264.609	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	250.000	4,50 %	15.02.2021	264.552	0,01 %
HSBC Bank USA NA	250.000	4,88 %	24.08.2020	264.232	0,01 %
Simon Property Group LP	250.000	4,38 %	01.03.2021	264.119	0,01 %
Dominion Energy, Inc.	250.000	4,45 %	15.03.2021	263.831	0,01 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	200.000	5,75 %	15.01.2040	263.450	0,01 %
Comcast Corp.	275.000	3,20 %	15.07.2036	263.338	0,01 %
LC17 Commercial Mortgage Trust 2014^	250.000	4,19 %	10.10.2047	263.337	0,01 %
AT&T, Inc.	250.000	4,60 %	15.02.2021	263.222	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	250.000	6,90 %	01.03.2019	263.171	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	265.000	2,60 %	15.12.2019	263.138	0,01 %
Norfolk Southern Corp.	250.000	3,85 %	15.01.2024	263.136	0,01 %
0,01 % Discover Bank	250.000	4,20 %	08.08.2023	262.946	0,01 %
State Street Corp.	250.000	3,70 %	20.11.2023	262.918	0,01 %
L3 Technologies, Inc.	250.000	4,75 %	15.07.2020	262.912	0,01 %
General Dynamics Corp.	275.000	1,88 %	15.08.2023	262.765	0,01 %
Bunge Ltd. Finance Corp.	275.000	3,25 %	15.08.2026	262.514	0,01 %
Waste Management, Inc.	250.000	3,90 %	01.03.2035	262.356	0,01 %
Port Authority of New York & New Jersey	200.000	5,65 %	01.11.2040	262.326	0,01 %
Duke Energy Ohio, Inc.	250.000	3,80 %	01.09.2023	262.266	0,01 %
Kraft Heinz Foods Co.	200.000	6,88 %	26.01.2039	262.126	0,01 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015	250.000	3,78 %	10.09.2058	262.082	0,01 %
JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017	250.000	3,72 %	15.03.2050	261.630	0,01 %
Illinois Tool Works, Inc.	250.000	3,50 %	01.03.2024	261.356	0,01 %
Medtronic, Inc.	250.000	3,63 %	15.03.2024	261.309	0,01 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	250.000	3,70 %	01.02.2024	261.288	0,01 %
Cisco Systems, Inc.	250.000	4,45 %	15.01.2020	261.282	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	250.000	3,90 %	15.07.2025	261.043	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Branch Banking & Trust Co.	250.000	3,80 %	30.10.2026	260.880	0,01 %
Comcast Corp.	250.000	4,00 %	15.08.2047	260.837	0,01 %
Comcast Corp.	255.000	4,00 %	01.11.2049	260.798	0,01 %
Oracle Corp.	250.000	3,88 %	15.07.2020	260.709	0,01 %
Merck Sharp & Dohme Corp.	250.000	5,00 %	30.06.2019	260.693	0,01 %
Altria Group, Inc.	235.000	9,25 %	06.08.2019	260.558	0,01 %
Newmont Mining Corp.	250.000	5,13 %	01.10.2019	260.413	0,01 %
Chicago Transit Authority	200.000	6,20 %	01.12.2040	260.370	0,01 %
Commonwealth Edison Co.	200.000	5,90 %	15.03.2036	260.269	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	250.000	4,30 %	13.07.2025	260.201	0,01 %
Santander Holdings USA, Inc.	250.000	4,50 %	17.07.2025	260.136	0,01 %
Exelon Corp.	250.000	3,95 %	15.06.2025	260.074	0,01 %
Southern California Edison Co.	250.000	3,88 %	01.06.2021	260.048	0,01 %
Mondelez International, Inc.	200.000	6,50 %	09.02.2040	259.846	0,01 %
Duke Realty LP	250.000	3,88 %	15.10.2022	259.845	0,01 %
CCRE7 Commercial Mortgage Trust 2013	255.000	3,21 %	10.03.2046	259.641	0,01 %
Laboratory Corp. of America Holdings	250.000	3,75 %	23.08.2022	259.434	0,01 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	250.000	3,75 %	01.04.2045	259.398	0,01 %
Express Scripts Holding Co.	250.000	3,90 %	15.02.2022	258.894	0,01 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016	250.000	3,62 %	10.02.2049	258.665	0,01 %
Indiana Michigan Power Co.	200.000	6,05 %	15.03.2037	258.557	0,01 %
Niagara Mohawk Power Corp.	250.000	3,51 %	01.10.2024	258.399	0,01 %
Duke Energy Indiana LLC	250.000	3,75 %	15.07.2020	258.314	0,01 %
Pfizer, Inc.	225.000	4,40 %	15.05.2044	258.246	0,01 %
Rockwell Collins, Inc.	250.000	3,70 %	15.12.2023	258.163	0,01 %
Fifth Third Bank	250.000	3,85 %	15.03.2026	258.020	0,01 %
Sempra Energy	200.000	6,00 %	15.10.2039	257.999	0,01 %
Branch Banking & Trust Co.	250.000	3,63 %	16.09.2025	257.913	0,01 %
Coca-Cola Co.	250.000	3,30 %	01.09.2021	257.883	0,01 %
Automatic Data Processing, Inc.	250.000	3,38 %	15.09.2025	257.708	0,01 %
Home Depot, Inc.	250.000	3,35 %	15.09.2025	257.629	0,01 %
ONE Gas, Inc.	225.000	4,66 %	01.02.2044	257.420	0,01 %
El du Pont de Nemours & Co.	250.000	4,15 %	15.02.2043	257.355	0,01 %
General Motors Co.	250.000	4,20 %	01.10.2027	257.346	0,01 %
Guardian Life Insurance Co. of America	225.000	4,88 %	19.06.2064	257.280	0,01 %
LyondellBasell Industries NV	250.000	4,63 %	26.02.2055	257.266	0,01 %
AutoZone, Inc.	250.000	3,70 %	15.04.2022	257.132	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	250.000	3,45 %	15.01.2027	257.036	0,01 %
Comcast Corp.	250.000	3,38 %	15.02.2025	257.022	0,01 %
Lowe's Cos, Inc.	250.000	3,38 %	15.09.2025	257.013	0,01 %
Commonwealth Edison Co.	250.000	3,40 %	01.09.2021	256.982	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	250.000	3,45 %	18.12.2026	256.906	0,01 %
Monsanto Co.	225.000	5,50 %	15.08.2025	256.878	0,01 %
American International Group, Inc.	250.000	3,75 %	10.07.2025	256.729	0,01 %
Intel Corp.	250.000	3,10 %	29.07.2022	256.498	0,01 %
Western Union Co.	250.000	3,60 %	15.03.2022	256.321	0,01 %
Lockheed Martin Corp.	225.000	4,85 %	15.09.2041	256.201	0,01 %
CME Group, Inc.	200.000	5,30 %	15.09.2043	256.190	0,01 %
Dominion Energy, Inc.	200.000	6,30 %	15.03.2033	256.140	0,01 %
Wells Fargo & Co.	250.000	3,55 %	29.09.2025	256.043	0,01 %
Citigroup, Inc.	225.000	4,65 %	30.07.2045	256.024	0,01 %
Kroger Co.	250.000	3,40 %	15.04.2022	255.960	0,01 %
Puget Energy, Inc.	250.000	3,65 %	15.05.2025	255.930	0,01 %
Occidental Petroleum Corp.	250.000	3,13 %	15.02.2022	255.927	0,01 %
PepsiCo, Inc.	200.000	5,50 %	15.01.2040	255.902	0,01 %
Apache Corp.	250.000	3,63 %	01.02.2021	255.780	0,01 %
Southwestern Public Service Co.	250.000	3,70 %	15.08.2047	255.730	0,01 %
AmerisourceBergen Corp.	250.000	3,50 %	15.11.2021	255.676	0,01 %
Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC	200.000	7,85 %	01.02.2026	255.648	0,01 %
Apple, Inc.	250.000	3,75 %	12.09.2047	255.647	0,01 %
Aon plc	250.000	3,50 %	14.06.2024	255.588	0,01 %
Allstate Corp.	225.000	4,50 %	15.06.2043	255.585	0,01 %
Johnson & Johnson	250.000	3,50 %	15.01.2048	255.428	0,01 %
WestRock RKT Co.	250.000	4,45 %	01.03.2019	255.269	0,01 %
ERAC USA Finance LLC	250.000	3,80 %	01.11.2025	255.213	0,01 %
Northrop Grumman Corp.	250.000	3,25 %	01.08.2023	255.059	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Bank of New York Mellon Corp.^	250.000	3,44 %	07.02.2028	255.044	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	250.000	2,99 %	25.09.2021	254.972	0,01 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	200.000	5,85 %	15.03.2036	254.914	0,01 %
Marathon Petroleum Corp.	250.000	3,63 %	15.09.2024	254.772	0,01 %
Apple, Inc.	225.000	4,45 %	06.05.2044	254.720	0,01 %
Apple, Inc.	250.000	3,20 %	13.05.2025	254.693	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	250.000	3,00 %	15.03.2023	254.649	0,01 %
United Technologies Corp.	200.000	5,70 %	15.04.2040	254.523	0,01 %
First Republic Bank	250.000	4,38 %	01.08.2046	254.498	0,01 %
Ventas Realty LP/Ventas Capital Corp.	250.000	4,00 %	30.04.2019	254.447	0,01 %
Intel Corp.	250.000	3,15 %	11.05.2027	254.375	0,01 %
Seagate HDD Cayman	250.000	4,75 %	01.06.2023	254.375	0,01 %
American Tower Corp.	250.000	3,30 %	15.02.2021	254.265	0,01 %
CSX Corp.	250.000	3,35 %	01.11.2025	254.230	0,01 %
Metropolitan Edison Co.	250.000	3,50 %	15.03.2023	254.223	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	200.000	5,65 %	01.12.2041	253.961	0,01 %
ONEOK, Inc.	250.000	4,00 %	13.07.2027	253.874	0,01 %
AbbVie, Inc.	250.000	3,20 %	06.11.2022	253.872	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	210.000	5,40 %	15.01.2040	253.696	0,01 %
MetLife, Inc.	200.000	5,70 %	15.06.2035	253.071	0,01 %
Archer-Daniels-Midland Co.	250.000	3,75 %	15.09.2047	252.965	0,01 %
QUALCOMM, Inc.	235.000	4,65 %	20.05.2035	252.958	0,01 %
Dominion Energy Gas Holdings LLC	250.000	3,55 %	01.11.2023	252.954	0,01 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	250.000	3,05 %	09.01.2020	252.889	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	250.000	2,79 %	25.01.2022	252.840	0,01 %
Newell Brands Inc.	250.000	3,15 %	01.04.2021	252.808	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	250.000	3,00 %	15.09.2022	252.791	0,01 %
McDonald's Corp.	250.000	2,75 %	09.12.2020	252.540	0,01 %
Kansas City Power & Light Co.	210.000	5,30 %	01.10.2041	252.539	0,01 %
PepsiCo, Inc.	250.000	2,75 %	01.03.2023	252.342	0,01 %
Emerson Electric Co.	250.000	2,63 %	01.12.2021	252.321	0,01 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust	254.000	1,76 %	15.09.2022	252.121	0,01 %
FedEx Corp.	250.000	3,25 %	01.04.2026	252.077	0,01 %
Essex Portfolio LP	250.000	3,50 %	01.04.2025	251.993	0,01 %
Activision Blizzard, Inc.	250.000	3,40 %	15.09.2026	251.974	0,01 %
Municipal Electric Authority of Georgia	200.000	6,66 %	01.04.2057	251.920	0,01 %
Home Depot, Inc.	250.000	2,70 %	01.04.2023	251.890	0,01 %
ONEOK Partners LP	250.000	3,38 %	01.10.2022	251.852	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	250.000	2,60 %	17.08.2020	251.783	0,01 %
Southern Copper Corp.	225.000	5,25 %	08.11.2042	251.748	0,01 %
Southern California Edison Co.	200.000	5,55 %	15.01.2037	251.688	0,01 %
Coca-Cola Co.	250.000	2,45 %	01.11.2020	251.639	0,01 %
Fiserv, Inc.	250.000	2,70 %	01.06.2020	251.633	0,01 %
AbbVie, Inc.	235.000	4,30 %	14.05.2036	251.591	0,01 %
Federal National Mortgage Association^	250.000	2,61 %	25.10.2021	251.472	0,01 %
US Bancorp	250.000	2,63 %	24.01.2022	251.438	0,01 %
Exxon Mobil Corp.	252.000	1,82 %	15.03.2019	251.296	0,01 %
PNC Financial Services Group, Inc.	245.000	3,30 %	08.03.2022	251.117	0,01 %
TC PipeLines LP	250.000	3,90 %	25.05.2027	251.079	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	250.000	3,00 %	15.04.2023	251.031	0,01 %
Priceline Group, Inc.	250.000	3,60 %	01.06.2026	250.997	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	250.000	3,13 %	23.01.2025	250.951	0,01 %
Caterpillar, Inc.	200.000	5,20 %	27.05.2041	250.906	0,01 %
Compass Bank	250.000	2,75 %	29.09.2019	250.725	0,01 %
BB&T Corp.	250.000	2,45 %	15.01.2020	250.718	0,01 %
Federal National Mortgage Association^	250.000	2,96 %	25.02.2027	250.592	0,01 %
Synchrony Financial	250.000	2,70 %	03.02.2020	250.538	0,01 %
Celgene Corp.	250.000	3,45 %	15.11.2027	250.522	0,01 %
MassMutual Global Funding II	250.000	2,45 %	23.11.2020	250.421	0,01 %
Spectra Energy Partners LP	250.000	3,50 %	15.03.2025	250.395	0,01 %
Amphenol Corp.	250.000	2,55 %	30.01.2019	250.359	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	250.000	2,60 %	07.02.2022	250.265	0,01 %
Manufacturers & Traders Trust Co.	250.000	2,30 %	30.01.2019	250.253	0,01 %
John Deere Capital Corp.	250.000	2,80 %	06.03.2023	250.178	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	250.000	2,10 %	09.06.2019	250.128	0,01 %
Sempra Energy	250.000	2,40 %	15.03.2020	250.108	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
CBS Corp.	250.000	2,30 %	15.08.2019	250.104	0,01 %
NVIDIA Corp.	250.000	3,20 %	16.09.2026	250.097	0,01 %
AT&T, Inc.	250.000	2,30 %	11.03.2019	250.046	0,01 %
Huntington National Bank	250.000	2,38 %	10.03.2020	250.028	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	250.000	2,85 %	25.01.2026	249.945	0,01 %
Discover Card Execution Note Trust	250.000	2,19 %	17.04.2023	249.900	0,01 %
Intercontinental Exchange, Inc.	250.000	3,10 %	15.09.2027	249.897	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016	250.000	3,10 %	15.06.2049	249.845	0,01 %
International Business Machines Corp.	250.000	1,95 %	12.02.2019	249.744	0,01 %
Branch Banking & Trust Co.	250.000	2,25 %	01.06.2020	249.719	0,01 %
PNC Financial Services Group, Inc.	250.000	3,15 %	19.05.2027	249.502	0,01 %
Costco Wholesale Corp.	250.000	2,75 %	18.05.2024	249.496	0,01 %
Public Service Electric & Gas Co.	250.000	3,00 %	15.05.2027	249.297	0,01 %
Entergy Louisiana LLC	250.000	3,12 %	01.09.2027	249.281	0,01 %
Delta Air Lines, Inc.	250.000	2,60 %	04.12.2020	249.279	0,01 %
KeyBank NA	250.000	3,40 %	20.05.2026	249.191	0,01 %
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A	250.000	1,76 %	15.02.2021	249.179	0,01 %
Discover Card Execution Note Trust	250.000	1,45 %	15.03.2021	249.159	0,01 %
ONE Gas, Inc.	250.000	2,07 %	01.02.2019	249.144	0,01 %
Chevron Phillips Chemical Co. LLC/Chevron Phillips Chemical Co. LP	250.000	2,45 %	01.05.2020	249.104	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	250.000	2,45 %	01.10.2022	249.055	0,01 %
E*TRADE Financial Corp.	250.000	3,80 %	24.08.2027	248.903	0,01 %
US Bank NA	250.000	2,00 %	24.01.2020	248.903	0,01 %
Molson Coors Brewing Co.	250.000	1,90 %	15.03.2019	248.899	0,01 %
Analog Devices, Inc.	250.000	2,88 %	01.06.2023	248.883	0,01 %
Southern Co.	250.000	2,35 %	01.07.2021	248.797	0,01 %
Molson Coors Brewing Co.	250.000	2,25 %	15.03.2020	248.778	0,01 %
South Carolina Electric & Gas Co.	200.000	6,05 %	15.01.2038	248.729	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	250.000	3,30 %	23.08.2029	248.690	0,01 %
Berkshire Hathaway, Inc.	250.000	2,20 %	15.03.2021	248.582	0,01 %
Intel Corp.	250.000	1,85 %	11.05.2020	248.574	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	200.000	5,88 %	05.04.2027	248.455	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	250.000	2,27 %	25.03.2022	248.425	0,01 %
Regions Financial Corp.	250.000	2,75 %	14.08.2022	248.364	0,01 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	250.000	2,85 %	27.01.2025	248.343	0,01 %
Crown Castle International Corp.	250.000	3,65 %	01.09.2027	248.287	0,01 %
Chase Issuance Trust	250.000	1,84 %	15.04.2022	248.211	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	250.000	2,80 %	15.11.2024	248.184	0,01 %
General Mills, Inc.	250.000	2,60 %	12.10.2022	248.165	0,01 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	250.000	2,19 %	20.11.2023	248.107	0,01 %
Manufacturers & Traders Trust Co.	250.000	2,05 %	17.08.2020	248.045	0,01 %
Voya Financial, Inc.	250.000	3,13 %	15.07.2024	247.962	0,01 %
Home Depot, Inc.	250.000	1,80 %	05.06.2020	247.950	0,01 %
Apple, Inc.	250.000	2,30 %	11.05.2022	247.897	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	243.000	3,45 %	15.07.2050	247.809	0,01 %
Hospitality Properties Trust	237.000	4,50 %	15.06.2023	247.769	0,01 %
Microsoft Corp.	250.000	2,38 %	01.05.2023	247.648	0,01 %
Microsoft Corp.	200.000	4,75 %	03.11.2055	247.616	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	250.000	2,38 %	15.10.2022	247.583	0,01 %
PepsiCo, Inc.	250.000	1,85 %	30.04.2020	247.582	0,01 %
Costco Wholesale Corp.	250.000	2,30 %	18.05.2022	247.581	0,01 %
Chase Issuance Trust	250.000	1,37 %	15.06.2021	247.577	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC [^]	250.000	5,25 %	16.08.2077	247.572	0,01 %
Apple, Inc.	250.000	1,80 %	11.05.2020	247.550	0,01 %
NVIDIA Corp.	250.000	2,20 %	16.09.2021	247.493	0,01 %
United Technologies Corp.	250.000	1,90 %	04.05.2020	247.460	0,01 %
PNC Bank NA	250.000	2,15 %	29.04.2021	247.443	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	250.000	2,95 %	15.11.2026	247.404	0,01 %
PACCAR Financial Corp.	250.000	1,30 %	10.05.2019	247.302	0,01 %
ConocoPhillips	200.000	5,90 %	15.10.2032	247.300	0,01 %
Marathon Oil Corp.	225.000	5,20 %	01.06.2045	247.273	0,01 %
Port Authority of New York & New Jersey	200.000	4,93 %	01.10.2051	247.124	0,01 %
Praxair, Inc.	250.000	2,65 %	05.02.2025	247.054	0,01 %
Aetna, Inc.	250.000	2,75 %	15.11.2022	247.020	0,01 %
Lowe's Cos, Inc.	225.000	4,38 %	15.09.2045	246.903	0,01 %
Hess Corp.	200.000	7,88 %	01.10.2029	246.869	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Principal Financial Group, Inc.	250.000	3,10 %	15.11.2026	246.851	0,01 %
First Republic Bank	250.000	2,50 %	06.06.2022	246.669	0,01 %
Ecolab, Inc.	250.000	2,38 %	10.08.2022	246.666	0,01 %
Huntington National Bank	250.000	2,50 %	07.08.2022	246.549	0,01 %
Exelon Generation Co. LLC	225.000	5,75 %	01.10.2041	246.501	0,01 %
BB&T Corp.	250.000	2,05 %	10.05.2021	246.462	0,01 %
Phillips 66	225.000	4,65 %	15.11.2034	246.195	0,01 %
Energy Transfer LP	250.000	4,90 %	15.03.2035	246.179	0,01 %
John Deere Capital Corp.	250.000	1,25 %	09.10.2019	246.105	0,01 %
Abbott Laboratories	250.000	2,95 %	15.03.2025	246.090	0,01 %
Microsoft Corp.	250.000	2,13 %	15.11.2022	246.012	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	250.000	1,85 %	04.09.2020	245.960	0,01 %
Texas Instruments, Inc.	250.000	2,25 %	01.05.2023	245.612	0,01 %
Home Depot, Inc.	250.000	2,80 %	14.09.2027	245.515	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	200.000	5,15 %	01.09.2043	245.379	0,01 %
Hyundai Capital America	250.000	1,75 %	27.09.2019	245.321	0,01 %
NBCUniversal Media LLC	225.000	4,45 %	15.01.2043	245.298	0,01 %
CSX Corp.	200.000	5,50 %	15.04.2041	245.051	0,01 %
Jackson National Life Global Funding	250.000	2,10 %	25.10.2021	245.001	0,01 %
Corning, Inc.	200.000	5,75 %	15.08.2040	244.862	0,01 %
Noble Energy, Inc.	225.000	5,25 %	15.11.2043	244.859	0,01 %
Spectra Energy Partners LP	200.000	5,95 %	25.09.2043	244.837	0,01 %
Molson Coors Brewing Co.	250.000	2,10 %	15.07.2021	244.772	0,01 %
Johnson & Johnson	250.000	2,05 %	01.03.2023	244.763	0,01 %
Reynolds American, Inc.	225.000	4,85 %	15.09.2023	244.748	0,01 %
Southern California Edison Co.	200.000	5,35 %	15.07.2035	244.513	0,01 %
Citigroup, Inc.	200.000	6,00 %	31.10.2033	244.033	0,01 %
LifeStorage LP	250.000	3,50 %	01.07.2026	243.632	0,01 %
PacifiCorp	225.000	4,10 %	01.02.2042	243.626	0,01 %
General Motors Co.	200.000	6,60 %	01.04.2036	243.544	0,01 %
PepsiCo, Inc.	250.000	1,70 %	06.10.2021	243.526	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	250.000	2,95 %	19.09.2026	243.518	0,01 %
Potomac Electric Power Co.	175.000	6,50 %	15.11.2037	243.382	0,01 %
Apache Corp.	225.000	5,10 %	01.09.2040	243.359	0,01 %
Dominion Energy, Inc.^	225.000	5,75 %	01.10.2054	243.301	0,01 %
Progressive Corp.	225.000	4,13 %	15.04.2047	243.132	0,01 %
Target Corp.	250.000	3,63 %	15.04.2046	242.734	0,01 %
Comcast Corp.	175.000	6,40 %	01.03.2040	242.630	0,01 %
Boeing Co.	200.000	8,75 %	15.08.2021	242.536	0,01 %
Southern California Gas Co.	250.000	2,60 %	15.06.2026	242.502	0,01 %
Total System Services, Inc.	225.000	4,80 %	01.04.2026	242.032	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016	230.000	3,79 %	15.12.2049	241.696	0,01 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	225.000	4,40 %	30.05.2047	241.540	0,01 %
Expedia, Inc.	250.000	3,80 %	15.02.2028	241.533	0,01 %
PNC Bank NA	225.000	4,20 %	01.11.2025	241.208	0,01 %
Moody's Corp.	225.000	4,50 %	01.09.2022	240.737	0,01 %
Prudential Financial, Inc.	225.000	5,38 %	21.06.2020	240.552	0,01 %
Time Warner Cable LLC	255.000	4,50 %	15.09.2042	240.506	0,01 %
Anadarko Petroleum Corp.	200.000	6,20 %	15.03.2040	240.333	0,01 %
Rockwell Collins, Inc.	240.000	2,80 %	15.03.2022	240.234	0,01 %
Target Corp.	250.000	2,50 %	15.04.2026	239.917	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	200.000	5,05 %	01.03.2041	239.887	0,01 %
General Electric Co.	226.000	5,50 %	08.01.2020	239.881	0,01 %
Sabine Pass Liquefaction LLC	225.000	5,00 %	15.03.2027	239.625	0,01 %
Mead Johnson Nutrition Co.	225.000	4,13 %	15.11.2025	239.456	0,01 %
Bank of America Corp.	200.000	4,88 %	01.04.2044	239.415	0,01 %
Realty Income Corp.	250.000	3,00 %	15.01.2027	239.181	0,01 %
Duke Energy Corp.	250.000	2,65 %	01.09.2026	239.034	0,01 %
MetLife, Inc.	225.000	7,72 %	15.02.2019	239.016	0,01 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	250.000	3,13 %	15.01.2025	238.823	0,01 %
Eaton Corp.	230.000	4,15 %	02.11.2042	238.590	0,01 %
Wyeth LLC	175.000	6,50 %	01.02.2034	238.508	0,01 %
Johnson & Johnson	200.000	4,85 %	15.05.2041	238.428	0,01 %
ONEOK, Inc.	200.000	7,50 %	01.09.2023	237.981	0,01 %
Memorial Sloan-Kettering Cancer Center	225.000	4,13 %	01.07.2052	237.926	0,01 %
Fifth Third Bancorp	225.000	4,30 %	16.01.2024	237.775	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
NIKE, Inc.	250.000	2,38 %	01.11.2026	237.685	0,01 %
Johnson & Johnson	175.000	5,85 %	15.07.2038	237.561	0,01 %
NBCUniversal Media LLC	175.000	6,40 %	30.04.2040	237.466	0,01 %
Coca-Cola Co.	250.000	2,25 %	01.09.2026	237.361	0,01 %
ERP Operating LP	225.000	4,75 %	15.07.2020	237.190	0,01 %
Home Depot, Inc.	225.000	3,75 %	15.02.2024	237.136	0,01 %
Johnson & Johnson	225.000	3,63 %	03.03.2037	236.835	0,01 %
Kroger Co.	225.000	5,00 %	15.04.2042	236.470	0,01 %
Oregon School Boards Association	200.000	5,68 %	30.06.2028	236.418	0,01 %
Illinois Tool Works, Inc.	225.000	6,25 %	01.04.2019	236.279	0,01 %
Huntington Bancshares, Inc.	240.000	2,30 %	14.01.2022	236.156	0,01 %
DTE Electric Co.	225.000	3,65 %	15.03.2024	236.144	0,01 %
Citigroup, Inc.	200.000	5,30 %	06.05.2044	236.080	0,01 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	200.000	7,00 %	01.09.2022	236.029	0,01 %
PepsiCo, Inc.	225.000	4,00 %	02.05.2047	236.026	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	225.000	3,63 %	15.12.2047	236.018	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	200.000	6,55 %	15.09.2040	235.898	0,01 %
L3 Technologies, Inc.	225.000	5,20 %	15.10.2019	235.792	0,01 %
Baltimore Gas & Electric Co.	250.000	2,40 %	15.08.2026	235.681	0,01 %
City of San Antonio TX Electric & Gas Systems Revenue	175.000	5,99 %	01.02.2039	235.652	0,01 %
LYB International Finance BV	225.000	4,00 %	15.07.2023	235.637	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	225.000	3,49 %	25.01.2024	235.566	0,01 %
Duke Energy Carolinas LLC	225.000	4,30 %	15.06.2020	235.554	0,01 %
Amgen, Inc.	235.000	3,20 %	02.11.2027	235.497	0,01 %
Apache Corp.	200.000	6,00 %	15.01.2037	235.443	0,01 %
Boston Properties LP	225.000	4,13 %	15.05.2021	235.212	0,01 %
Williams Partners LP	200.000	5,80 %	15.11.2043	234.597	0,01 %
TJX Cos, Inc.	250.000	2,25 %	15.09.2026	234.549	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	225.000	3,30 %	25.07.2024	233.950	0,01 %
Dominion Energy, Inc.	185.000	5,95 %	15.06.2035	233.930	0,01 %
City of New York NY	200.000	5,21 %	01.10.2031	233.802	0,01 %
Federal National Mortgage Association	225.000	3,73 %	25.06.2021	233.788	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	225.000	3,39 %	25.03.2024	233.701	0,01 %
Time Warner Cable LLC	200.000	6,55 %	01.05.2037	233.644	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.^	225.000	3,33 %	25.08.2025	233.518	0,01 %
Lockheed Martin Corp.	225.000	4,25 %	15.11.2019	233.499	0,01 %
Union Pacific Corp.	218.000	4,16 %	15.07.2022	233.497	0,01 %
General Motors Co.	220.000	5,00 %	01.04.2035	233.482	0,01 %
Citigroup, Inc.	225.000	3,88 %	25.10.2023	233.445	0,01 %
Verisk Analytics, Inc.	225.000	4,00 %	15.06.2025	232.999	0,01 %
Los Angeles Community College District	150.000	6,75 %	01.08.2049	232.826	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	200.000	4,65 %	15.08.2043	232.589	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	225.000	3,35 %	15.07.2022	231.931	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	225.000	3,65 %	15.12.2025	231.665	0,01 %
Entergy Arkansas, Inc.	225.000	3,50 %	01.04.2026	231.588	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	225.000	3,45 %	15.03.2021	231.566	0,01 %
Electronic Arts, Inc.	225.000	3,70 %	01.03.2021	231.529	0,01 %
FedEx Corp.	200.000	5,10 %	15.01.2044	231.354	0,01 %
Lockheed Martin Corp.	225.000	3,35 %	15.09.2021	231.274	0,01 %
Arch Capital Finance LLC	200.000	5,03 %	15.12.2046	231.264	0,01 %
AvalonBay Communities, Inc.	225.000	3,63 %	01.10.2020	231.251	0,01 %
Capital One Financial Corp.	225.000	3,75 %	24.04.2024	231.108	0,01 %
CSX Corp.	175.000	6,22 %	30.04.2040	230.964	0,01 %
International Paper Co.	215.000	4,75 %	15.02.2022	230.801	0,01 %
Dominion Energy, Inc.	200.000	4,90 %	01.08.2041	230.521	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	225.000	3,42 %	15.09.2050	230.465	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	230.000	2,40 %	01.02.2019	230.039	0,01 %
John Sevier Combined Cycle Generation LLC	207.531	4,63 %	15.01.2042	229.742	0,01 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	225.000	3,43 %	15.08.2050	229.557	0,01 %
Cox Communications, Inc.	225.000	3,85 %	01.02.2025	229.550	0,01 %
South Carolina Electric & Gas Co.	225.000	4,10 %	15.06.2046	229.424	0,01 %
Comcast Corp.	210.000	4,40 %	15.08.2035	229.375	0,01 %
Valero Energy Corp.	200.000	4,90 %	15.03.2045	228.824	0,01 %
Metropolitan Transportation Authority	160.000	6,81 %	15.11.2040	228.674	0,01 %
Exelon Corp.	225.000	3,50 %	01.06.2022	228.515	0,01 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015	225.000	3,25 %	15.02.2048	228.470	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Philip Morris International, Inc.	200.000	4,88 %	15.11.2043	228.273	0,01 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	225.000	3,38 %	30.11.2021	228.213	0,01 %
Target Corp.	225.000	3,90 %	15.11.2047	228.023	0,01 %
eBay, Inc.	230.000	3,60 %	05.06.2027	227.918	0,01 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	200.000	4,45 %	15.03.2044	227.795	0,01 %
Analog Devices, Inc.	225.000	3,50 %	05.12.2026	227.503	0,01 %
Kroger Co.	225.000	2,95 %	01.11.2021	227.480	0,01 %
Applied Materials, Inc.	225.000	2,63 %	01.10.2020	227.356	0,01 %
CSX Corp.	175.000	6,15 %	01.05.2037	227.161	0,01 %
NiSource Finance Corp.	200.000	4,80 %	15.02.2044	227.048	0,01 %
NBCUniversal Media LLC	225.000	2,88 %	15.01.2023	227.002	0,01 %
MidAmerican Energy Co.	200.000	4,40 %	15.10.2044	226.831	0,01 %
Waste Management, Inc.	225.000	2,90 %	15.09.2022	226.823	0,01 %
Xilinx, Inc.	225.000	3,00 %	15.03.2021	226.743	0,01 %
Select Income	225.000	4,50 %	01.02.2025	226.655	0,01 %
Express Scripts Holding Co.	225.000	3,50 %	15.06.2024	226.492	0,01 %
BB&T Corp.	225.000	2,75 %	01.04.2022	226.478	0,01 %
Home Depot, Inc.	200.000	4,40 %	15.03.2045	226.349	0,01 %
Phillips 66 Partners LP	225.000	3,61 %	15.02.2025	226.267	0,01 %
TD Ameritrade Holding Corp.	225.000	3,30 %	01.04.2027	226.163	0,01 %
Delta Air Lines, Inc.	225.000	2,88 %	13.03.2020	226.120	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	225.000	3,10 %	15.03.2026	226.057	0,01 %
AXIS Specialty Finance plc	225.000	4,00 %	06.12.2027	226.013	0,01 %
Capital One Financial Corp.	225.000	3,05 %	09.03.2022	225.841	0,01 %
Franklin Resources, Inc.	225.000	2,80 %	15.09.2022	225.738	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	200.000	4,45 %	15.02.2044	225.559	0,01 %
Magellan Midstream Partners LP	200.000	5,15 %	15.10.2043	225.539	0,01 %
Federal National Mortgage Association^	225.447	2,17 %	25.09.2019	225.492	0,01 %
Santander Holdings USA, Inc.	225.000	2,70 %	24.05.2019	225.324	0,01 %
Applied Materials, Inc.	200.000	4,35 %	01.04.2047	225.292	0,01 %
Occidental Petroleum Corp.	200.000	4,63 %	15.06.2045	225.273	0,01 %
CD 2017-CD3 Mortgage Trust	216.000	3,63 %	10.02.2050	225.258	0,01 %
International Business Machines Corp.	225.000	2,50 %	27.01.2022	225.130	0,01 %
Perrigo Finance Unlimited Co.	222.000	3,50 %	15.03.2021	225.121	0,01 %
PNC Bank NA	225.000	2,63 %	17.02.2022	225.109	0,01 %
Walt Disney Co.	225.000	3,00 %	13.02.2026	225.085	0,01 %
McKesson Corp.	225.000	2,28 %	15.03.2019	225.052	0,01 %
Marathon Oil Corp.	225.000	2,70 %	01.06.2020	224.846	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	225.000	2,65 %	15.12.2024	224.782	0,01 %
Smithfield Foods, Inc.	225.000	3,35 %	01.02.2022	224.701	0,01 %
Westlake Chemical Corp.	200.000	5,00 %	15.08.2046	224.557	0,01 %
International Business Machines Corp.	225.000	1,88 %	15.05.2019	224.491	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	225.000	2,67 %	25.12.2024	224.413	0,01 %
Halliburton Co.	200.000	4,85 %	15.11.2035	224.187	0,01 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	200.000	4,50 %	01.02.2045	224.133	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	225.000	2,75 %	25.01.2026	224.111	0,01 %
International Business Machines Corp.	225.000	2,25 %	19.02.2021	223.954	0,01 %
Apple, Inc.	225.000	1,90 %	07.02.2020	223.949	0,01 %
Anadarko Petroleum Corp.	200.000	5,55 %	15.03.2026	223.934	0,01 %
Citizens Bank NA	225.000	2,25 %	02.03.2020	223.824	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	225.000	3,95 %	01.12.2047	223.673	0,01 %
PepsiCo, Inc.	225.000	1,55 %	02.05.2019	223.666	0,01 %
Capital One Financial Corp.	220.000	3,50 %	15.06.2023	223.581	0,01 %
CSX Corp.	175.000	6,00 %	01.10.2036	223.447	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	225.000	2,00 %	21.02.2020	223.419	0,01 %
Federal National Mortgage Association^	226.221	2,39 %	25.03.2023	223.398	0,01 %
Citibank NA	225.000	1,85 %	18.09.2019	223.372	0,01 %
Citibank NA	225.000	2,10 %	12.06.2020	222.991	0,01 %
Boardwalk Pipelines LP	200.000	5,95 %	01.06.2026	222.861	0,01 %
Progressive Corp.	175.000	6,63 %	01.03.2029	222.839	0,01 %
International Business Machines Corp.	200.000	8,38 %	01.11.2019	222.559	0,01 %
HSBC Finance Corp.	200.000	6,68 %	15.01.2021	222.362	0,01 %
SunTrust Bank	225.000	3,30 %	15.05.2026	222.326	0,01 %
Devon Energy Corp.	200.000	5,00 %	15.06.2045	222.316	0,01 %
Simon Property Group LP	200.000	4,75 %	15.03.2042	221.991	0,01 %
Swiss Re Treasury US Corp.	210.000	4,25 %	06.12.2042	221.860	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Kraft Heinz Foods Co.	175.000	6,50 %	09.02.2040	221.848	0,01 %
Duquesne Light Holdings, Inc.	200.000	5,90 %	01.12.2021	221.445	0,01 %
CVS Health Corp.	225.000	2,75 %	01.12.2022	221.287	0,01 %
International Lease Finance Corp.	200.000	5,88 %	15.08.2022	221.250	0,01 %
MetLife, Inc.	150.000	9,25 %	08.04.2038	221.250	0,01 %
Federal National Mortgage Association	225.000	2,15 %	25.01.2023	221.175	0,01 %
Aetna, Inc.	225.000	3,88 %	15.08.2047	221.144	0,01 %
Anadarko Petroleum Corp.	225.000	4,50 %	15.07.2044	221.121	0,01 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	200.000	4,63 %	01.02.2044	221.024	0,01 %
Georgia-Pacific LLC	205.000	5,40 %	01.11.2020	221.015	0,01 %
Occidental Petroleum Corp.	200.000	4,40 %	15.04.2046	220.722	0,01 %
Waste Management, Inc.	225.000	2,40 %	15.05.2023	220.599	0,01 %
Puget Energy, Inc.	200.000	6,50 %	15.12.2020	220.517	0,01 %
CVS Health Corp.	200.000	4,88 %	20.07.2035	220.492	0,01 %
Florida Power & Light Co.	200.000	4,13 %	01.02.2042	220.436	0,01 %
Ohio Power Co.	200.000	5,38 %	01.10.2021	220.012	0,01 %
Precision Castparts Corp.	215.000	3,25 %	15.06.2025	219.942	0,01 %
Pfizer, Inc.	200.000	4,00 %	15.12.2036	219.791	0,01 %
Duke Energy Progress LLC	200.000	4,20 %	15.08.2045	219.631	0,01 %
Home Depot, Inc.	200.000	4,20 %	01.04.2043	219.318	0,01 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	175.000	5,30 %	01.06.2042	219.298	0,01 %
ERP Operating LP	200.000	4,50 %	01.06.2045	219.242	0,01 %
NV Energy, Inc.	200.000	6,25 %	15.11.2020	219.110	0,01 %
Apache Corp.	200.000	5,25 %	01.02.2042	219.008	0,01 %
Prudential Financial, Inc.^	200.000	5,88 %	15.09.2042	218.644	0,01 %
PECO Energy Co.	200.000	4,15 %	01.10.2044	218.643	0,01 %
Archer-Daniels-Midland Co.	180.000	5,38 %	15.09.2035	218.528	0,01 %
Allstate Corp.^	200.000	5,75 %	15.08.2053	218.250	0,01 %
Ventas Realty LP	225.000	3,25 %	15.10.2026	218.043	0,01 %
US Treasury Note	220.000	2,00 %	30.11.2022	218.041	0,01 %
MPLX LP	200.000	5,20 %	01.03.2047	217.873	0,01 %
Federal Realty Investment Trust	200.000	4,50 %	01.12.2044	217.800	0,01 %
Welltower, Inc.	200.000	5,25 %	15.01.2022	217.332	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	200.000	4,50 %	20.03.2042	217.259	0,01 %
L3 Technologies, Inc.	205.000	4,95 %	15.02.2021	217.213	0,01 %
Ford Motor Co.	200.000	5,29 %	08.12.2046	216.739	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	200.000	4,15 %	01.04.2045	216.682	0,01 %
Rockwell Collins, Inc.	200.000	4,35 %	15.04.2047	216.604	0,01 %
Northern States Power Co.	200.000	4,00 %	15.08.2045	216.352	0,01 %
Eastman Chemical Co.	200.000	4,65 %	15.10.2044	216.277	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	175.000	4,88 %	08.07.2040	216.205	0,01 %
Spectra Energy Partners LP	200.000	4,75 %	15.03.2024	216.196	0,01 %
S&P Global, Inc.	200.000	4,40 %	15.02.2026	215.629	0,01 %
KeyCorp	200.000	5,10 %	24.03.2021	215.607	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	200.000	6,50 %	01.04.2020	215.575	0,01 %
Mosaic Co.	200.000	5,63 %	15.11.2043	215.166	0,01 %
Lincoln National Corp.	200.000	6,25 %	15.02.2020	215.066	0,01 %
Crown Castle International Corp.	200.000	4,88 %	15.04.2022	214.837	0,01 %
MPLX LP	200.000	4,88 %	01.12.2024	214.820	0,01 %
Alleghany Corp.	200.000	5,63 %	15.09.2020	214.807	0,01 %
Parker-Hannifin Corp.	200.000	4,10 %	01.03.2047	214.423	0,01 %
Anadarko Petroleum Corp.	200.000	8,70 %	15.03.2019	214.277	0,01 %
Arizona Public Service Co.	200.000	8,75 %	01.03.2019	214.271	0,01 %
Florida Gas Transmission Co. LLC	200.000	7,90 %	15.05.2019	214.236	0,01 %
Expedia, Inc.	200.000	5,00 %	15.02.2026	213.816	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	200.000	5,50 %	01.03.2044	213.768	0,01 %
ONEOK Partners LP	200.000	8,63 %	01.03.2019	213.556	0,01 %
Boston Scientific Corp.	200.000	6,00 %	15.01.2020	213.262	0,01 %
MetLife, Inc.	200.000	4,75 %	08.02.2021	213.113	0,01 %
Baylor Scott & White Holdings	200.000	4,19 %	15.11.2045	213.043	0,01 %
Columbia Pipeline Group, Inc.	200.000	4,50 %	01.06.2025	213.026	0,01 %
Celgene Corp.	200.000	4,63 %	15.05.2044	213.009	0,01 %
General Electric Co.	198.000	5,30 %	11.02.2021	212.958	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	150.000	6,63 %	15.11.2037	212.838	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	200.000	4,25 %	15.04.2021	212.555	0,01 %
Bemis Co., Inc.	200.000	6,80 %	01.08.2019	212.536	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Lear Corp.	200.000	5,25 %	15.01.2025	212.500	0,01 %
O'Reilly Automotive, Inc.	200.000	4,63 %	15.09.2021	212.413	0,01 %
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	200.000	4,60 %	01.04.2022	212.044	0,01 %
Wells Fargo & Co.	175.000	5,38 %	07.02.2035	212.002	0,01 %
Albemarle Corp.	200.000	4,15 %	01.12.2024	211.890	0,01 %
Waste Management, Inc.	200.000	4,75 %	30.06.2020	211.805	0,01 %
Nabors Industries, Inc.	200.000	9,25 %	15.01.2019	211.750	0,01 %
New York & Presbyterian Hospital	200.000	4,02 %	01.08.2045	211.717	0,01 %
Travelers Cos, Inc.	200.000	4,00 %	30.05.2047	211.687	0,01 %
Public Service Electric & Gas Co.	200.000	3,80 %	01.03.2046	211.655	0,01 %
Honeywell International, Inc.	200.000	4,25 %	01.03.2021	211.540	0,01 %
New Jersey Economic Development Authority	225.000	0,00 %	15.02.2020	211.525	0,01 %
FedEx Corp.	200.000	8,00 %	15.01.2019	211.524	0,01 %
Northern Trust Corp.	200.000	3,95 %	30.10.2025	211.519	0,01 %
HSBC USA, Inc.	200.000	5,00 %	27.09.2020	211.498	0,01 %
US Bancorp	225.000	2,38 %	22.07.2026	211.294	0,01 %
QVC, Inc.	200.000	5,13 %	02.07.2022	211.244	0,01 %
PartnerRe Finance B LLC	200.000	5,50 %	01.06.2020	211.211	0,01 %
Nucor Corp.	175.000	5,20 %	01.08.2043	210.847	0,01 %
El du Pont de Nemours & Co.	200.000	4,25 %	01.04.2021	210.806	0,01 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	220.000	3,75 %	15.02.2028	210.786	0,01 %
Lowe's Cos, Inc.	200.000	3,88 %	15.09.2023	210.766	0,01 %
Federal National Mortgage Association	212.290	2,62 %	25.12.2024	210.734	0,01 %
Phillips 66 Partners LP	200.000	4,90 %	01.10.2046	210.712	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	200.000	4,25 %	15.03.2046	210.603	0,01 %
EnLink Midstream Partners LP	200.000	5,60 %	01.04.2044	210.584	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	200.000	5,75 %	15.01.2020	210.570	0,01 %
United Airlines 2013-1 Klasse A Pass Through Trust	200.296	4,30 %	15.08.2025	210.563	0,01 %
Republic Services, Inc.	200.000	5,00 %	01.03.2020	210.540	0,01 %
Norfolk Southern Corp.	203.000	4,05 %	15.08.2052	210.520	0,01 %
Adobe Systems, Inc.	200.000	4,75 %	01.02.2020	210.513	0,01 %
VEREIT Operating Partnership LP	200.000	4,60 %	06.02.2024	210.500	0,01 %
Raytheon Co.	175.000	4,88 %	15.10.2040	210.296	0,01 %
Union Pacific Corp.	200.000	3,65 %	15.02.2024	210.251	0,01 %
Cardinal Health, Inc.	200.000	4,63 %	15.12.2020	210.211	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	200.000	3,75 %	24.11.2023	210.197	0,01 %
Time Warner, Inc.	200.000	4,90 %	15.06.2042	210.161	0,01 %
American Tower Corp.	200.000	4,40 %	15.02.2026	210.122	0,01 %
Travelers Cos, Inc.	200.000	5,90 %	02.06.2019	210.118	0,01 %
BlackRock, Inc.	200.000	5,00 %	10.12.2019	210.115	0,01 %
International Paper Co.	200.000	4,40 %	15.08.2047	210.114	0,01 %
Commercial Mortgage Pass Through Certificates	200.000	3,76 %	10.02.2049	210.062	0,01 %
PepsiCo, Inc.	200.000	4,00 %	05.03.2042	210.057	0,01 %
Dow Chemical Co.	200.000	4,25 %	01.10.2034	209.954	0,01 %
New Jersey Transportation Trust Fund Authority	200.000	6,10 %	15.12.2028	209.890	0,01 %
Schlumberger Investment SA	200.000	3,65 %	01.12.2023	209.867	0,01 %
Oracle Corp.	200.000	3,63 %	15.07.2023	209.819	0,01 %
CA, Inc.	200.000	5,38 %	01.12.2019	209.807	0,01 %
Commonwealth of Massachusetts	200.000	4,20 %	01.12.2021	209.724	0,01 %
Eastman Chemical Co.	190.000	4,80 %	01.09.2042	209.448	0,01 %
PNC Financial Services Group, Inc.	200.000	3,90 %	29.04.2024	209.313	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	200.000	4,50 %	26.03.2020	209.289	0,01 %
Alphabet, Inc.	200.000	3,63 %	19.05.2021	209.194	0,01 %
Arizona Public Service Co.	205.000	3,75 %	15.05.2046	209.190	0,01 %
Union Electric Co.	200.000	6,70 %	01.02.2019	209.172	0,01 %
Synchrony Financial	200.000	4,50 %	23.07.2025	209.064	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	200.000	3,65 %	04.02.2024	209.061	0,01 %
MetLife, Inc.	200.000	4,05 %	01.03.2045	208.999	0,01 %
Morgan Stanley	175.000	6,25 %	09.08.2026	208.968	0,01 %
Johnson & Johnson	200.000	3,38 %	05.12.2023	208.849	0,01 %
General Electric Co.	195.000	5,55 %	04.05.2020	208.780	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	200.000	4,30 %	15.03.2045	208.646	0,01 %
General Mills, Inc.	175.000	5,40 %	15.06.2040	208.641	0,01 %
Digital Realty Trust LP	200.000	3,95 %	01.07.2022	208.578	0,01 %
Analog Devices, Inc.	200.000	3,90 %	15.12.2025	208.550	0,01 %
Johnson & Johnson	200.000	3,55 %	01.03.2036	208.350	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Pioneer Natural Resources Co.	200.000	3,95 %	15.07.2022	208.214	0,01 %
Devon Energy Corp.	200.000	4,00 %	15.07.2021	208.192	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	200.000	3,95 %	15.02.2027	208.166	0,01 %
Target Corp.	200.000	3,50 %	01.07.2024	208.086	0,01 %
Stryker Corp.	200.000	4,38 %	15.01.2020	208.039	0,01 %
Exxon Mobil Corp.	209.000	1,91 %	06.03.2020	208.034	0,01 %
Citigroup, Inc.	200.000	4,05 %	30.07.2022	208.024	0,01 %
Monsanto Co.	200.000	4,70 %	15.07.2064	208.015	0,01 %
Duke Energy Corp.	200.000	3,75 %	15.04.2024	207.892	0,01 %
Tennessee Gas Pipeline Co. LLC	175.000	7,00 %	15.03.2027	207.872	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015	200.000	3,64 %	15.06.2048	207.806	0,01 %
Western Gas Partners LP	200.000	4,65 %	01.07.2026	207.758	0,01 %
Omega Healthcare Investors, Inc.	200.000	4,95 %	01.04.2024	207.750	0,01 %
Southern Copper Corp.	200.000	3,88 %	23.04.2025	207.741	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	200.000	4,20 %	01.03.2021	207.718	0,01 %
Commonwealth Edison Co.	200.000	4,00 %	01.08.2020	207.650	0,01 %
Western Union Co.	197.000	5,25 %	01.04.2020	207.613	0,01 %
Lincoln National Corp.	150.000	7,00 %	15.06.2040	207.585	0,01 %
Deere & Co.	200.000	4,38 %	16.10.2019	207.562	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	200.000	3,40 %	01.09.2024	207.556	0,01 %
Trans-Allegheny Interstate Line Co.	200.000	3,85 %	01.06.2025	207.516	0,01 %
BBCMS Mortgage Trust 2017	200.000	3,67 %	15.02.2050	207.434	0,01 %
Abbott Laboratories	200.000	4,13 %	27.05.2020	207.384	0,01 %
Medco Health Solutions, Inc.	200.000	4,13 %	15.09.2020	207.319	0,01 %
Buckeye Partners LP	200.000	4,15 %	01.07.2023	207.209	0,01 %
SCANA Corp.	200.000	4,75 %	15.05.2021	207.065	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	200.000	5,13 %	01.04.2019	207.053	0,01 %
Abbott Laboratories	200.000	5,13 %	01.04.2019	207.028	0,01 %
Spectra Energy Partners LP	200.000	4,50 %	15.03.2045	206.897	0,01 %
PacifiCorp	200.000	5,50 %	15.01.2019	206.865	0,01 %
Biogen, Inc.	200.000	3,63 %	15.09.2022	206.814	0,01 %
International Paper Co.	200.000	3,65 %	15.06.2024	206.804	0,01 %
eBay, Inc.	225.000	4,00 %	15.07.2042	206.701	0,01 %
International Paper Co.	200.000	3,80 %	15.01.2026	206.655	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	200.000	3,50 %	15.03.2027	206.607	0,01 %
Baxalta, Inc.	200.000	4,00 %	23.06.2025	206.597	0,01 %
Air Lease Corp.	200.000	3,75 %	01.02.2022	206.532	0,01 %
ERAC USA Finance LLC	200.000	3,85 %	15.11.2024	206.400	0,01 %
Energy Transfer LP	200.000	4,15 %	01.10.2020	206.334	0,01 %
ERAC USA Finance LLC	175.000	5,63 %	15.03.2042	206.331	0,01 %
Chevron Corp.	200.000	3,33 %	17.11.2025	206.318	0,01 %
Tyco Electronics Group SA	200.000	3,70 %	15.02.2026	206.306	0,01 %
Humana, Inc.	200.000	3,95 %	15.03.2027	206.153	0,01 %
DTE Electric Co.	200.000	3,70 %	15.03.2045	206.127	0,01 %
McDonald's Corp.	200.000	3,50 %	01.03.2027	206.099	0,01 %
VF Corp.	200.000	3,50 %	01.09.2021	205.927	0,01 %
Northrop Grumman Corp.	200.000	3,50 %	15.03.2021	205.893	0,01 %
Stryker Corp.	200.000	3,38 %	15.05.2024	205.782	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	200.000	4,13 %	04.03.2043	205.761	0,01 %
Exxon Mobil Corp.	200.000	3,18 %	15.03.2024	205.595	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	200.000	4,65 %	15.10.2025	205.584	0,01 %
EnLink Midstream Partners LP	200.000	4,40 %	01.04.2024	205.575	0,01 %
Northern Trust Corp.	200.000	3,45 %	04.11.2020	205.560	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	200.000	3,11 %	25.02.2023	205.426	0,01 %
Marriott International, Inc.	200.000	3,75 %	15.03.2025	205.403	0,01 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	150.000	7,00 %	01.05.2032	205.375	0,01 %
Coca-Cola European Partners US LLC	200.000	3,50 %	15.09.2020	205.296	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	150.000	6,35 %	30.11.2037	205.291	0,01 %
American Water Capital Corp.	200.000	3,75 %	01.09.2047	205.242	0,01 %
HSBC USA, Inc.	200.000	3,50 %	23.06.2024	205.196	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	200.000	3,50 %	01.10.2020	205.113	0,01 %
Tyson Foods, Inc.	175.000	5,15 %	15.08.2044	205.105	0,01 %
Nasdaq, Inc.	200.000	3,85 %	30.06.2026	205.060	0,01 %
Marathon Petroleum Corp.	200.000	4,75 %	15.09.2044	205.045	0,01 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	200.000	3,49 %	15.08.2050	204.998	0,01 %
American International Group, Inc.	185.000	6,40 %	15.12.2020	204.953	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Apollo Management Holdings LP	200.000	4,00 %	30.05.2024	204.946	0,01 %
Kilroy Realty LP	200.000	3,80 %	15.01.2023	204.837	0,01 %
Mid-America Apartments LP	200.000	3,75 %	15.06.2024	204.785	0,01 %
New York City Water & Sewer System	150.000	5,75 %	15.06.2041	204.774	0,01 %
Motorola Solutions, Inc.	200.000	4,00 %	01.09.2024	204.759	0,01 %
Washington Prime Group LP	200.000	5,95 %	15.08.2024	204.758	0,01 %
Pioneer Natural Resources Co.	200.000	3,45 %	15.01.2021	204.664	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	200.000	3,38 %	15.04.2027	204.654	0,01 %
Brixmor Operating Partnership LP	200.000	3,88 %	15.08.2022	204.583	0,01 %
WEC Energy Group, Inc.	200.000	3,55 %	15.06.2025	204.546	0,01 %
CenterPoint Energy Transition Bond Co. IV LLC	200.000	3,03 %	15.10.2025	204.523	0,01 %
International Business Machines Corp.	157.000	5,60 %	30.11.2039	204.477	0,01 %
QVC, Inc.	200.000	4,38 %	15.03.2023	204.473	0,01 %
Santander Holdings USA, Inc.	200.000	4,40 %	13.07.2027	204.462	0,01 %
Dow Chemical Co.	175.000	5,25 %	15.11.2041	204.449	0,01 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	200.000	3,72 %	15.06.2050	204.448	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	200.000	3,25 %	01.12.2024	204.422	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	175.000	6,50 %	01.02.2037	204.326	0,01 %
Dominion Energy Gas Holdings LLC	200.000	3,60 %	15.12.2024	204.265	0,01 %
Discover Financial Services	200.000	4,10 %	09.02.2027	204.105	0,01 %
Harley-Davidson, Inc.	200.000	3,50 %	28.07.2025	204.077	0,01 %
Crown Castle International Corp.	200.000	3,40 %	15.02.2021	204.066	0,01 %
Omnicom Group, Inc.	200.000	3,65 %	01.11.2024	204.064	0,01 %
Digital Realty Trust LP	200.000	3,40 %	01.10.2020	204.052	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	200.000	3,02 %	25.01.2025	204.004	0,01 %
Duke Energy Progress LLC	200.000	3,00 %	15.09.2021	203.831	0,01 %
Vulcan Materials Co.	200.000	4,50 %	15.06.2047	203.820	0,01 %
Dallas Convention Center Hotel Development Corp.	150.000	7,09 %	01.01.2042	203.793	0,01 %
NiSource Finance Corp.	200.000	3,95 %	30.03.2048	203.768	0,01 %
Federal National Mortgage Association^	200.000	3,10 %	25.07.2024	203.764	0,01 %
MetLife, Inc.	150.000	6,38 %	15.06.2034	203.738	0,01 %
S&P Global, Inc.	200.000	3,30 %	14.08.2020	203.721	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	200.000	3,25 %	15.06.2027	203.682	0,01 %
Viacom, Inc.	200.000	3,88 %	15.12.2021	203.669	0,01 %
Xcel Energy, Inc.	150.000	6,50 %	01.07.2036	203.603	0,01 %
Anthem, Inc.	200.000	3,65 %	01.12.2027	203.588	0,01 %
CME Group, Inc.	200.000	3,00 %	15.09.2022	203.494	0,01 %
CCRE9 Commercial Mortgage Trust 2013^	190.000	4,23 %	10.07.2045	203.477	0,01 %
Cargill, Inc.	200.000	3,30 %	01.03.2022	203.309	0,01 %
Tyson Foods, Inc.	200.000	3,55 %	02.06.2027	203.292	0,01 %
Kimco Realty Corp.	200.000	3,20 %	01.05.2021	203.064	0,01 %
Boston Properties LP	200.000	3,65 %	01.02.2026	202.873	0,01 %
Lowe's Cos, Inc.	200.000	3,13 %	15.09.2024	202.785	0,01 %
Omega Healthcare Investors, Inc.	200.000	4,38 %	01.08.2023	202.750	0,01 %
AutoNation, Inc.	200.000	3,35 %	15.01.2021	202.625	0,01 %
Microsoft Corp.	200.000	3,50 %	15.11.2042	202.533	0,01 %
Columbia Pipeline Group, Inc.	200.000	3,30 %	01.06.2020	202.411	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	200.000	3,16 %	04.08.2020	202.321	0,01 %
Marriott International, Inc.	200.000	3,13 %	15.10.2021	202.279	0,01 %
US Bancorp	200.000	2,95 %	15.07.2022	202.186	0,01 %
Kraft Heinz Foods Co.	185.000	5,00 %	15.07.2035	201.936	0,01 %
Brixmor Operating Partnership LP	200.000	4,13 %	15.06.2026	201.853	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	200.000	3,25 %	16.05.2027	201.821	0,01 %
Comcast Corp.	200.000	2,85 %	15.01.2023	201.734	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	200.000	2,85 %	15.04.2021	201.679	0,01 %
Juniper Networks, Inc.	200.000	3,30 %	15.06.2020	201.599	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	200.000	5,00 %	01.03.2043	201.596	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	175.000	4,55 %	01.09.2044	201.588	0,01 %
Fifth Third Bank	200.000	2,88 %	01.10.2021	201.543	0,01 %
Southern Co.	200.000	2,75 %	15.06.2020	201.374	0,01 %
Estee Lauder Cos, Inc.	200.000	3,15 %	15.03.2027	201.357	0,01 %
HSBC USA, Inc.	200.000	2,75 %	07.08.2020	201.301	0,01 %
McCormick & Co., Inc.	200.000	3,15 %	15.08.2024	201.252	0,01 %
WEA Finance LLC/Westfield UK & Europe Finance plc	200.000	2,70 %	17.09.2019	201.217	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	200.000	2,94 %	08.01.2019	201.214	0,01 %
Interstate Power & Light Co.	150.000	6,25 %	15.07.2039	201.203	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Exxon Mobil Corp.	200.000	3,57 %	06.03.2045	201.154	0,01 %
BorgWarner, Inc.	200.000	3,38 %	15.03.2025	201.146	0,01 %
John Deere Capital Corp.	200.000	2,65 %	06.01.2022	201.102	0,01 %
Lam Research Corp.	200.000	2,80 %	15.06.2021	201.082	0,01 %
Perrigo Finance Unlimited Co.	200.000	4,90 %	15.12.2044	201.067	0,01 %
Ventas Realty LP	200.000	3,50 %	01.02.2025	201.064	0,01 %
Tyson Foods, Inc.	200.000	2,65 %	15.08.2019	201.061	0,01 %
JM Smucker Co.	200.000	3,00 %	15.03.2022	201.059	0,01 %
Quest Diagnostics, Inc.	200.000	2,70 %	01.04.2019	201.038	0,01 %
AutoZone, Inc.	200.000	3,13 %	15.07.2023	201.014	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	200.000	3,10 %	15.05.2025	200.987	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	200.000	3,22 %	09.01.2022	200.875	0,01 %
Chevron Phillips Chemical Co. LLC/Chevron Phillips Chemical Co. LP	200.000	3,40 %	01.12.2026	200.846	0,01 %
Simon Property Group LP	200.000	3,38 %	01.12.2027	200.846	0,01 %
Sysco Corp.	200.000	2,60 %	01.10.2020	200.846	0,01 %
American Express Credit Corp.	200.000	2,60 %	14.09.2020	200.832	0,01 %
Sysco Corp.	200.000	3,30 %	15.07.2026	200.821	0,01 %
AT&T, Inc.	175.000	6,00 %	15.08.2040	200.770	0,01 %
Target Corp.	147.000	6,50 %	15.10.2037	200.756	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	200.000	3,65 %	01.06.2022	200.734	0,01 %
FedEx Corp.	200.000	3,30 %	15.03.2027	200.713	0,01 %
Northrop Grumman Corp.	200.000	3,20 %	01.02.2027	200.711	0,01 %
SVB Financial Group	200.000	3,50 %	29.01.2025	200.688	0,01 %
GS Mortgage Securities Trust 2013-GCJ12	198.000	3,14 %	10.06.2046	200.584	0,01 %
Dominion Energy, Inc.	200.000	2,50 %	01.12.2019	200.507	0,01 %
Mosaic Co.	200.000	4,05 %	15.11.2027	200.404	0,01 %
Synchrony Financial	200.000	2,60 %	15.01.2019	200.351	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	200.000	2,64 %	25.01.2023	200.322	0,01 %
Automatic Data Processing, Inc.	200.000	2,25 %	15.09.2020	200.316	0,01 %
Monsanto Co.	200.000	2,75 %	15.07.2021	200.302	0,01 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2017	200.000	2,62 %	15.10.2025	200.258	0,01 %
Jackson National Life Global Funding	200.000	2,30 %	16.04.2019	200.242	0,01 %
Progress Energy, Inc.	150.000	7,00 %	30.10.2031	200.190	0,01 %
Halliburton Co.	150.000	6,70 %	15.09.2038	200.170	0,01 %
Wells Fargo & Co.	200.000	2,15 %	15.01.2019	200.134	0,01 %
Reliance Standard Life Global Funding II	200.000	2,50 %	24.04.2019	200.117	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	200.000	2,50 %	03.12.2020	200.116	0,01 %
Aflac, Inc.	200.000	2,40 %	16.03.2020	200.086	0,01 %
ERP Operating LP	200.000	2,38 %	01.07.2019	200.064	0,01 %
Allergan Funding SCS	200.000	2,45 %	15.06.2019	200.047	0,01 %
Eli Lilly & Co.	200.000	1,95 %	15.03.2019	200.038	0,01 %
Manufacturers & Traders Trust Co.	200.000	2,25 %	25.07.2019	199.988	0,01 %
PPG Industries, Inc.	200.000	2,30 %	15.11.2019	199.950	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	200.000	2,60 %	04.11.2019	199.937	0,01 %
Dominion Energy, Inc.	200.000	2,58 %	01.07.2020	199.904	0,01 %
DTE Energy Co.	200.000	2,40 %	01.12.2019	199.875	0,01 %
HCP, Inc.	150.000	6,75 %	01.02.2041	199.872	0,01 %
Huntington National Bank	200.000	2,20 %	01.04.2019	199.866	0,01 %
El du Pont de Nemours & Co.	200.000	2,80 %	15.02.2023	199.858	0,01 %
Lowe's Cos, Inc.	175.000	4,65 %	15.04.2042	199.855	0,01 %
Simon Property Group LP	200.000	2,50 %	15.07.2021	199.833	0,01 %
GATX Corp.	200.000	2,60 %	30.03.2020	199.827	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	200.000	2,65 %	08.04.2022	199.798	0,01 %
Capital One Bank USA NA	200.000	2,30 %	05.06.2019	199.794	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	200.000	2,75 %	15.03.2023	199.662	0,01 %
El du Pont de Nemours & Co.	200.000	2,20 %	01.05.2020	199.641	0,01 %
John Deere Capital Corp.	200.000	1,95 %	08.01.2019	199.635	0,01 %
Aviation Capital Group LLC	200.000	2,88 %	20.01.2022	199.622	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	200.000	2,51 %	25.11.2022	199.578	0,01 %
Ecolab, Inc.	200.000	2,25 %	12.01.2020	199.532	0,01 %
Huntington Ingalls Industries, Inc.	200.000	3,48 %	01.12.2027	199.500	0,01 %
Nucor Corp.	150.000	6,40 %	01.12.2037	199.492	0,01 %
MetLife, Inc.	175.000	4,60 %	13.05.2046	199.476	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	200.000	2,26 %	28.03.2019	199.460	0,01 %
Citigroup, Inc.	200.000	2,05 %	07.06.2019	199.402	0,01 %
ERAC USA Finance LLC	200.000	2,35 %	15.10.2019	199.362	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Walt Disney Co.	200.000	1,85 %	30.05.2019	199.328	0,01 %
Apple, Inc.	200.000	2,00 %	06.05.2020	199.322	0,01 %
Boston Properties LP	200.000	3,20 %	15.01.2025	199.310	0,01 %
Colgate-Palmolive Co.	200.000	1,75 %	15.03.2019	199.307	0,01 %
Campbell Soup Co.	200.000	3,30 %	19.03.2025	199.301	0,01 %
Sysco Corp.	200.000	2,50 %	15.07.2021	199.297	0,01 %
Lear Corp.	200.000	3,80 %	15.09.2027	199.250	0,01 %
MUFG Americas Holdings Corp.	200.000	2,25 %	10.02.2020	199.228	0,01 %
World Financial Network Credit Card Master Trust	200.000	2,31 %	15.08.2024	199.128	0,01 %
EQT Midstream Partners LP	200.000	4,13 %	01.12.2026	199.117	0,01 %
Synchrony Financial	200.000	3,95 %	01.12.2027	199.111	0,01 %
Manufacturers & Traders Trust Co.	200.000	2,10 %	06.02.2020	199.109	0,01 %
CVS Health Corp.	200.000	2,25 %	12.08.2019	199.080	0,01 %
Pfizer, Inc.	200.000	1,70 %	15.12.2019	199.074	0,01 %
Lockheed Martin Corp.	200.000	2,90 %	01.03.2025	199.041	0,01 %
Comerica, Inc.	200.000	2,13 %	23.05.2019	199.025	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	200.000	2,55 %	29.11.2022	198.949	0,01 %
Arrow Electronics, Inc.	195.000	4,00 %	01.04.2025	198.884	0,01 %
Xylem, Inc.	200.000	3,25 %	01.11.2026	198.863	0,01 %
Arrow Electronics, Inc.	200.000	3,88 %	12.01.2028	198.857	0,01 %
Capital One Financial Corp.	200.000	3,30 %	30.10.2024	198.856	0,01 %
Georgia Power Co.	200.000	2,00 %	08.09.2020	198.811	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp	200.000	2,45 %	25.08.2023	198.654	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	200.000	2,40 %	06.06.2022	198.629	0,01 %
Sempra Energy	200.000	2,88 %	01.10.2022	198.593	0,01 %
Pfizer, Inc.	200.000	1,45 %	03.06.2019	198.572	0,01 %
Xcel Energy, Inc.	200.000	2,40 %	15.03.2021	198.565	0,01 %
Xilinx, Inc.	200.000	2,95 %	01.06.2024	198.558	0,01 %
AbbVie, Inc.	200.000	2,30 %	14.05.2021	198.557	0,01 %
S&P Global, Inc.	150.000	6,55 %	15.11.2037	198.531	0,01 %
National Oilwell Varco, Inc.	225.000	3,95 %	01.12.2042	198.469	0,01 %
Williams Partners LP	195.000	3,60 %	15.03.2022	198.461	0,01 %
Walt Disney Co.	200.000	2,95 %	15.06.2027	198.457	0,01 %
United Technologies Corp.	200.000	2,80 %	04.05.2024	198.451	0,01 %
Citizens Bank NA	200.000	2,20 %	26.05.2020	198.431	0,01 %
Chase Issuance Trust	200.000	1,58 %	16.08.2021	198.410	0,01 %
Capital One Financial Corp.	200.000	2,40 %	30.10.2020	198.381	0,01 %
Northrop Grumman Corp.	200.000	2,08 %	15.10.2020	198.343	0,01 %
Applied Materials, Inc.	150.000	5,85 %	15.06.2041	198.195	0,01 %
Duke Realty LP	200.000	3,25 %	30.06.2026	198.175	0,01 %
MassMutual Global Funding II	200.000	2,50 %	17.10.2022	198.169	0,01 %
Sempra Energy	200.000	3,25 %	15.06.2027	198.158	0,01 %
Energy Transfer LP	200.000	5,30 %	15.04.2047	198.126	0,01 %
Franklin Resources, Inc.	200.000	2,85 %	30.03.2025	198.126	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	200.000	1,90 %	12.08.2019	198.097	0,01 %
Walt Disney Co.	200.000	1,80 %	05.06.2020	198.080	0,01 %
Johnson & Johnson	200.000	1,13 %	01.03.2019	198.061	0,01 %
Reynolds American, Inc.	195.000	3,25 %	12.06.2020	198.029	0,01 %
Citizens Bank NA	200.000	2,65 %	26.05.2022	197.990	0,01 %
Nordstrom, Inc.	200.000	4,00 %	15.03.2027	197.950	0,01 %
Athene Global Funding	200.000	3,00 %	01.07.2022	197.886	0,01 %
Boardwalk Pipelines LP	200.000	3,38 %	01.02.2023	197.882	0,01 %
Branch Banking & Trust Co.	200.000	1,45 %	10.05.2019	197.869	0,01 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2016	200.000	1,58 %	15.09.2022	197.822	0,01 %
American Airlines 2015-1 Klasse A Pass Through Trust	197.697	3,38 %	01.05.2027	197.816	0,01 %
Cisco Systems, Inc.	200.000	1,40 %	20.09.2019	197.810	0,01 %
Costco Wholesale Corp.	200.000	1,75 %	15.02.2020	197.783	0,01 %
Duke Energy Corp.	200.000	3,75 %	01.09.2046	197.781	0,01 %
CSX Corp.	200.000	3,95 %	01.05.2050	197.713	0,01 %
Fortive Corp.	200.000	2,35 %	15.06.2021	197.677	0,01 %
GATX Corp.	200.000	3,25 %	30.03.2025	197.646	0,01 %
Union Pacific Corp.	200.000	2,75 %	01.03.2026	197.622	0,01 %
Principal Life Global Funding II	200.000	3,00 %	18.04.2026	197.612	0,01 %
NSTAR Electric Co.	200.000	2,38 %	15.10.2022	197.499	0,01 %
United Technologies Corp.	200.000	3,75 %	01.11.2046	197.429	0,01 %
New York City Water & Sewer System	150.000	5,44 %	15.06.2043	197.367	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Visa, Inc.	200.000	2,75 %	15.09.2027	197.233	0,01 %
ConocoPhillips	150.000	5,90 %	15.05.2038	197.085	0,01 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	200.000	3,40 %	15.11.2026	197.064	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	150.000	6,00 %	15.05.2037	197.054	0,01 %
Marathon Oil Corp.	200.000	2,80 %	01.11.2022	197.018	0,01 %
Mastercard, Inc.	200.000	2,00 %	21.11.2021	196.868	0,01 %
Cardinal Health, Inc.	200.000	2,62 %	15.06.2022	196.865	0,01 %
Arizona Public Service Co.	175.000	4,50 %	01.04.2042	196.858	0,01 %
Ares Capital Corp.	200.000	3,50 %	10.02.2023	196.851	0,01 %
Fidelity National Information Services, Inc.	200.000	2,25 %	15.08.2021	196.816	0,01 %
Public Service Electric & Gas Co.	200.000	1,90 %	15.03.2021	196.724	0,01 %
MetLife, Inc.	150.000	5,88 %	06.02.2041	196.645	0,01 %
Crown Castle International Corp.	200.000	2,25 %	01.09.2021	196.573	0,01 %
Enable Midstream Partners LP	200.000	5,00 %	15.05.2044	196.430	0,01 %
Total System Services, Inc.	192.000	3,80 %	01.04.2021	196.322	0,01 %
Aon Corp.	150.000	8,21 %	01.01.2027	196.312	0,01 %
TJX Cos, Inc.	200.000	2,50 %	15.05.2023	196.294	0,01 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	175.000	4,40 %	15.05.2042	196.263	0,01 %
Chase Issuance Trust	198.000	2,16 %	16.09.2024	195.933	0,01 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016	195.000	3,15 %	15.11.2049	195.784	0,01 %
Laboratory Corp. of America Holdings	180.000	4,70 %	01.02.2045	195.581	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp	200.000	2,53 %	25.05.2026	195.558	0,01 %
Buckeye Partners LP	200.000	3,95 %	01.12.2026	195.372	0,01 %
Republic Services, Inc.	150.000	6,20 %	01.03.2040	195.207	0,01 %
General Dynamics Corp.	200.000	2,38 %	15.11.2024	195.148	0,01 %
Wabtec Corp.	200.000	3,45 %	15.11.2026	195.142	0,01 %
State of California	175.000	5,70 %	01.11.2021	195.132	0,01 %
United Technologies Corp.	200.000	1,95 %	01.11.2021	195.042	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	200.000	2,80 %	04.05.2026	194.978	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	175.000	4,75 %	15.02.2044	194.898	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	200.000	3,60 %	01.11.2024	194.269	0,01 %
Cigna Corp.	200.000	3,05 %	15.10.2027	194.132	0,01 %
MetLife, Inc.	180.000	4,37 %	15.09.2023	194.084	0,01 %
Amgen, Inc.	200.000	2,25 %	19.08.2023	193.852	0,01 %
Reynolds American, Inc.	185.000	4,00 %	12.06.2022	193.306	0,01 %
General Dynamics Corp.	200.000	2,63 %	15.11.2027	193.215	0,01 %
Comcast Corp.	200.000	1,63 %	15.01.2022	193.140	0,01 %
Bank One Corp.	150.000	7,63 %	15.10.2026	193.086	0,01 %
Catholic Health Initiatives	200.000	4,35 %	01.11.2042	192.975	0,01 %
Altria Group, Inc.	185.000	4,25 %	09.08.2042	192.969	0,01 %
Target Corp.	150.000	6,35 %	01.11.2032	192.958	0,01 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates	190.000	3,12 %	25.06.2027	192.911	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	190.000	3,50 %	10.07.2019	192.805	0,01 %
Puget Sound Energy, Inc.	150.000	5,64 %	15.04.2041	192.787	0,01 %
Georgia-Pacific LLC	125.000	8,88 %	15.05.2031	192.643	0,01 %
Express Scripts Holding Co.	157.000	6,13 %	15.11.2041	192.404	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	175.000	4,00 %	11.04.2043	192.270	0,01 %
San Diego Gas & Electric Co.	200.000	2,50 %	15.05.2026	192.007	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	175.000	5,25 %	01.03.2026	191.953	0,01 %
CenterPoint Energy Resources Corp.	150.000	5,85 %	15.01.2041	191.905	0,01 %
Lincoln National Corp.	150.000	6,30 %	09.10.2037	191.696	0,01 %
Ecolab, Inc.	200.000	2,70 %	01.11.2026	191.695	0,01 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	205.000	2,88 %	15.02.2023	191.663	0,01 %
Lockheed Martin Corp.	150.000	5,72 %	01.06.2040	191.492	0,01 %
Endurance Specialty Holdings Ltd.	150.000	7,00 %	15.07.2034	191.487	0,01 %
ConocoPhillips Canada Funding Co. I	150.000	5,95 %	15.10.2036	191.465	0,01 %
Allstate Corp.	175.000	4,20 %	15.12.2046	191.345	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	175.000	4,85 %	15.08.2042	191.115	0,01 %
Citigroup, Inc.	150.000	6,63 %	15.06.2032	190.900	0,01 %
Southwest Airlines Co.	190.000	2,65 %	05.11.2020	190.830	0,01 %
EPR Properties	175.000	5,75 %	15.08.2022	190.828	0,01 %
Georgia-Pacific LLC	150.000	8,00 %	15.01.2024	190.780	0,01 %
American Airlines 2014-1 Klasse A Pass Through Trust	186.908	3,70 %	01.10.2026	190.428	0,01 %
Zoetis, Inc.	175.000	4,50 %	13.11.2025	190.385	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	175.000	4,20 %	15.01.2047	190.235	0,01 %
Aviation Capital Group LLC	175.000	4,88 %	01.10.2025	190.023	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue	150.000	5,57 %	01.11.2038	189.963	0,01 %
Smithfield Foods, Inc.	185.000	4,25 %	01.02.2027	189.842	0,01 %
Comcast Corp.	140.000	6,40 %	15.05.2038	189.752	0,01 %
CMS Energy Corp.	175.000	5,05 %	15.03.2022	189.731	0,01 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	175.000	6,20 %	15.10.2035	189.730	0,01 %
CenterPoint Energy Houston Electric LLC	200.000	2,40 %	01.09.2026	189.368	0,01 %
Los Angeles County Metropolitan Transportation Authority	150.000	5,74 %	01.06.2039	189.251	0,01 %
Abbott Laboratories	150.000	6,15 %	30.11.2037	189.103	0,01 %
Duke Energy Progress LLC	175.000	4,10 %	15.03.2043	188.990	0,01 %
Boston Properties LP	200.000	2,75 %	01.10.2026	188.859	0,01 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	175.000	4,88 %	11.07.2022	188.742	0,01 %
Markel Corp.	175.000	4,90 %	01.07.2022	188.466	0,01 %
University of Southern California	200.000	3,03 %	01.10.2039	188.416	0,01 %
Prudential Financial, Inc.	150.000	5,70 %	14.12.2036	188.401	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	175.000	4,38 %	15.11.2041	188.305	0,01 %
Duke Energy Carolinas LLC	150.000	5,30 %	15.02.2040	188.287	0,01 %
Expedia, Inc.	175.000	5,95 %	15.08.2020	188.263	0,01 %
McKesson Corp.	175.000	4,88 %	15.03.2044	188.235	0,01 %
Packaging Corp. of America	175.000	4,50 %	01.11.2023	188.209	0,01 %
Best Buy Co., Inc.	175.000	5,50 %	15.03.2021	188.125	0,01 %
Southern California Edison Co.	175.000	4,00 %	01.04.2047	188.125	0,01 %
Entergy Louisiana LLC	200.000	2,40 %	01.10.2026	188.103	0,01 %
International Paper Co.	150.000	6,00 %	15.11.2041	187.987	0,01 %
Kimco Realty Corp.	200.000	2,80 %	01.10.2026	187.874	0,01 %
Monongahela Power Co.	150.000	5,40 %	15.12.2043	187.830	0,01 %
Eli Lilly & Co.	175.000	3,95 %	15.05.2047	187.572	0,01 %
3M Co.	200.000	3,13 %	19.09.2046	187.403	0,01 %
Marathon Petroleum Corp.	175.000	5,13 %	01.03.2021	187.359	0,01 %
ERP Operating LP	175.000	4,63 %	15.12.2021	187.304	0,01 %
Home Depot, Inc.	200.000	2,13 %	15.09.2026	186.911	0,01 %
WR Berkley Corp.	175.000	5,38 %	15.09.2020	186.873	0,01 %
University of Texas System	175.000	6,28 %	15.08.2041	186.825	0,01 %
President & Fellows of Harvard College	150.000	4,88 %	15.10.2040	186.690	0,01 %
Duke Energy Carolinas LLC	175.000	4,00 %	30.09.2042	186.580	0,01 %
Fortive Corp.	175.000	4,30 %	15.06.2046	186.551	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	175.000	5,00 %	01.10.2021	186.440	0,01 %
Liberty Property LP	175.000	4,40 %	15.02.2024	186.432	0,01 %
General Electric Co.	187.000	2,20 %	09.01.2020	186.345	0,01 %
Time Warner, Inc.	175.000	4,75 %	29.03.2021	186.078	0,01 %
Columbia Pipeline Group, Inc.	150.000	5,80 %	01.06.2045	185.911	0,01 %
Ventas Realty LP/Ventas Capital Corp.	175.000	4,75 %	01.06.2021	185.762	0,01 %
Mastercard, Inc.	175.000	3,80 %	21.11.2046	185.701	0,01 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	150.000	5,25 %	30.09.2040	185.696	0,01 %
Applied Materials, Inc.	175.000	4,30 %	15.06.2021	185.678	0,01 %
National City Corp.	175.000	6,88 %	15.05.2019	185.647	0,01 %
Agilent Technologies, Inc.	175.000	5,00 %	15.07.2020	185.590	0,01 %
Bed Bath & Beyond, Inc.	210.000	5,17 %	01.08.2044	185.491	0,01 %
Jefferies Group LLC/Jefferies Group Capital Finance, Inc.	175.000	4,85 %	15.01.2027	185.305	0,01 %
Kentucky Utilities Co.	150.000	5,13 %	01.11.2040	185.026	0,01 %
Williams Partners LP	175.000	5,25 %	15.03.2020	184.928	0,01 %
McKesson Corp.	175.000	7,50 %	15.02.2019	184.863	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	150.000	4,75 %	02.10.2043	184.734	0,01 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	175.000	4,25 %	15.01.2021	184.707	0,01 %
CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust	180.000	3,46 %	15.11.2050	184.507	0,01 %
Nucor Corp.	175.000	4,13 %	15.09.2022	184.470	0,01 %
Keysight Technologies, Inc.	175.000	4,60 %	06.04.2027	184.372	0,01 %
International Lease Finance Corp.	153.000	8,63 %	15.01.2022	184.365	0,01 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	175.000	4,65 %	01.06.2046	184.282	0,01 %
Nuveen Finance LLC	175.000	4,13 %	01.11.2024	184.144	0,01 %
Weyerhaeuser Co.	175.000	4,70 %	15.03.2021	184.144	0,01 %
JM Smucker Co.	175.000	4,25 %	15.03.2035	184.104	0,01 %
Home Depot, Inc.	175.000	3,90 %	15.06.2047	184.049	0,01 %
Voya Financial, Inc.	150.000	5,70 %	15.07.2043	183.868	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	175.000	4,38 %	06.08.2023	183.780	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	150.000	7,40 %	15.03.2031	183.738	0,01 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	175.000	4,45 %	15.06.2020	183.574	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Enterprise Products Operating LLC	175.000	4,05 %	15.02.2022	183.482	0,01 %
International Lease Finance Corp.	176.000	5,88 %	01.04.2019	183.323	0,01 %
LC4 Commercial Mortgage Trust 2012	180.000	3,29 %	10.12.2044	183.260	0,01 %
GS Mortgage Securities Trust 2012	178.327	3,48 %	10.01.2045	183.152	0,01 %
Ventas Realty LP	150.000	5,70 %	30.09.2043	182.924	0,01 %
El du Pont de Nemours & Co.	175.000	4,63 %	15.01.2020	182.898	0,01 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014	175.000	3,75 %	15.09.2057	182.833	0,01 %
NIKE, Inc.	175.000	3,88 %	01.11.2045	182.677	0,01 %
Dominion Energy, Inc.	175.000	3,90 %	01.10.2025	182.550	0,01 %
PacifiCorp	175.000	3,85 %	15.06.2021	182.497	0,01 %
CSX Corp.	175.000	4,10 %	15.03.2044	182.077	0,01 %
Citigroup, Inc.	175.000	4,00 %	05.08.2024	182.045	0,01 %
PepsiCo, Inc.	175.000	3,50 %	17.07.2025	181.889	0,01 %
Sysco Corp.	175.000	3,75 %	01.10.2025	181.861	0,01 %
Avnet, Inc.	175.000	4,63 %	15.04.2026	181.706	0,01 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	175.000	3,68 %	15.12.2050	181.699	0,01 %
Mastercard, Inc.	175.000	3,38 %	01.04.2024	181.594	0,01 %
San Diego Gas & Electric Co.	175.000	3,60 %	01.09.2023	181.583	0,01 %
Federal National Mortgage Association^	175.000	3,35 %	25.03.2024	181.279	0,01 %
Omega Healthcare Investors, Inc.	175.000	5,25 %	15.01.2026	180.906	0,01 %
International Business Machines Corp.	175.000	3,45 %	19.02.2026	180.837	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	175.000	3,58 %	15.10.2050	180.586	0,01 %
BlackRock, Inc.	175.000	3,38 %	01.06.2022	180.581	0,01 %
Moody's Corp.	150.000	5,25 %	15.07.2044	180.379	0,01 %
PepsiCo, Inc.	150.000	4,88 %	01.11.2040	180.279	0,01 %
Bank 2018-BNK [§]	175.000	3,54 %	15.11.2054	180.267	0,01 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014	175.000	3,49 %	15.01.2048	180.238	0,01 %
Fiserv, Inc.	175.000	3,50 %	01.10.2022	180.129	0,01 %
National Retail Properties, Inc.	175.000	3,80 %	15.10.2022	180.128	0,01 %
CBRE Services, Inc.	175.000	5,00 %	15.03.2023	180.111	0,01 %
FMC Corp.	175.000	3,95 %	01.02.2022	180.080	0,01 %
JM Smucker Co.	175.000	3,50 %	15.10.2021	179.968	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015	175.000	3,54 %	15.05.2048	179.643	0,01 %
Bank 2018-BNK [§]	175.000	3,49 %	15.11.2050	179.531	0,01 %
Kroger Co.	175.000	4,65 %	15.01.2048	179.460	0,01 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	175.000	3,56 %	15.10.2050	179.452	0,01 %
Northwell Healthcare, Inc.	175.000	4,26 %	01.11.2047	179.366	0,01 %
ITC Holdings Corp.	175.000	3,65 %	15.06.2024	179.303	0,01 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017	175.000	3,47 %	12.10.2050	179.191	0,01 %
Liberty Property LP	175.000	3,75 %	01.04.2025	179.073	0,01 %
Federal National Mortgage Association	173.806	3,76 %	25.04.2021	179.069	0,01 %
McDonald's Corp.	175.000	3,38 %	26.05.2025	179.035	0,01 %
Union Pacific Railroad Co. 2007-3 Pass Through Trust	154.668	6,18 %	02.01.2031	179.032	0,01 %
Mosaic Co.	175.000	3,75 %	15.11.2021	179.016	0,01 %
AT&T, Inc.	175.000	3,80 %	01.03.2024	179.008	0,01 %
DTE Energy Co.	175.000	3,50 %	01.06.2024	178.890	0,01 %
Medtronic, Inc.	175.000	3,13 %	15.03.2022	178.793	0,01 %
Time Warner, Inc.	175.000	3,40 %	15.06.2022	178.445	0,01 %
American Tower Corp.	175.000	3,45 %	15.09.2021	178.443	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	175.000	3,06 %	25.12.2024	178.355	0,01 %
Allergan, Inc.	175.000	3,38 %	15.09.2020	178.331	0,01 %
Ameren Illinois Co.	175.000	3,25 %	01.03.2025	178.312	0,01 %
Alabama Power Co.	175.000	3,75 %	01.03.2045	178.183	0,01 %
Motorola Solutions, Inc.	175.000	3,50 %	01.09.2021	177.979	0,01 %
American International Group, Inc.	175.000	3,30 %	01.03.2021	177.951	0,01 %
Covidien International Finance SA	175.000	3,20 %	15.06.2022	177.949	0,01 %
Allstate Corp.	175.000	3,15 %	15.06.2023	177.767	0,01 %
Cargill, Inc.	150.000	4,76 %	23.11.2045	177.692	0,01 %
Mead Johnson Nutrition Co.	175.000	3,00 %	15.11.2020	177.602	0,01 %
Chase Issuance Trust	175.000	2,77 %	15.03.2023	177.461	0,01 %
Morgan Stanley	175.000	3,95 %	23.04.2027	177.247	0,01 %
Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.	175.000	4,00 %	17.01.2043	177.113	0,01 %
CBS Corp.	175.000	4,60 %	15.01.2045	177.081	0,01 %
Quest Diagnostics, Inc.	175.000	3,50 %	30.03.2025	177.069	0,01 %
Exelon Corp.	150.000	5,10 %	15.06.2045	176.955	0,01 %
Cox Communications, Inc.	175.000	4,60 %	15.08.2047	176.886	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Carlisle Cos, Inc.	175.000	3,75 %	01.12.2027	176.808	0,01 %
Chubb Corp.	125.000	6,50 %	15.05.2038	176.702	0,01 %
Intercontinental Exchange, Inc.	175.000	2,75 %	01.12.2020	176.671	0,01 %
Bank 2018-BNK ^a	175.000	3,28 %	15.11.2054	176.487	0,01 %
Parker-Hannifin Corp.	175.000	3,25 %	01.03.2027	176.456	0,01 %
Seagate HDD Cayman	175.000	4,25 %	01.03.2022	176.313	0,01 %
Caterpillar, Inc.	150.000	4,75 %	15.05.2064	176.025	0,01 %
Government Properties Income Trust	175.000	4,00 %	15.07.2022	175.974	0,01 %
Baxalta, Inc.	175.000	2,88 %	23.06.2020	175.940	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	175.000	3,45 %	15.02.2023	175.774	0,01 %
Analog Devices, Inc.	175.000	3,13 %	05.12.2023	175.754	0,01 %
Lowe's Cos, Inc.	175.000	3,70 %	15.04.2046	175.506	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	140.000	5,00 %	25.10.2040	175.503	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	175.000	2,30 %	15.12.2019	175.488	0,01 %
JPMorgan Chase & Co.	175.000	2,35 %	28.01.2019	175.397	0,01 %
General Electric Co.	175.000	2,30 %	14.01.2019	175.331	0,01 %
Quest Diagnostics, Inc.	175.000	3,45 %	01.06.2026	175.321	0,01 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	175.000	2,40 %	01.02.2020	175.320	0,01 %
American Transmission Systems, Inc.	150.000	5,00 %	01.09.2044	175.176	0,01 %
JM Smucker Co.	175.000	3,38 %	15.12.2027	175.151	0,01 %
Massachusetts Institute of Technology	150.000	4,68 %	01.07.2114	175.133	0,01 %
Simon Property Group LP	175.000	3,30 %	15.01.2026	175.067	0,01 %
Kroger Co.	175.000	4,45 %	01.02.2047	174.904	0,01 %
Brixmor Operating Partnership LP	175.000	3,85 %	01.02.2025	174.841	0,01 %
Amgen, Inc.	175.000	2,70 %	01.05.2022	174.821	0,01 %
State Street Corp. ^a	175.000	2,65 %	15.05.2023	174.716	0,01 %
Crown Castle International Corp.	175.000	3,70 %	15.06.2026	174.690	0,01 %
Sysco Corp.	175.000	3,25 %	15.07.2027	174.650	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	175.000	1,88 %	15.01.2019	174.612	0,01 %
CenterPoint Energy Houston Electric LLC	150.000	4,50 %	01.04.2044	174.369	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	175.000	2,95 %	15.10.2027	174.341	0,01 %
Johnson & Johnson	175.000	1,95 %	10.11.2020	174.280	0,01 %
PNC Bank NA	175.000	2,70 %	01.11.2022	174.116	0,01 %
RPM International, Inc.	175.000	4,25 %	15.01.2048	173.998	0,01 %
Southern Co.	175.000	2,95 %	01.07.2023	173.992	0,01 %
Intel Corp.	175.000	2,35 %	11.05.2022	173.959	0,01 %
American Tower Corp.	175.000	3,60 %	15.01.2028	173.932	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	175.000	1,63 %	21.02.2019	173.931	0,01 %
Discover Card Execution Note Trust	175.000	1,90 %	17.10.2022	173.906	0,01 %
Norfolk Southern Corp.	150.000	4,84 %	01.10.2041	173.840	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	175.000	2,05 %	01.04.2021	173.831	0,01 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	175.000	3,15 %	01.04.2022	173.588	0,01 %
Kimco Realty Corp.	175.000	3,30 %	01.02.2025	173.530	0,01 %
Duke Energy Corp.	175.000	3,15 %	15.08.2027	173.497	0,01 %
AT&T Corp.	125.000	8,25 %	15.11.2031	173.361	0,01 %
Barclays Dryrock Issuance Trust	175.000	1,52 %	16.05.2022	173.329	0,01 %
BB&T Corp.	175.000	2,15 %	01.02.2021	173.202	0,01 %
PepsiCo, Inc.	175.000	2,25 %	02.05.2022	173.108	0,01 %
Fifth Third Bank	175.000	1,63 %	27.09.2019	173.021	0,01 %
University of California	155.000	4,86 %	15.05.2112	173.017	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	175.000	2,50 %	02.11.2022	172.994	0,01 %
United Technologies Corp.	175.000	1,50 %	01.11.2019	172.930	0,01 %
Activision Blizzard, Inc.	175.000	2,30 %	15.09.2021	172.884	0,01 %
Federal National Mortgage Association	175.000	2,59 %	25.12.2024	172.786	0,01 %
American Tower Corp.	175.000	3,55 %	15.07.2027	172.705	0,01 %
Crown Castle International Corp.	175.000	3,20 %	01.09.2024	172.671	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	175.000	2,50 %	01.09.2023	172.494	0,01 %
Dallas Area Rapid Transit	125.000	6,00 %	01.12.2044	172.480	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	175.000	2,38 %	17.08.2022	172.357	0,01 %
IBM Credit LLC	175.000	1,80 %	20.01.2021	172.212	0,01 %
New Jersey Transportation Trust Fund Authority	150.000	5,75 %	15.12.2028	172.205	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	100.000	8,88 %	15.11.2038	172.161	0,01 %
Corning, Inc.	175.000	4,38 %	15.11.2057	172.123	0,01 %
Humana, Inc.	150.000	4,95 %	01.10.2044	172.099	0,01 %
Verizon Communications, Inc.	175.000	2,45 %	01.11.2022	172.057	0,01 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	150.000	4,63 %	01.12.2054	172.027	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
CenterPoint Energy, Inc.	175.000	2,50 %	01.09.2022	172.004	0,01 %
Transatlantic Holdings, Inc.	125.000	8,00 %	30.11.2039	171.598	0,01 %
Berkshire Hathaway, Inc.	150.000	4,50 %	11.02.2043	171.289	0,01 %
Wells Fargo Capital X	150.000	5,95 %	15.12.2036	171.188	0,01 %
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	175.000	2,20 %	15.01.2021	171.181	0,01 %
AXIS Specialty Finance LLC	160.000	5,88 %	01.06.2020	171.046	0,01 %
John Deere Capital Corp.	175.000	2,15 %	08.09.2022	170.983	0,01 %
McDonald's Corp.	175.000	3,70 %	15.02.2042	170.794	0,01 %
CBS Corp.	125.000	7,88 %	30.07.2030	170.783	0,01 %
Cleco Corporate Holdings LLC	170.000	3,74 %	01.05.2026	170.702	0,01 %
Norfolk Southern Corp.	150.000	4,65 %	15.01.2046	170.655	0,01 %
Prudential Financial, Inc.	150.000	4,60 %	15.05.2044	170.595	0,01 %
Southern Power Co.	150.000	5,25 %	15.07.2043	170.595	0,01 %
American Financial Group, Inc.	165.000	4,50 %	15.06.2047	170.389	0,01 %
McDonald's Corp.	150.000	4,70 %	09.12.2035	170.298	0,01 %
KeySpan Gas East Corp.	175.000	2,74 %	15.08.2026	169.846	0,01 %
Continental Airlines 2009-2 Klasse A Pass Through Trust	157.524	7,25 %	10.11.2019	169.795	0,01 %
Entergy Corp.	175.000	2,95 %	01.09.2026	169.585	0,01 %
Union Pacific Corp.	175.000	3,35 %	15.08.2046	169.559	0,01 %
Enbridge Energy Partners LP	150.000	5,88 %	15.10.2025	169.557	0,01 %
Santander Holdings USA, Inc.	170.000	3,40 %	18.01.2023	169.333	0,01 %
FedEx Corp.	150.000	4,90 %	15.01.2034	169.225	0,01 %
Dominion Energy, Inc.	171.000	2,75 %	15.09.2022	169.174	0,01 %
ConocoPhillips Co.	125.000	5,95 %	15.03.2046	168.594	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	150.000	4,40 %	15.03.2042	168.146	0,01 %
Nationwide Financial Services, Inc.	150.000	6,75 %	15.05.2037	168.000	0,01 %
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012	167.243	2,83 %	15.10.2045	167.917	0,01 %
Estee Lauder Cos, Inc.	150.000	4,38 %	15.06.2045	167.810	0,01 %
Southern Power Co.	150.000	5,15 %	15.09.2041	167.777	0,01 %
Medtronic, Inc.	150.000	4,50 %	15.03.2042	167.688	0,01 %
Nordstrom, Inc.	175.000	5,00 %	15.01.2044	167.552	0,01 %
Duke Energy Carolinas LLC	125.000	6,00 %	15.01.2038	167.476	0,01 %
Caterpillar, Inc.	125.000	6,05 %	15.08.2036	167.429	0,01 %
Boston Gas Co.	150.000	4,49 %	15.02.2042	167.345	0,01 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	150.000	4,30 %	15.05.2043	167.277	0,01 %
Seagate HDD Cayman	175.000	4,88 %	01.06.2027	167.125	0,01 %
CSX Corp.	175.000	2,60 %	01.11.2026	167.049	0,01 %
Covidien International Finance SA	160.000	4,20 %	15.06.2020	167.026	0,01 %
Archer-Daniels-Midland Co.	150.000	4,54 %	26.03.2042	167.002	0,01 %
Progressive Corp.	150.000	4,35 %	25.04.2044	166.754	0,01 %
Norfolk Southern Corp.	150.000	4,45 %	15.06.2045	166.711	0,01 %
Chubb Corp.	125.000	6,00 %	11.05.2037	166.696	0,01 %
State of Illinois	150.000	6,63 %	01.02.2035	166.458	0,01 %
Cox Communications, Inc.	175.000	4,50 %	30.06.2043	166.260	0,01 %
Time Warner, Inc.	150.000	5,35 %	15.12.2043	166.132	0,01 %
Hess Corp.	150.000	5,80 %	01.04.2047	166.020	0,01 %
Appalachian Power Co.	165.000	3,30 %	01.06.2027	165.868	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	175.000	2,45 %	17.08.2026	165.754	0,01 %
Ford Motor Credit Co. LLC	150.000	8,13 %	15.01.2020	165.713	0,01 %
Duke Energy Carolinas LLC	150.000	4,25 %	15.12.2041	165.462	0,01 %
Hartford Financial Services Group, Inc.	125.000	6,10 %	01.10.2041	165.379	0,01 %
Puget Energy, Inc.	150.000	5,63 %	15.07.2022	165.340	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	150.000	4,38 %	15.03.2042	165.299	0,01 %
Lockheed Martin Corp.	125.000	6,15 %	01.09.2036	165.124	0,01 %
Travelers Property Casualty Corp.	125.000	6,38 %	15.03.2033	164.924	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	150.000	4,85 %	15.03.2044	164.553	0,01 %
PSEG Power LLC	125.000	8,63 %	15.04.2031	164.338	0,01 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	175.000	4,95 %	15.01.2043	164.182	0,01 %
CBS Corp.	175.000	2,90 %	15.01.2027	163.889	0,01 %
Florida Power & Light Co.	150.000	4,05 %	01.06.2042	163.624	0,01 %
Unum Group	160.000	3,88 %	05.11.2025	163.586	0,01 %
Lowe's Cos, Inc.	150.000	4,25 %	15.09.2044	163.558	0,01 %
Tyson Foods, Inc.	150.000	4,55 %	02.06.2047	163.535	0,01 %
First Niagara Financial Group, Inc.	150.000	6,75 %	19.03.2020	163.457	0,01 %
Verisk Analytics, Inc.	150.000	5,80 %	01.05.2021	163.376	0,01 %
Constellation Brands, Inc.	150.000	4,50 %	09.05.2047	163.324	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
MetLife, Inc.	125.000	6,50 %	15.12.2032	163.314	0,01 %
Williams Partners LP	150.000	5,10 %	15.09.2045	163.313	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	125.000	6,00 %	15.01.2036	163.096	0,01 %
Commonwealth of Massachusetts Transportation Fund Revenue	125.000	5,73 %	01.06.2040	163.023	0,01 %
Exelon Corp.	150.000	4,45 %	15.04.2046	162.867	0,01 %
Tri-State Generation & Transmission Association, Inc.	125.000	6,00 %	15.06.2040	162.828	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	125.000	6,88 %	01.03.2033	162.817	0,01 %
Johnson Controls International plc	150.000	4,50 %	15.02.2047	162.739	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	150.000	5,80 %	01.03.2021	162.595	0,01 %
NorthWestern Corp.	150.000	4,18 %	15.11.2044	162.521	0,01 %
Parker-Hannifin Corp.	150.000	4,20 %	21.11.2034	162.422	0,01 %
Bunge Ltd. Finance Corp.	150.000	8,50 %	15.06.2019	162.391	0,01 %
Sysco Corp.	150.000	4,50 %	01.04.2046	162.249	0,01 %
Enbridge Energy Partners LP	125.000	7,50 %	15.04.2038	161.993	0,01 %
Atmos Energy Corp.	150.000	4,15 %	15.01.2043	161.884	0,01 %
Progressive Corp.	125.000	6,25 %	01.12.2032	161.871	0,01 %
Dr Pepper Snapple Group, Inc.	160.000	3,13 %	15.12.2023	161.693	0,01 %
Puget Energy, Inc.	146.000	6,00 %	01.09.2021	161.635	0,01 %
International Business Machines Corp.	125.000	5,88 %	29.11.2032	161.544	0,01 %
Owens Corning	123.000	7,00 %	01.12.2036	161.438	0,01 %
Westar Energy, Inc.	150.000	4,13 %	01.03.2042	161.274	0,01 %
Discover Financial Services	150.000	5,20 %	27.04.2022	161.233	0,01 %
Aetna, Inc.	155.000	4,13 %	01.06.2021	161.097	0,01 %
Kroger Co.	175.000	3,88 %	15.10.2046	161.063	0,01 %
County of Clark Department of Aviation	150.000	6,88 %	01.07.2042	161.002	0,01 %
Block Financial LLC	150.000	5,50 %	01.11.2022	160.974	0,01 %
Prologis LP	150.000	4,25 %	15.08.2023	160.948	0,01 %
Colgate-Palmolive Co.	150.000	4,00 %	15.08.2045	160.885	0,01 %
Dr Pepper Snapple Group, Inc.	150.000	4,50 %	15.11.2045	160.848	0,01 %
MidAmerican Energy Co.	125.000	5,80 %	15.10.2036	160.831	0,01 %
Vornado Realty LP	150.000	5,00 %	15.01.2022	160.757	0,01 %
Southern California Edison Co.	125.000	6,00 %	15.01.2034	160.702	0,01 %
Ameriprise Financial, Inc.	150.000	7,30 %	28.06.2019	160.683	0,01 %
Leucadia National Corp.	150.000	5,50 %	18.10.2023	160.682	0,01 %
Legg Mason, Inc.	150.000	4,75 %	15.03.2026	160.667	0,01 %
Waste Management, Inc.	150.000	4,10 %	01.03.2045	160.654	0,01 %
Board of Trustees of The Leland Stanford Junior University	150.000	3,65 %	01.05.2048	160.409	0,01 %
Noble Energy, Inc.	150.000	5,05 %	15.11.2044	160.264	0,01 %
Life Technologies Corp.	150.000	6,00 %	01.03.2020	160.190	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	165.000	3,40 %	15.11.2046	160.164	0,01 %
Sherwin-Williams Co.	150.000	7,25 %	15.06.2019	160.142	0,01 %
EQT Corp.	150.000	4,88 %	15.11.2021	160.051	0,01 %
Home Depot, Inc.	125.000	5,40 %	15.09.2040	160.011	0,01 %
Hospitality Properties Trust	150.000	5,00 %	15.08.2022	160.006	0,01 %
United Technologies Corp.	125.000	6,70 %	01.08.2028	159.920	0,01 %
Blackstone Holdings Finance Co. LLC	150.000	4,45 %	15.07.2045	159.818	0,01 %
NiSource Finance Corp.	125.000	5,95 %	15.06.2041	159.762	0,01 %
Fidelity National Information Services, Inc.	156.000	3,50 %	15.04.2023	159.361	0,01 %
United Technologies Corp.	150.000	4,15 %	15.05.2045	159.308	0,01 %
Port Authority of New York & New Jersey	125.000	6,04 %	01.12.2029	159.251	0,01 %
Masco Corp.	150.000	4,45 %	01.04.2025	159.211	0,01 %
Cimarex Energy Co.	150.000	4,38 %	01.06.2024	159.206	0,01 %
PNC Financial Services Group, Inc.	150.000	6,70 %	10.06.2019	159.194	0,01 %
ConocoPhillips Co.	150.000	4,15 %	15.11.2034	159.121	0,01 %
Kellogg Co.	150.000	4,50 %	01.04.2046	159.097	0,01 %
Ameriprise Financial, Inc.	150.000	5,30 %	15.03.2020	159.033	0,01 %
Children's Hospital Corp.	150.000	4,12 %	01.01.2047	158.976	0,01 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	125.000	5,50 %	01.12.2039	158.928	0,01 %
Noble Energy, Inc.	150.000	4,95 %	15.08.2047	158.846	0,01 %
Seagate HDD Cayman	165.000	5,75 %	01.12.2034	158.786	0,01 %
International Flavors & Fragrances, Inc.	150.000	4,38 %	01.06.2047	158.764	0,01 %
O'Reilly Automotive, Inc.	150.000	4,88 %	14.01.2021	158.737	0,01 %
Delphi Corp.	150.000	4,15 %	15.03.2024	158.691	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	150.000	3,75 %	01.04.2024	158.685	0,01 %
Nasdaq, Inc.	150.000	5,55 %	15.01.2020	158.680	0,01 %
Monongahela Power Co.	150.000	4,10 %	15.04.2024	158.547	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	150.000	4,02 %	01.11.2032	158.395	0,01 %
BlackRock, Inc.	150.000	4,25 %	24.05.2021	158.308	0,01 %
Atmos Energy Corp.	125.000	5,50 %	15.06.2041	158.154	0,01 %
Simon Property Group LP	150.000	4,13 %	01.12.2021	158.139	0,01 %
Chubb INA Holdings, Inc.	150.000	5,90 %	15.06.2019	158.090	0,01 %
PSEG Power LLC	150.000	5,13 %	15.04.2020	158.068	0,01 %
Eastman Chemical Co.	152.000	3,80 %	15.03.2025	157.972	0,01 %
Bay Area Toll Authority	100.000	6,91 %	01.10.2050	157.944	0,01 %
Cummins, Inc.	150.000	3,65 %	01.10.2023	157.901	0,01 %
Avnet, Inc.	150.000	4,88 %	01.12.2022	157.881	0,01 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	150.000	3,95 %	01.03.2043	157.773	0,01 %
Xerox Corp.	150.000	5,63 %	15.12.2019	157.771	0,01 %
S&P Global, Inc.	150.000	4,00 %	15.06.2025	157.749	0,01 %
Comcast Corp.	150.000	5,70 %	01.07.2019	157.738	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015	150.000	3,84 %	15.09.2058	157.683	0,01 %
Liberty Mutual Group, Inc.	150.000	4,25 %	15.06.2023	157.628	0,01 %
Southern Co.	150.000	4,25 %	01.07.2036	157.606	0,01 %
Whirlpool Corp.	150.000	4,50 %	01.06.2046	157.523	0,01 %
HCP, Inc.	150.000	4,25 %	15.11.2023	157.419	0,01 %
CSX Corp.	150.000	4,50 %	01.08.2054	157.406	0,01 %
Norfolk Southern Corp.	150.000	5,90 %	15.06.2019	157.385	0,01 %
CubeSmart LP	150.000	4,38 %	15.12.2023	157.365	0,01 %
Praxair, Inc.	150.000	4,05 %	15.03.2021	157.364	0,01 %
PNC Financial Services Group, Inc.	150.000	4,38 %	11.08.2020	157.363	0,01 %
UBS5 Commercial Mortgage Trust 2014	150.000	3,84 %	10.09.2047	157.296	0,01 %
AutoNation, Inc.	150.000	4,50 %	01.10.2025	157.242	0,01 %
Buckeye Partners LP	150.000	4,88 %	01.02.2021	157.228	0,01 %
Prologis LP	150.000	3,75 %	01.11.2025	157.211	0,01 %
CCRE25 Commercial Mortgage Trust 2015	150.000	3,76 %	10.08.2048	157.117	0,01 %
United Technologies Corp.	150.000	4,05 %	04.05.2047	157.034	0,01 %
Mead Johnson Nutrition Co.	150.000	4,90 %	01.11.2019	156.984	0,01 %
TJX Cos, Inc.	155.000	2,75 %	15.06.2021	156.864	0,01 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	150.000	3,75 %	14.03.2026	156.845	0,01 %
Abbott Laboratories	125.000	6,00 %	01.04.2039	156.739	0,01 %
Sempra Energy	150.000	4,05 %	01.12.2023	156.693	0,01 %
NiSource Finance Corp.	125.000	5,65 %	01.02.2045	156.654	0,01 %
Anthem, Inc.	150.000	4,35 %	15.08.2020	156.599	0,01 %
Quest Diagnostics, Inc.	150.000	4,75 %	30.01.2020	156.598	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	100.000	7,75 %	01.12.2045	156.585	0,01 %
State of Illinois	150.000	4,95 %	01.06.2023	156.531	0,01 %
Citizens Financial Group, Inc.	150.000	4,30 %	03.12.2025	156.440	0,01 %
CF Industries, Inc.	150.000	4,50 %	01.12.2026	156.435	0,01 %
Fortune Brands Home & Security, Inc.	150.000	4,00 %	15.06.2025	156.435	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	150.000	4,25 %	15.05.2023	156.410	0,01 %
Entergy Louisiana LLC	150.000	4,95 %	15.01.2045	156.375	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	150.000	3,70 %	15.09.2024	156.284	0,01 %
Duke University Health System, Inc.	150.000	3,92 %	01.06.2047	156.268	0,01 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	150.000	3,85 %	15.06.2046	155.992	0,01 %
County of Clark Department of Aviation	100.000	6,82 %	01.07.2045	155.990	0,01 %
Hanover Insurance Group, Inc.	150.000	4,50 %	15.04.2026	155.939	0,01 %
Enbridge Energy Partners LP	150.000	4,20 %	15.09.2021	155.908	0,01 %
Eaton Corp.	150.000	4,00 %	02.11.2032	155.888	0,01 %
Pfizer, Inc.	150.000	3,40 %	15.05.2024	155.883	0,01 %
CRH America, Inc.	150.000	3,88 %	18.05.2025	155.756	0,01 %
Prudential Financial, Inc.	150.000	3,50 %	15.05.2024	155.725	0,01 %
Kinder Morgan, Inc.	150.000	5,05 %	15.02.2046	155.657	0,01 %
Commonwealth Edison Co.	150.000	3,75 %	15.08.2047	155.641	0,01 %
CNH Industrial Capital LLC	150.000	4,38 %	06.11.2020	155.625	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	150.000	3,75 %	15.02.2024	155.607	0,01 %
CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust	150.000	3,72 %	15.08.2048	155.589	0,01 %
Humana, Inc.	150.000	3,85 %	01.10.2024	155.586	0,01 %
Lowe's Cos, Inc.	150.000	3,75 %	15.04.2021	155.560	0,01 %
San Diego County Water Authority Financing Corp.	110.000	6,14 %	01.05.2049	155.398	0,01 %
Eli Lilly & Co.	150.000	3,70 %	01.03.2045	155.393	0,01 %
CA, Inc.	150.000	4,70 %	15.03.2027	155.382	0,01 %
Los Angeles County Public Works Financing Authority	100.000	7,62 %	01.08.2040	155.338	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Mosaic Co.	150.000	4,25 %	15.11.2023	155.313	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	150.000	4,15 %	01.03.2022	155.300	0,01 %
Berkshire Hathaway, Inc.	150.000	3,40 %	31.01.2022	155.159	0,01 %
Mohawk Industries, Inc.	150.000	3,85 %	01.02.2023	155.047	0,01 %
CSX Corp.	150.000	3,70 %	01.11.2023	155.046	0,01 %
Prudential Financial, Inc.	125.000	5,75 %	15.07.2033	155.014	0,01 %
Kellogg Co.	150.000	4,15 %	15.11.2019	154.919	0,01 %
Duke Energy Progress LLC	150.000	5,30 %	15.01.2019	154.844	0,01 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	150.000	3,50 %	03.06.2024	154.696	0,01 %
Regency Centers LP	150.000	4,40 %	01.02.2047	154.653	0,01 %
Duke Energy Carolinas LLC	150.000	3,75 %	01.06.2045	154.592	0,01 %
Time Warner Cable LLC	150.000	4,13 %	15.02.2021	154.571	0,01 %
Cboe Global Markets Inc.	150.000	3,65 %	12.01.2027	154.502	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	150.000	4,10 %	15.08.2047	154.334	0,01 %
Kohl's Corp.	150.000	4,00 %	01.11.2021	154.260	0,01 %
Federal National Mortgage Association^	156.075	2,61 %	25.03.2022	154.232	0,01 %
Allstate Corp.	125.000	5,55 %	09.05.2035	154.168	0,01 %
Duke Energy Indiana LLC	150.000	3,75 %	15.05.2046	154.142	0,01 %
Noble Energy, Inc.	150.000	3,90 %	15.11.2024	154.142	0,01 %
Chubb INA Holdings, Inc.	150.000	3,35 %	15.05.2024	154.032	0,01 %
Ameren Illinois Co.	150.000	3,70 %	01.12.2047	154.016	0,01 %
Bristol-Myers Squibb Co.	150.000	3,25 %	27.02.2027	154.013	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	150.000	3,15 %	25.11.2025	153.877	0,01 %
3M Co.	150.000	3,63 %	15.10.2047	153.862	0,01 %
Williams Partners LP	150.000	4,00 %	15.09.2025	153.851	0,01 %
Illinois Tool Works, Inc.	150.000	3,38 %	15.09.2021	153.780	0,01 %
Cardinal Health, Inc.	150.000	4,60 %	15.03.2043	153.753	0,01 %
Norfolk Southern Corp.	150.000	3,95 %	01.10.2042	153.746	0,01 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates	150.000	3,24 %	25.08.2027	153.720	0,01 %
Massachusetts Mutual Life Insurance Co.	125.000	5,38 %	01.12.2041	153.649	0,01 %
Synchrony Financial	150.000	3,75 %	15.08.2021	153.601	0,01 %
Stryker Corp.	150.000	3,38 %	01.11.2025	153.531	0,01 %
Csail 2015-C2 Commercial Mortgage Trust	150.000	3,50 %	15.06.2057	153.523	0,01 %
Simon Property Group LP	150.000	3,50 %	01.09.2025	153.499	0,01 %
Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue	100.000	7,46 %	01.10.2046	153.429	0,01 %
Microsoft Corp.	150.000	3,00 %	01.10.2020	153.422	0,01 %
Carlyle Holdings Finance LLC	150.000	3,88 %	01.02.2023	153.331	0,01 %
FedEx Corp.	150.000	4,10 %	15.04.2043	153.250	0,01 %
Tapestry Inc.	150.000	4,25 %	01.04.2025	153.236	0,01 %
Johnson & Johnson	125.000	4,95 %	15.05.2033	153.203	0,01 %
Crown Castle International Corp.	150.000	4,00 %	01.03.2027	153.177	0,01 %
RPM International, Inc.	150.000	3,45 %	15.11.2022	153.068	0,01 %
Dominion Energy Gas Holdings LLC	140.000	4,60 %	15.12.2044	152.951	0,01 %
CBS Corp.	150.000	4,00 %	15.01.2026	152.950	0,01 %
First Horizon National Corp.	150.000	3,50 %	15.12.2020	152.922	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	150.000	3,75 %	15.10.2047	152.877	0,01 %
American International Group, Inc.	150.000	4,38 %	15.01.2055	152.808	0,01 %
Principal Financial Group, Inc.	150.000	3,30 %	15.09.2022	152.716	0,01 %
Magellan Midstream Partners LP	150.000	4,25 %	15.09.2046	152.667	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	150.000	3,25 %	11.09.2024	152.641	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	150.000	3,05 %	15.03.2022	152.638	0,01 %
Federal National Mortgage Association^	150.000	3,02 %	25.08.2024	152.554	0,01 %
Total System Services, Inc.	150.000	3,75 %	01.06.2023	152.537	0,01 %
Commonwealth Edison Co.	150.000	3,70 %	01.03.2045	152.482	0,01 %
Citrix Systems, Inc.	150.000	4,50 %	01.12.2027	152.437	0,01 %
KeyBank NA	150.000	3,30 %	01.06.2025	152.324	0,01 %
Celgene Corp.	150.000	3,25 %	15.08.2022	152.220	0,01 %
AutoZone, Inc.	150.000	3,75 %	01.06.2027	152.205	0,01 %
Target Corp.	150.000	2,90 %	15.01.2022	152.203	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	150.000	3,50 %	15.06.2025	152.120	0,01 %
DR Horton, Inc.	150.000	3,75 %	01.03.2019	152.089	0,01 %
Scripps Networks Interactive, Inc.	150.000	3,95 %	15.06.2025	151.986	0,01 %
Aflac, Inc.	150.000	3,25 %	17.03.2025	151.977	0,01 %
Aetna, Inc. ¹	150.000	3,50 %	15.11.2024	151.969	0,01 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	150.000	3,30 %	15.10.2050	151.959	0,01 %
Intel Corp.	155.000	1,70 %	19.05.2021	151.821	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
NSTAR Electric Co.	150.000	3,20 %	15.05.2027	151.763	0,01 %
Roper Technologies, Inc.	150.000	3,00 %	15.12.2020	151.739	0,01 %
Northwestern University	125.000	4,64 %	01.12.2044	151.666	0,01 %
Norfolk Southern Corp.	150.000	3,00 %	01.04.2022	151.641	0,01 %
University of California	150.000	3,06 %	01.07.2025	151.634	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	150.000	3,01 %	25.07.2025	151.513	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	150.000	3,15 %	15.01.2020	151.477	0,01 %
Progress Energy, Inc.	150.000	3,15 %	01.04.2022	151.395	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	150.000	2,72 %	25.06.2022	151.390	0,01 %
CMS Energy Corp.	150.000	3,45 %	15.08.2027	151.289	0,01 %
BlackRock, Inc.	150.000	3,20 %	15.03.2027	151.255	0,01 %
Hess Corp.	125.000	7,13 %	15.03.2033	151.189	0,01 %
ConocoPhillips Co.	150.000	2,88 %	15.11.2021	151.125	0,01 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	150.000	3,88 %	15.01.2022	151.059	0,01 %
Kroger Co.	150.000	3,70 %	01.08.2027	151.028	0,01 %
Chevron Corp.	150.000	2,90 %	03.03.2024	151.015	0,01 %
United Airlines 2016-1 Klasse A Pass Through Trust	150.000	3,45 %	07.07.2028	151.011	0,01 %
Rockwell Collins, Inc.	150.000	3,20 %	15.03.2024	150.967	0,01 %
eBay, Inc.	150.000	2,88 %	01.08.2021	150.966	0,01 %
ITC Holdings Corp.	125.000	5,30 %	01.07.2043	150.965	0,01 %
American Tower Corp.	150.000	2,80 %	01.06.2020	150.838	0,01 %
Invesco Finance plc	150.000	3,13 %	30.11.2022	150.815	0,01 %
Charles Schwab Corp.	150.000	3,20 %	02.03.2027	150.759	0,01 %
Georgia Power Co.	150.000	2,85 %	15.05.2022	150.643	0,01 %
Abbott Laboratories	150.000	2,80 %	15.09.2020	150.622	0,01 %
Ares Capital Corp.	150.000	3,63 %	19.01.2022	150.622	0,01 %
Amgen, Inc.	150.000	3,13 %	01.05.2025	150.588	0,01 %
Realty Income Corp.	150.000	3,65 %	15.01.2028	150.562	0,01 %
William Marsh Rice University	150.000	3,57 %	15.05.2045	150.501	0,01 %
Applied Materials, Inc.	125.000	5,10 %	01.10.2035	150.465	0,01 %
Protective Life Global Funding	150.000	2,70 %	25.11.2020	150.460	0,01 %
Salt River Project Agricultural Improvement & Power District	125.000	4,84 %	01.01.2041	150.439	0,01 %
Fifth Third Bank	150.000	2,38 %	25.04.2019	150.436	0,01 %
Maxim Integrated Products, Inc.	150.000	3,45 %	15.06.2027	150.426	0,01 %
Ventas Realty LP/Ventas Capital Corp.	150.000	2,70 %	01.04.2020	150.423	0,01 %
Ryder System, Inc.	150.000	2,55 %	01.06.2019	150.406	0,01 %
Energy Transfer LP	150.000	3,60 %	01.02.2023	150.379	0,01 %
Coca-Cola Co.	150.000	2,50 %	01.04.2023	150.330	0,01 %
KeyBank NA	150.000	2,50 %	15.12.2019	150.330	0,01 %
Praxair, Inc.	150.000	2,45 %	15.02.2022	150.321	0,01 %
Lockheed Martin Corp.	150.000	3,60 %	01.03.2035	150.305	0,01 %
Williams Partners LP	150.000	3,75 %	15.06.2027	150.301	0,01 %
Cisco Systems, Inc.	150.000	2,95 %	28.02.2026	150.273	0,01 %
Chevron Corp.	150.000	2,19 %	15.11.2019	150.271	0,01 %
Seagate HDD Cayman	150.000	4,88 %	01.03.2024	150.188	0,01 %
Mid-America Apartments LP	150.000	3,60 %	01.06.2027	150.182	0,01 %
Mead Johnson Nutrition Co.	135.000	4,60 %	01.06.2044	150.163	0,01 %
Chevron Corp.	150.000	2,50 %	03.03.2022	150.135	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	150.000	2,10 %	15.01.2019	150.066	0,01 %
Kaiser Foundation Hospitals	150.000	3,15 %	01.05.2027	150.063	0,01 %
Laboratory Corp. of America Holdings	150.000	3,60 %	01.09.2027	150.062	0,01 %
PNC Bank NA	150.000	2,95 %	30.01.2023	150.054	0,01 %
PepsiCo, Inc.	150.000	2,75 %	30.04.2025	150.052	0,01 %
Simon Property Group LP	150.000	2,20 %	01.02.2019	150.026	0,01 %
USAA Capital Corp.	150.000	2,45 %	01.08.2020	150.003	0,01 %
Mastercard, Inc.	150.000	2,95 %	21.11.2026	149.945	0,01 %
Capital One Bank USA NA	150.000	2,25 %	13.02.2019	149.911	0,01 %
Ally Master Owner Trust	150.000	1,63 %	15.05.2020	149.905	0,01 %
Sonoco Products Co.	125.000	5,75 %	01.11.2040	149.878	0,01 %
USAA Capital Corp.	150.000	2,13 %	03.06.2019	149.837	0,01 %
FedEx Corp.	150.000	2,63 %	01.08.2022	149.808	0,01 %
Cigna Corp.	150.000	3,88 %	15.10.2047	149.757	0,01 %
Equifax, Inc.	150.000	3,30 %	15.12.2022	149.695	0,01 %
Simon Property Group LP	150.000	2,63 %	15.06.2022	149.626	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	125.000	4,88 %	15.11.2040	149.617	0,01 %
Caterpillar Financial Services Corp.	150.000	2,00 %	29.11.2019	149.572	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Chevron Corp.	150.000	2,41 %	03.03.2022	149.563	0,01 %
KeyBank NA	150.000	2,25 %	16.03.2020	149.553	0,01 %
Simon Property Group LP	150.000	2,75 %	01.06.2023	149.515	0,01 %
Florida Power & Light Co.	150.000	2,75 %	01.06.2023	149.514	0,01 %
PNC Bank NA	150.000	2,30 %	01.06.2020	149.513	0,01 %
Amazon.com, Inc.	150.000	2,80 %	22.08.2024	149.506	0,01 %
Protective Life Global Funding	150.000	2,26 %	08.04.2020	149.482	0,01 %
AutoZone, Inc.	150.000	3,25 %	15.04.2025	149.470	0,01 %
City of San Francisco CA Public Utilities Commission Water Revenue	100.000	6,95 %	01.11.2050	149.380	0,01 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013^	140.000	4,15 %	15.08.2046	149.318	0,01 %
Kansas City Southern	150.000	3,00 %	15.05.2023	149.226	0,01 %
Kellogg Co.	150.000	3,40 %	15.11.2027	149.193	0,01 %
Fortive Corp.	150.000	3,15 %	15.06.2026	149.178	0,01 %
3M Co.	150.000	2,00 %	07.08.2020	149.138	0,01 %
United Technologies Corp.	125.000	5,40 %	01.05.2035	149.086	0,01 %
Synchrony Bank	150.000	3,00 %	15.06.2022	149.058	0,01 %
Discovery Communications LLC	150.000	3,25 %	01.04.2023	149.032	0,01 %
Alabama Power Co.	150.000	2,45 %	30.03.2022	149.011	0,01 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2017	150.000	1,67 %	15.06.2021	148.984	0,01 %
Edison International	150.000	2,95 %	15.03.2023	148.961	0,01 %
Smithfield Foods, Inc.	150.000	2,70 %	31.01.2020	148.941	0,01 %
EPR Properties	145.000	4,75 %	15.12.2026	148.886	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	150.000	2,45 %	06.11.2020	148.861	0,01 %
Martin Marietta Materials, Inc.	150.000	3,50 %	15.12.2027	148.852	0,01 %
WestRock Co.	150.000	3,38 %	15.09.2027	148.827	0,01 %
Southern Power Co.	150.000	1,95 %	15.12.2019	148.797	0,01 %
John Deere Capital Corp.	150.000	1,95 %	22.06.2020	148.750	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	150.000	2,00 %	14.04.2020	148.743	0,01 %
eBay, Inc.	150.000	2,15 %	05.06.2020	148.741	0,01 %
Moody's Corp.	150.000	2,75 %	15.07.2019	148.724	0,01 %
Essex Portfolio LP	150.000	3,38 %	15.04.2026	148.609	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	150.000	3,20 %	15.08.2027	148.593	0,01 %
Southern California Edison Co.	150.000	2,40 %	01.02.2022	148.589	0,01 %
SunTrust Bank/Atlanta GA	150.000	2,75 %	01.05.2023	148.585	0,01 %
Simon Property Group LP	150.000	3,25 %	30.11.2026	148.571	0,01 %
Nissan Master Owner Trust Receivables	150.000	1,54 %	15.06.2021	148.565	0,01 %
Leggett & Platt, Inc.	150.000	3,50 %	15.11.2027	148.459	0,01 %
eBay, Inc.	150.000	2,75 %	30.01.2023	148.420	0,01 %
Priceline Group, Inc.	150.000	3,55 %	15.03.2028	148.415	0,01 %
Martin Marietta Materials, Inc.	150.000	4,25 %	15.12.2047	148.413	0,01 %
BB&T Corp.	150.000	2,85 %	26.10.2024	148.399	0,01 %
Cardinal Health, Inc.	150.000	4,37 %	15.06.2047	148.384	0,01 %
Johnson & Johnson	150.000	2,63 %	15.01.2025	148.378	0,01 %
Lowe's Cos, Inc.	150.000	1,15 %	15.04.2019	148.367	0,01 %
Fifth Third Auto Trust 2017	150.000	2,03 %	15.07.2024	148.354	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	150.000	1,55 %	13.09.2019	148.353	0,01 %
Activision Blizzard, Inc.	150.000	2,60 %	15.06.2022	148.351	0,01 %
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	150.000	3,45 %	30.04.2025	148.328	0,01 %
Mylan NV	150.000	2,50 %	07.06.2019	148.319	0,01 %
Protective Life Global Funding	150.000	1,56 %	13.09.2019	148.267	0,01 %
McKesson Corp.	150.000	2,70 %	15.12.2022	148.183	0,01 %
Tyco Electronics Group SA	150.000	3,13 %	15.08.2027	148.083	0,01 %
Chase Issuance Trust	150.000	1,27 %	15.07.2021	148.069	0,01 %
VEREIT Operating Partnership LP	150.000	3,95 %	15.08.2027	148.052	0,01 %
Martin Marietta Materials, Inc.	150.000	3,45 %	01.06.2027	148.044	0,01 %
Sysco Corp.	125.000	5,38 %	21.09.2035	147.999	0,01 %
Kaiser Foundation Hospitals	125.000	4,88 %	01.04.2042	147.840	0,01 %
Cummins, Inc.	125.000	4,88 %	01.10.2043	147.780	0,01 %
CBS Corp.	150.000	3,70 %	01.06.2028	147.768	0,01 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	150.000	3,25 %	15.06.2026	147.767	0,01 %
Jackson National Life Global Funding	150.000	3,05 %	29.04.2026	147.668	0,01 %
Prcoa Global Funding I	150.000	1,45 %	13.09.2019	147.614	0,01 %
Moody's Corp.	137.000	5,50 %	01.09.2020	147.517	0,01 %
Eaton Corp.	150.000	3,10 %	15.09.2027	147.332	0,01 %
CenterPoint Energy Houston Electric LLC	150.000	2,25 %	01.08.2022	147.271	0,01 %
Ingredion, Inc.	150.000	3,20 %	01.10.2026	147.135	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
American Tower Corp.	150.000	3,38 %	15.10.2026	147.090	0,01 %
IBM Credit LLC	150.000	2,20 %	08.09.2022	147.079	0,01 %
United Airlines 2016-2 Klasse AA Pass Through Trust	150.000	2,88 %	07.10.2028	147.070	0,01 %
3M Co.	150.000	2,00 %	26.06.2022	146.997	0,01 %
Baltimore Gas & Electric Co.	150.000	3,50 %	15.08.2046	146.968	0,01 %
John Deere Capital Corp.	150.000	2,80 %	08.09.2027	146.942	0,01 %
AT&T, Inc.	125.000	6,35 %	15.03.2040	146.833	0,01 %
Zoetis, Inc.	150.000	3,00 %	12.09.2027	146.478	0,01 %
Metropolitan Life Global Funding I	150.000	1,95 %	15.09.2021	146.348	0,01 %
PPL Capital Funding, Inc.	125.000	5,00 %	15.03.2044	146.200	0,01 %
Xerox Corp.	150.000	3,63 %	15.03.2023	146.030	0,01 %
AvalonBay Communities, Inc.	150.000	2,90 %	15.10.2026	145.962	0,01 %
Southwestern Public Service Co.	150.000	3,40 %	15.08.2046	145.875	0,01 %
Energy Transfer LP	150.000	5,15 %	15.03.2045	145.230	0,01 %
Farmers Exchange Capital III^	135.000	5,45 %	15.10.2054	145.026	0,01 %
Protective Life Global Funding	150.000	2,00 %	14.09.2021	145.011	0,01 %
Continental Airlines 2012-2 Klasse A Pass Through Trust	139.551	4,00 %	29.10.2024	144.963	0,01 %
Entergy Louisiana LLC	150.000	3,05 %	01.06.2031	144.940	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	150.000	2,13 %	10.05.2023	144.745	0,01 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	100.000	6,75 %	01.04.2038	144.565	0,01 %
Bay Area Toll Authority	100.000	6,92 %	01.04.2040	144.282	0,01 %
Newmont Mining Corp.	113.000	6,25 %	01.10.2039	144.232	0,01 %
International Paper Co.	125.000	5,15 %	15.05.2046	144.042	0,01 %
Tyco Electronics Group SA	100.000	7,13 %	01.10.2037	143.707	0,01 %
Blackstone Holdings Finance Co. LLC	125.000	5,00 %	15.06.2044	143.649	0,01 %
UDR, Inc.	150.000	2,95 %	01.09.2026	143.504	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	150.000	2,85 %	31.01.2023	143.430	0,01 %
Brooklyn Union Gas Co.	125.000	4,50 %	10.03.2046	143.119	0,01 %
Halliburton Co.	100.000	7,45 %	15.09.2039	143.008	0,01 %
American Airlines 2016-3 Klasse AA Pass Through Trust	145.858	3,00 %	15.10.2028	142.984	0,01 %
Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017	140.000	3,75 %	15.02.2050	142.943	0,01 %
Piedmont Natural Gas Co., Inc.	125.000	4,65 %	01.08.2043	142.866	0,01 %
Delta Air Lines 2007-1 Klasse A Pass Through Trust	125.912	6,82 %	10.08.2022	142.529	0,01 %
Northrop Grumman Systems Corp.	100.000	7,75 %	15.02.2031	142.500	0,01 %
3M Co.	150.000	2,25 %	19.09.2026	142.267	0,01 %
Kansas City Southern	125.000	4,95 %	15.08.2045	141.994	0,01 %
CBL & Associates LP	150.000	5,25 %	01.12.2023	141.860	0,01 %
Dr Pepper Snapple Group, Inc.	150.000	2,55 %	15.09.2026	141.609	0,01 %
Boeing Co.	100.000	6,63 %	15.02.2038	141.526	0,01 %
Massachusetts Mutual Life Insurance Co.	125.000	4,90 %	01.04.2077	141.233	0,01 %
American Airlines 2016-2 Klasse AA Pass Through Trust	142.200	3,20 %	15.06.2028	141.192	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	125.000	4,45 %	15.03.2043	141.086	0,01 %
Sysco Corp.	125.000	4,85 %	01.10.2045	141.031	0,01 %
Microsoft Corp.	135.000	3,75 %	01.05.2043	141.011	0,01 %
Eli Lilly & Co.	110.000	5,55 %	15.03.2037	140.722	0,01 %
Nevada Power Co.	100.000	6,75 %	01.07.2037	140.643	0,01 %
General Dynamics Corp.	150.000	2,13 %	15.08.2026	140.485	0,01 %
Prudential Financial, Inc.	100.000	6,63 %	01.12.2037	140.368	0,01 %
Fidelity National Information Services, Inc.	135.000	4,50 %	15.08.2046	140.238	0,01 %
Tyson Foods, Inc.	125.000	4,88 %	15.08.2034	140.225	0,01 %
Public Service Co. of Colorado	100.000	6,50 %	01.08.2038	140.195	0,01 %
Connecticut Light & Power Co.	125.000	4,30 %	15.04.2044	140.155	0,01 %
Commonwealth Edison Co.	125.000	4,35 %	15.11.2045	140.130	0,01 %
Juniper Networks, Inc.	125.000	5,95 %	15.03.2041	140.019	0,01 %
American Water Capital Corp.	100.000	6,59 %	15.10.2037	139.745	0,01 %
Legg Mason, Inc.	125.000	5,63 %	15.01.2044	139.528	0,01 %
Fidelity National Information Services, Inc.	126.000	5,00 %	15.10.2025	139.094	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	100.000	6,50 %	15.06.2037	139.042	0,01 %
Abbott Laboratories	125.000	4,75 %	15.04.2043	138.890	0,01 %
Duke Energy Florida LLC	100.000	6,35 %	15.09.2037	138.841	0,01 %
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	140.000	2,15 %	26.02.2020	138.809	0,01 %
Georgia Power Co.	125.000	4,75 %	01.09.2040	138.605	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	125.000	4,50 %	01.02.2045	138.501	0,01 %
Conagra Brands, Inc.	100.000	8,25 %	15.09.2030	138.402	0,01 %
Block Financial LLC	130.000	5,25 %	01.10.2025	138.366	0,01 %
Comcast Corp.	125.000	4,50 %	15.01.2043	138.337	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal National Mortgage Association^	140.000	2,56 %	25.07.2024	138.323	0,01 %
Deere & Co.	100.000	7,13 %	03.03.2031	138.175	0,01 %
Time Warner, Inc.	125.000	5,38 %	15.10.2041	138.079	0,01 %
Metropolitan Government of Nashville & Davidson County Convention Center Auth	100.000	6,73 %	01.07.2043	138.045	0,01 %
Allstate Corp.^	115.000	6,50 %	15.05.2057	138.000	0,01 %
Waste Management, Inc.	130.000	4,60 %	01.03.2021	137.981	0,01 %
Realty Income Corp.	125.000	4,65 %	15.03.2047	137.911	0,01 %
United Technologies Corp.	100.000	7,50 %	15.09.2029	137.607	0,01 %
CBS Corp.	125.000	5,50 %	15.05.2033	137.389	0,01 %
Moody's Corp.	125.000	4,88 %	15.02.2024	137.386	0,01 %
AvalonBay Communities, Inc.	140.000	2,95 %	11.05.2026	137.303	0,01 %
PepsiCo, Inc.	125.000	4,25 %	22.10.2044	137.211	0,01 %
PPL Electric Utilities Corp.	100.000	6,25 %	15.05.2039	137.176	0,01 %
American International Group, Inc.^	100.000	8,18 %	15.05.2058	137.041	0,01 %
San Diego County Regional Transportation Commission Public Service Co. of Colorado	100.000	5,91 %	01.04.2048	136.891	0,01 %
PacifiCorp	100.000	6,25 %	01.09.2037	136.869	0,01 %
Continental Airlines 2007-1 Klasse A Pass Through Trust	125.815	5,98 %	15.10.2037	136.852	0,01 %
Johnson & Johnson	100.000	5,98 %	19.04.2022	136.824	0,01 %
Atmos Energy Corp.	125.000	5,95 %	15.08.2037	136.743	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	125.000	4,13 %	15.10.2044	136.582	0,01 %
ConocoPhillips Co.	125.000	4,60 %	15.06.2043	136.481	0,01 %
Regional Transportation District	125.000	4,30 %	15.11.2044	136.277	0,01 %
Anadarko Petroleum Corp.	100.000	5,84 %	01.11.2050	136.238	0,01 %
United Airlines 2014-2 Klasse A Pass Through Trust	100.000	7,95 %	15.06.2039	136.207	0,01 %
El du Pont de Nemours & Co.	132.795	3,75 %	03.09.2026	136.125	0,01 %
Blackstone Holdings Finance Co. LLC	112.000	5,60 %	15.12.2036	135.919	0,01 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates	125.000	4,75 %	15.02.2023	135.890	0,01 %
Ford Motor Co.	136.151	2,49 %	25.11.2024	135.760	0,01 %
Walgreens Boots Alliance, Inc.	100.000	7,40 %	01.11.2046	135.754	0,01 %
South Carolina Public Service Authority	130.000	4,50 %	18.11.2034	135.738	0,01 %
Northern States Power Co.	100.000	6,45 %	01.01.2050	135.728	0,01 %
Johnson Controls International plc	100.000	6,20 %	01.07.2037	135.623	0,01 %
Chubb INA Holdings, Inc.	115.000	5,13 %	14.09.2045	135.608	0,01 %
Jefferies Group LLC	125.000	4,15 %	13.03.2043	135.597	0,01 %
George Washington University	125.000	8,50 %	15.07.2019	135.553	0,01 %
Valero Energy Corp.	125.000	4,30 %	15.09.2044	135.339	0,01 %
Coventry Health Care, Inc.	125.000	9,38 %	15.03.2019	135.333	0,01 %
Bank of New York Mellon Corp.	125.000	5,45 %	15.06.2021	135.328	0,01 %
Aon plc	135.000	2,50 %	15.04.2021	135.320	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	125.000	4,60 %	14.06.2044	135.111	0,01 %
City of New York NY	129.000	5,40 %	01.09.2044	135.049	0,01 %
General Motors Co.	100.000	6,27 %	01.12.2037	135.032	0,01 %
Duke Energy Progress LLC	125.000	6,27 %	02.10.2023	134.870	0,01 %
Buckeye Partners LP	125.000	4,88 %	15.05.2042	134.787	0,01 %
Duke Energy Carolinas LLC	125.000	4,10 %	15.11.2043	134.735	0,01 %
El Paso Electric Co.	100.000	5,85 %	15.04.2038	134.631	0,01 %
Puget Sound Energy, Inc.	125.000	6,05 %	15.04.2038	134.614	0,01 %
WR Berkley Corp.	100.000	5,00 %	01.12.2044	134.614	0,01 %
Westar Energy, Inc.	125.000	6,27 %	15.03.2037	134.588	0,01 %
Valero Energy Corp.	125.000	4,75 %	01.08.2044	134.409	0,01 %
NYU Hospitals Center	125.000	4,10 %	01.04.2043	134.356	0,01 %
United Airlines 2014-1 Klasse A Pass Through Trust	100.000	7,50 %	15.04.2032	134.336	0,01 %
Florida Power & Light Co.	125.000	4,37 %	01.07.2047	134.329	0,01 %
American Airlines 2011-1 Klasse A Pass Through Trust	129.045	4,00 %	11.04.2026	134.251	0,01 %
GS Mortgage Securities Trust 2013-GCJ14	100.000	5,95 %	01.02.2038	134.183	0,01 %
Pioneer Natural Resources Co.	127.408	5,25 %	31.01.2021	134.011	0,01 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	125.000	4,24 %	10.08.2046	133.855	0,01 %
Darden Restaurants, Inc.	125.000	4,45 %	15.01.2026	133.845	0,01 %
FedEx Corp.	125.000	4,80 %	15.07.2021	133.507	0,01 %
Maryland State Transportation Authority	100.000	6,80 %	15.10.2037	133.496	0,01 %
San Diego Gas & Electric Co.	125.000	4,40 %	15.01.2047	133.468	0,01 %
Jabil, Inc.	100.000	5,89 %	01.07.2043	133.399	0,01 %
Boeing Co.	100.000	6,00 %	01.06.2039	133.380	0,01 %
Prudential Financial, Inc.^	125.000	5,63 %	15.12.2020	133.361	0,01 %
Baltimore Gas & Electric Co.	100.000	6,13 %	15.02.2033	133.354	0,01 %
	125.000	5,20 %	15.03.2044	133.281	0,01 %
	100.000	6,35 %	01.10.2036	133.256	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Energy Transfer LP	125.000	5,20 %	01.02.2022	133.228	0,01 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	100.000	6,20 %	15.06.2036	132.991	0,01 %
Boeing Co.	100.000	5,88 %	15.02.2040	132.946	0,01 %
PacifiCorp	100.000	6,10 %	01.08.2036	132.941	0,01 %
Applied Materials, Inc.	125.000	3,90 %	01.10.2025	132.768	0,01 %
DXC Technology Co.	125.000	4,75 %	15.04.2027	132.757	0,01 %
Lubrizol Corp.	100.000	6,50 %	01.10.2034	132.716	0,01 %
Keysight Technologies, Inc.	125.000	4,55 %	30.10.2024	132.555	0,01 %
Aptiv plc	125.000	4,25 %	15.01.2026	132.553	0,01 %
New Jersey Transportation Trust Fund Authority	100.000	6,56 %	15.12.2040	132.511	0,01 %
TCI Communications, Inc.	100.000	7,88 %	15.02.2026	132.469	0,01 %
Southern California Edison Co.	100.000	5,95 %	01.02.2038	132.465	0,01 %
UDR, Inc.	125.000	4,63 %	10.01.2022	132.371	0,01 %
Massachusetts Electric Co.	125.000	4,00 %	15.08.2046	132.268	0,01 %
Princeton University	100.000	5,70 %	01.03.2039	132.263	0,01 %
Trinity Health Corp.	125.000	4,13 %	01.12.2045	132.099	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	100.000	5,95 %	15.02.2041	132.076	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	125.000	4,50 %	01.03.2021	132.063	0,01 %
Motiva Enterprises LLC	125.000	5,75 %	15.01.2020	132.012	0,01 %
Nasdaq, Inc.	125.000	4,25 %	01.06.2024	131.898	0,01 %
State of Wisconsin	115.000	5,70 %	01.05.2026	131.890	0,01 %
BAE Systems Holdings, Inc.	125.000	6,38 %	01.06.2019	131.888	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	100.000	6,25 %	01.03.2039	131.849	0,01 %
KeySpan Corp.	110.000	5,88 %	01.04.2033	131.771	0,01 %
Prudential Financial, Inc.	125.000	4,50 %	15.11.2020	131.768	0,01 %
Halliburton Co.	125.000	4,50 %	15.11.2041	131.703	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	150.000	4,30 %	31.01.2043	131.691	0,01 %
Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC	125.000	4,45 %	01.08.2042	131.657	0,01 %
Kroger Co.	100.000	7,50 %	01.04.2031	131.636	0,01 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	125.000	4,10 %	01.06.2022	131.619	0,01 %
Invesco Finance plc	125.000	4,00 %	30.01.2024	131.608	0,01 %
Microsoft Corp.	125.000	4,00 %	08.02.2021	131.451	0,01 %
Ingredion, Inc.	125.000	4,63 %	01.11.2020	131.404	0,01 %
Union Pacific Corp.	120.000	4,38 %	15.11.2065	131.385	0,01 %
American Municipal Power, Inc.	100.000	5,94 %	15.02.2047	131.318	0,01 %
Tech Data Corp.	125.000	4,95 %	15.02.2027	131.219	0,01 %
Port Authority of New York & New Jersey	100.000	5,65 %	01.11.2040	131.163	0,01 %
Interpublic Group of Cos, Inc.	125.000	4,20 %	15.04.2024	131.155	0,01 %
Welltower, Inc.	100.000	6,50 %	15.03.2041	131.139	0,01 %
Exelon Generation Co. LLC	125.000	4,25 %	15.06.2022	131.118	0,01 %
University of California	100.000	5,95 %	15.05.2045	130.969	0,01 %
Amazon.com, Inc.	131.000	2,50 %	29.11.2022	130.910	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	115.000	4,63 %	15.11.2041	130.906	0,01 %
Pennsylvania Turnpike Commission	100.000	5,51 %	01.12.2045	130.804	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	100.000	6,55 %	15.03.2033	130.799	0,01 %
University of California	100.000	5,77 %	15.05.2043	130.796	0,01 %
MetLife, Inc.	125.000	3,60 %	10.04.2024	130.750	0,01 %
Honeywell International, Inc.	100.000	5,70 %	15.03.2037	130.676	0,01 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	125.000	3,88 %	15.06.2047	130.655	0,01 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	130.000	3,45 %	15.01.2021	130.601	0,01 %
O'Reilly Automotive, Inc.	125.000	3,80 %	01.09.2022	130.564	0,01 %
Entergy Corp.	125.000	4,00 %	15.07.2022	130.559	0,01 %
Berkshire Hathaway, Inc.	125.000	3,75 %	15.08.2021	130.524	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	125.000	3,95 %	15.10.2042	130.522	0,01 %
KLA-Tencor Corp.	125.000	4,13 %	01.11.2021	130.438	0,01 %
Time Warner, Inc.	125.000	4,00 %	15.01.2022	130.271	0,01 %
CBS Corp.	125.000	4,90 %	15.08.2044	130.260	0,01 %
Florida Power & Light Co.	125.000	3,70 %	01.12.2047	130.230	0,01 %
Nordstrom, Inc.	125.000	4,75 %	01.05.2020	130.225	0,01 %
Georgia-Pacific LLC	125.000	3,73 %	15.07.2023	130.198	0,01 %
Clorox Co.	125.000	3,80 %	15.11.2021	130.178	0,01 %
DXC Technology Co.	125.000	4,25 %	15.04.2024	130.138	0,01 %
Arch Capital Finance LLC	125.000	4,01 %	15.12.2026	130.119	0,01 %
Metropolitan Water Reclamation District of Greater Chicago	100.000	5,72 %	01.12.2038	130.030	0,01 %
MetLife, Inc.	125.000	3,60 %	13.11.2025	129.997	0,01 %
DTE Energy Co.	100.000	6,38 %	15.04.2033	129.995	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	130.000	2,80 %	15.01.2023	129.907	0,01 %
Packaging Corp. of America	125.000	3,90 %	15.06.2022	129.892	0,01 %
Duke Energy Ohio, Inc.	125.000	5,45 %	01.04.2019	129.888	0,01 %
Illinois State Toll Highway Authority	100.000	6,18 %	01.01.2034	129.795	0,01 %
Aon Corp.	100.000	6,25 %	30.09.2040	129.779	0,01 %
Progressive Corp.	125.000	3,75 %	23.08.2021	129.760	0,01 %
Hospitality Properties Trust	125.000	4,50 %	15.03.2025	129.706	0,01 %
DTE Electric Co.	125.000	3,75 %	15.08.2047	129.701	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	125.000	3,80 %	15.09.2047	129.678	0,01 %
Kansas City Southern	125.000	4,30 %	15.05.2043	129.654	0,01 %
Mylan, Inc.	125.000	4,20 %	29.11.2023	129.597	0,01 %
Bank of America Corp.	129.000	2,60 %	15.01.2019	129.506	0,01 %
Bristol-Myers Squibb Co.	125.000	3,25 %	01.11.2023	129.470	0,01 %
Union Pacific Corp.	125.000	3,60 %	15.09.2037	129.225	0,01 %
Union Pacific Corp.	125.000	4,10 %	15.09.2067	129.222	0,01 %
Kroger Co.	125.000	4,00 %	01.02.2024	129.192	0,01 %
Spirit AeroSystems, Inc.	125.000	5,25 %	15.03.2022	129.063	0,01 %
SSM Health Care Corp.	125.000	3,82 %	01.06.2027	129.017	0,01 %
CC Holdings GS V LLC/Crown Castle GS III Corp.	125.000	3,85 %	15.04.2023	129.004	0,01 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates	125.000	3,29 %	25.11.2050	128.974	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	125.000	3,45 %	01.09.2022	128.955	0,01 %
LG&E & KU Energy LLC	125.000	3,75 %	15.11.2020	128.947	0,01 %
US Bancorp	125.000	3,60 %	11.09.2024	128.941	0,01 %
DTE Energy Co.	125.000	3,80 %	15.03.2027	128.872	0,01 %
Florida Power & Light Co.	100.000	5,65 %	01.02.2037	128.861	0,01 %
Loews Corp.	125.000	4,13 %	15.05.2043	128.821	0,01 %
American Tower Corp.	125.000	4,00 %	01.06.2025	128.817	0,01 %
Exelon Generation Co. LLC	125.000	4,00 %	01.10.2020	128.802	0,01 %
State of Oregon Department of Transportation	100.000	5,83 %	15.11.2034	128.790	0,01 %
New York Life Insurance Co.	100.000	5,88 %	15.05.2033	128.686	0,01 %
Kaiser Foundation Hospitals	125.000	3,50 %	01.04.2022	128.654	0,01 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	125.000	3,50 %	10.03.2025	128.647	0,01 %
Duke Energy Carolinas LLC	125.000	3,70 %	01.12.2047	128.578	0,01 %
Boston Scientific Corp.	125.000	3,85 %	15.05.2025	128.516	0,01 %
American Express Co.	125.000	3,63 %	05.12.2024	128.504	0,01 %
Interpublic Group of Cos, Inc.	125.000	3,75 %	15.02.2023	128.368	0,01 %
Duke Energy Corp.	125.000	3,95 %	15.08.2047	128.227	0,01 %
Reynolds American, Inc.	100.000	6,15 %	15.09.2043	128.171	0,01 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013	121.000	4,04 %	15.11.2046	128.132	0,01 %
Johns Hopkins Health System Corp.	125.000	3,84 %	15.05.2046	128.127	0,01 %
Discover Financial Services	125.000	3,85 %	21.11.2022	128.062	0,01 %
PPL Capital Funding, Inc.	125.000	4,00 %	15.09.2047	127.987	0,01 %
International Business Machines Corp.	100.000	6,50 %	15.01.2028	127.986	0,01 %
CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust	125.000	3,51 %	15.04.2050	127.972	0,01 %
Central Puget Sound Regional Transit Authority	100.000	5,49 %	01.11.2039	127.924	0,01 %
AEP Transmission Co. LLC	125.000	3,75 %	01.12.2047	127.852	0,01 %
Southern California Edison Co.	100.000	6,65 %	01.04.2029	127.838	0,01 %
Munich Re America Corp.	100.000	7,45 %	15.12.2026	127.781	0,01 %
Scripps Networks Interactive, Inc.	125.000	3,90 %	15.11.2024	127.684	0,01 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017	125.000	3,47 %	15.11.2050	127.673	0,01 %
Visa, Inc.	125.000	3,65 %	15.09.2047	127.654	0,01 %
Wisconsin Electric Power Co.	100.000	5,70 %	01.12.2036	127.602	0,01 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	125.000	4,25 %	01.04.2024	127.519	0,01 %
Nissan Auto Receivables 2017-B Owner Trust	129.000	1,95 %	16.10.2023	127.509	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	125.000	3,70 %	15.09.2050	127.451	0,01 %
Commonwealth of Massachusetts	100.000	5,46 %	01.12.2039	127.413	0,01 %
International Business Machines Corp.	125.000	3,30 %	27.01.2027	127.413	0,01 %
Aetna, Inc.	125.000	4,13 %	15.11.2042	127.379	0,01 %
PepsiCo, Inc.	110.000	4,60 %	17.07.2045	127.346	0,01 %
Massachusetts School Building Authority	100.000	5,72 %	15.08.2039	127.338	0,01 %
Norfolk Southern Corp.	127.000	2,90 %	15.02.2023	127.335	0,01 %
Zoetis, Inc.	125.000	3,95 %	12.09.2047	127.334	0,01 %
Duke Energy Progress LLC	125.000	3,25 %	15.08.2025	127.329	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	100.000	7,50 %	15.11.2040	127.321	0,01 %
ERP Operating LP	125.000	3,38 %	01.06.2025	127.304	0,01 %
Leggett & Platt, Inc.	125.000	3,80 %	15.11.2024	127.233	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue	100.000	5,51 %	01.08.2037	127.225	0,01 %
NSTAR Electric Co.	100.000	5,50 %	15.03.2040	127.196	0,01 %
Constellation Brands, Inc.	125.000	3,50 %	09.05.2027	127.150	0,01 %
Cincinnati Financial Corp.	100.000	6,13 %	01.11.2034	127.071	0,01 %
PacifiCorp	125.000	2,95 %	01.02.2022	126.949	0,01 %
Ares Capital Corp.	125.000	3,88 %	15.01.2020	126.944	0,01 %
County of Cook IL	100.000	6,23 %	15.11.2034	126.888	0,01 %
Delta Air Lines, Inc.	125.000	3,63 %	15.03.2022	126.848	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	125.000	2,86 %	25.01.2021	126.782	0,01 %
Discovery Communications LLC	125.000	3,80 %	13.03.2024	126.758	0,01 %
GS Mortgage Securities Trust 2017	125.000	3,66 %	10.08.2050	126.720	0,01 %
Starbucks Corp.	125.000	3,75 %	01.12.2047	126.716	0,01 %
Liberty Property LP	125.000	3,38 %	15.06.2023	126.618	0,01 %
Oglethorpe Power Corp.	100.000	5,95 %	01.11.2039	126.614	0,01 %
Interstate Power & Light Co.	125.000	3,25 %	01.12.2024	126.588	0,01 %
Wisconsin Public Service Corp.	125.000	3,67 %	01.12.2042	126.578	0,01 %
Textron, Inc.	125.000	3,65 %	15.03.2027	126.514	0,01 %
PepsiCo, Inc.	125.000	2,75 %	05.03.2022	126.503	0,01 %
AmeriSourceBergen Corp.	125.000	4,30 %	15.12.2047	126.393	0,01 %
Public Service Co. of Colorado	125.000	3,60 %	15.09.2042	126.352	0,01 %
Ventas Realty LP/Ventas Capital Corp.	125.000	3,25 %	15.08.2022	126.310	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017	125.000	3,32 %	15.10.2050	126.296	0,01 %
State of Washington	100.000	5,14 %	01.08.2040	126.225	0,01 %
Air Lease Corp.	125.000	3,38 %	15.01.2019	126.130	0,01 %
XLIT Ltd.	120.000	5,50 %	31.03.2045	126.031	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	125.000	2,88 %	15.03.2023	126.023	0,01 %
Boston Scientific Corp.	125.000	2,85 %	15.05.2020	125.799	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp. ^	125.000	2,57 %	25.09.2020	125.750	0,01 %
Northern States Power Co.	100.000	5,35 %	01.11.2039	125.705	0,01 %
General Motors Co.	100.000	6,75 %	01.04.2046	125.684	0,01 %
Duke Energy Progress LLC	125.000	3,60 %	15.09.2047	125.592	0,01 %
Harris Corp.	100.000	6,15 %	15.12.2040	125.572	0,01 %
FLIR Systems, Inc.	125.000	3,13 %	15.06.2021	125.570	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	125.000	2,35 %	01.02.2020	125.507	0,01 %
Raymond James Financial, Inc.	125.000	3,63 %	15.09.2026	125.464	0,01 %
Coca-Cola Co.	125.000	2,90 %	25.05.2027	125.362	0,01 %
AXA Financial, Inc.	100.000	7,00 %	01.04.2028	125.346	0,01 %
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. ^	125.000	4,80 %	01.12.2077	125.313	0,01 %
Old Republic International Corp.	125.000	3,88 %	26.08.2026	125.311	0,01 %
Activision Blizzard, Inc.	125.000	3,40 %	15.06.2027	125.255	0,01 %
Scripps Networks Interactive, Inc.	125.000	2,75 %	15.11.2019	125.217	0,01 %
Jackson National Life Global Funding	125.000	2,60 %	09.12.2020	125.178	0,01 %
O'Reilly Automotive, Inc.	125.000	3,60 %	01.09.2027	125.152	0,01 %
Tech Data Corp.	125.000	3,70 %	15.02.2022	125.116	0,01 %
Ameren Corp.	125.000	2,70 %	15.11.2020	125.104	0,01 %
Tapestry Inc.	125.000	4,13 %	15.07.2027	125.101	0,01 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	125.000	2,75 %	30.01.2022	125.072	0,01 %
Moody's Corp.	125.000	2,75 %	15.12.2021	125.070	0,01 %
Roper Technologies, Inc.	125.000	2,80 %	15.12.2021	125.070	0,01 %
ITC Holdings Corp.	125.000	3,35 %	15.11.2027	125.054	0,01 %
US Treasury Note	125.000	1,88 %	31.12.2019	124.980	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	100.000	5,40 %	01.06.2041	124.960	0,01 %
Reliance Standard Life Global Funding II	125.000	2,50 %	15.01.2020	124.879	0,01 %
Travelers Cos, Inc.	100.000	5,35 %	01.11.2040	124.865	0,01 %
GM Financial Automobile Leasing Trust 2016	125.000	1,62 %	20.09.2019	124.827	0,01 %
Walt Disney Co.	125.000	2,45 %	04.03.2022	124.827	0,01 %
Air Lease Corp.	125.000	3,63 %	01.04.2027	124.805	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	100.000	6,95 %	15.01.2038	124.734	0,01 %
Charles Schwab Corp.	125.000	3,20 %	25.01.2028	124.732	0,01 %
Stryker Corp.	125.000	2,00 %	08.03.2019	124.719	0,01 %
International Business Machines Corp.	100.000	6,22 %	01.08.2027	124.699	0,01 %
Dallas Area Rapid Transit	100.000	5,02 %	01.12.2048	124.690	0,01 %
Honda Auto Receivables 2017-4 Owner Trust	125.000	2,05 %	22.11.2021	124.618	0,01 %
State of California	125.000	2,37 %	01.04.2022	124.605	0,01 %
Emerson Electric Co.	125.000	2,63 %	15.02.2023	124.584	0,01 %
Charles Schwab Corp.	125.000	2,65 %	25.01.2023	124.571	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Apple, Inc.	125.000	1,55 %	08.02.2019	124.563	0,01 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	125.000	3,08 %	25.01.2031	124.445	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	100.000	7,30 %	15.08.2033	124.424	0,01 %
Discovery Communications LLC	125.000	4,95 %	15.05.2042	124.411	0,01 %
Pfizer, Inc.	125.000	2,20 %	15.12.2021	124.368	0,01 %
Republic Services, Inc.	100.000	5,70 %	15.05.2041	124.357	0,01 %
KeyBank NA	125.000	2,50 %	22.11.2021	124.346	0,01 %
Lazard Group LLC	125.000	3,63 %	01.03.2027	124.326	0,01 %
Avangrid, Inc.	125.000	3,15 %	01.12.2024	124.304	0,01 %
Costco Wholesale Corp.	125.000	2,15 %	18.05.2021	124.253	0,01 %
Kroger Co.	125.000	2,80 %	01.08.2022	124.176	0,01 %
Hewlett Packard Enterprise Co.	125.000	2,10 %	04.10.2019	124.096	0,01 %
New York Life Global Funding	125.000	2,00 %	09.04.2020	124.096	0,01 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	100.000	5,88 %	15.03.2041	124.092	0,01 %
Estee Lauder Cos, Inc.	125.000	1,80 %	07.02.2020	124.085	0,01 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	125.000	3,95 %	01.10.2046	124.064	0,01 %
Atmos Energy Corp.	125.000	3,00 %	15.06.2027	124.038	0,01 %
Philip Morris International, Inc.	125.000	3,13 %	02.03.2028	124.037	0,01 %
United Airlines 2016-1 Klasse AA Pass Through Trust	125.000	3,10 %	07.07.2028	124.000	0,01 %
CCRE3 Commercial Mortgage Trust 2012	122.000	3,42 %	15.10.2045	123.995	0,01 %
NetApp, Inc.	125.000	2,00 %	27.09.2019	123.959	0,01 %
HCP, Inc.	125.000	3,40 %	01.02.2025	123.953	0,01 %
Port Authority of New York & New Jersey	100.000	4,96 %	01.08.2046	123.938	0,01 %
American Campus Communities Operating Partnership LP	125.000	3,63 %	15.11.2027	123.869	0,01 %
Intercontinental Exchange, Inc.	125.000	2,35 %	15.09.2022	123.829	0,01 %
Omega Healthcare Investors, Inc.	125.000	4,75 %	15.01.2028	123.750	0,01 %
American Water Capital Corp.	125.000	2,95 %	01.09.2027	123.736	0,01 %
Assurant, Inc.	100.000	6,75 %	15.02.2034	123.713	0,01 %
Nissan Auto Receivables 2016-C Owner Trust	125.000	1,18 %	15.01.2021	123.699	0,01 %
Goodman US Finance Three LLC	125.000	3,70 %	15.03.2028	123.692	0,01 %
Coca-Cola Co.	125.000	2,20 %	25.05.2022	123.629	0,01 %
Moody's Corp.	125.000	2,63 %	15.01.2023	123.627	0,01 %
Hyundai Auto Receivables Trust 2016	125.000	1,29 %	15.04.2021	123.602	0,01 %
Royal Caribbean Cruises Ltd.	125.000	3,70 %	15.03.2028	123.594	0,01 %
Viacom, Inc.	124.000	3,88 %	01.04.2024	123.590	0,01 %
Boston Gas Co.	125.000	3,15 %	01.08.2027	123.525	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	100.000	5,95 %	01.02.2041	123.434	0,01 %
Goldman Sachs Group, Inc.	106.000	5,95 %	15.01.2027	123.423	0,01 %
International Lease Finance Corp.	118.000	4,63 %	15.04.2021	123.310	0,01 %
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	125.000	2,55 %	09.06.2022	123.282	0,01 %
KeyBank NA	125.000	2,40 %	09.06.2022	123.276	0,01 %
Municipal Electric Authority of Georgia	100.000	7,06 %	01.04.2057	123.238	0,01 %
Kroger Co.	125.000	1,50 %	30.09.2019	123.190	0,01 %
Priceline Group, Inc.	125.000	2,75 %	15.03.2023	123.177	0,01 %
Molson Coors Brewing Co.	125.000	1,45 %	15.07.2019	123.161	0,01 %
Air Lease Corp.	125.000	2,63 %	01.07.2022	123.122	0,01 %
Masco Corp.	125.000	3,50 %	15.11.2027	123.103	0,01 %
PACCAR Financial Corp.	125.000	2,30 %	10.08.2022	123.090	0,01 %
Kimberly-Clark Corp.	125.000	2,75 %	15.02.2026	123.077	0,01 %
Protective Life Global Funding	125.000	2,62 %	22.08.2022	123.064	0,01 %
DTE Energy Co.	125.000	1,50 %	01.10.2019	123.039	0,01 %
Federal National Mortgage Association	125.000	2,70 %	25.02.2026	123.020	0,01 %
Kellogg Co.	125.000	2,65 %	01.12.2023	123.013	0,01 %
Public Storage	125.000	2,37 %	15.09.2022	123.000	0,01 %
PepsiCo, Inc.	125.000	3,60 %	13.08.2042	122.914	0,01 %
Autodesk, Inc.	125.000	3,50 %	15.06.2027	122.878	0,01 %
Rutgers The State University of New Jersey	100.000	5,67 %	01.05.2040	122.812	0,01 %
Chase Issuance Trust	125.000	1,49 %	15.07.2022	122.805	0,01 %
FedEx Corp.	125.000	3,88 %	01.08.2042	122.697	0,01 %
Dover Corp.	100.000	5,38 %	01.03.2041	122.638	0,01 %
MassMutual Global Funding II	124.000	1,55 %	11.10.2019	122.514	0,01 %
Broadridge Financial Solutions, Inc.	125.000	3,40 %	27.06.2026	122.429	0,01 %
Hasbro, Inc.	125.000	3,50 %	15.09.2027	122.429	0,01 %
Host Hotels & Resorts LP	120.000	3,75 %	15.10.2023	122.407	0,01 %
Unum Group	100.000	5,75 %	15.08.2042	122.340	0,01 %
Microsoft Corp.	100.000	4,88 %	15.12.2043	122.273	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Estee Lauder Cos, Inc.	125.000	1,70 %	10.05.2021	122.217	0,01 %
Blackstone Holdings Finance Co. LLC	125.000	3,15 %	02.10.2027	122.173	0,01 %
Gilead Sciences, Inc.	125.000	1,95 %	01.03.2022	122.081	0,01 %
Exelon Corp.	100.000	5,63 %	15.06.2035	122.061	0,01 %
Federal National Mortgage Association	125.000	2,58 %	25.03.2026	122.040	0,01 %
Northwell Healthcare, Inc.	125.000	3,98 %	01.11.2046	121.959	0,01 %
Amgen, Inc.	125.000	1,85 %	19.08.2021	121.923	0,01 %
Port Authority of New York & New Jersey	100.000	4,81 %	15.10.2065	121.817	0,01 %
CBS Corp.	125.000	2,50 %	15.02.2023	121.735	0,01 %
S&P Global, Inc.	125.000	2,95 %	22.01.2027	121.652	0,01 %
Wisconsin Electric Power Co.	100.000	5,63 %	15.05.2033	121.564	0,01 %
Colgate-Palmolive Co.	125.000	1,95 %	01.02.2023	121.479	0,01 %
Columbia Property Trust Operating Partnership LP	125.000	3,65 %	15.08.2026	121.350	0,01 %
American Airlines 2016-1 Klasse AA Pass Through Trust	118.949	3,58 %	15.01.2028	121.233	0,01 %
Baxter International, Inc.	125.000	1,70 %	15.08.2021	121.204	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	125.000	4,70 %	01.11.2042	121.184	0,01 %
Santa Clara Valley Transportation Authority	100.000	5,88 %	01.04.2032	121.180	0,01 %
Ohio State University	100.000	4,91 %	01.06.2040	121.143	0,01 %
Cox Communications, Inc.	125.000	4,70 %	15.12.2042	121.014	0,01 %
Energy Transfer LP	125.000	5,15 %	01.02.2043	120.841	0,01 %
Union Electric Co.	100.000	5,30 %	01.08.2037	120.832	0,01 %
Altria Group, Inc.	125.000	2,63 %	16.09.2026	120.829	0,01 %
New York State Electric & Gas Corp.	120.000	3,25 %	01.12.2026	120.789	0,01 %
Duke Energy Florida Project Finance LLC	125.000	2,54 %	01.09.2029	120.699	0,01 %
Dover Corp.	100.000	5,38 %	15.10.2035	120.600	0,01 %
Hess Corp.	100.000	7,30 %	15.08.2031	120.472	0,01 %
QVC, Inc.	120.000	5,45 %	15.08.2034	120.472	0,01 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	125.000	3,63 %	01.06.2024	120.350	0,01 %
Georgia Power Co.	100.000	5,40 %	01.06.2040	120.193	0,01 %
Berkshire Hathaway Energy Co.	100.000	5,15 %	15.11.2043	120.128	0,01 %
Hasbro, Inc.	100.000	6,35 %	15.03.2040	119.881	0,01 %
Home Depot, Inc.	125.000	3,50 %	15.09.2056	119.794	0,01 %
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	100.000	6,83 %	23.10.2055	119.780	0,01 %
United Parcel Service, Inc.	125.000	2,40 %	15.11.2026	119.626	0,01 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	100.000	5,30 %	01.02.2044	119.221	0,01 %
PPL Electric Utilities Corp.	100.000	4,75 %	15.07.2043	119.028	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	100.000	4,95 %	15.09.2041	118.847	0,01 %
Ohio State University	115.000	3,80 %	01.12.2046	118.807	0,01 %
ONEOK Partners LP	100.000	6,20 %	15.09.2043	118.486	0,01 %
Raytheon Co.	100.000	4,70 %	15.12.2041	117.852	0,01 %
Delta Air Lines 2015-1 Klasse AA Pass Through Trust	114.306	3,63 %	30.07.2027	117.794	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	100.000	4,70 %	01.09.2045	117.735	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	100.000	6,50 %	01.09.2039	117.728	0,01 %
Stanley Black & Decker, Inc.	100.000	5,20 %	01.09.2040	117.705	0,01 %
Discovery Communications LLC	100.000	6,35 %	01.06.2040	117.420	0,01 %
Oglethorpe Power Corp.	100.000	5,38 %	01.11.2040	117.402	0,01 %
Harris Corp.	100.000	5,05 %	27.04.2045	117.353	0,01 %
Credit Suisse USA, Inc.	85.000	7,13 %	15.07.2032	117.213	0,01 %
American Municipal Power, Inc.	75.000	7,83 %	15.02.2041	117.078	0,01 %
Honda Auto Receivables 2017-2 Owner Trust	118.000	1,87 %	15.09.2023	116.713	0,01 %
CRH America, Inc.	100.000	5,13 %	18.05.2045	116.706	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	125.000	4,70 %	15.06.2044	116.695	0,01 %
Nationwide Financial Services, Inc.	100.000	5,30 %	18.11.2044	116.665	0,01 %
Wal-Mart Stores, Inc.	100.000	4,30 %	22.04.2044	116.639	0,01 %
LYB International Finance BV	100.000	5,25 %	15.07.2043	116.456	0,01 %
Exelon Generation Co. LLC	100.000	6,25 %	01.10.2039	116.393	0,01 %
Pitney Bowes, Inc.	125.000	3,63 %	01.10.2021	116.298	0,01 %
Keysight Technologies, Inc.	115.000	3,30 %	30.10.2019	116.212	0,01 %
Arch Capital Group US, Inc.	100.000	5,14 %	01.11.2043	115.948	0,01 %
Ally Auto Receivables Trust 2017	117.000	1,96 %	15.07.2022	115.644	0,01 %
State of Illinois	100.000	7,35 %	01.07.2035	115.617	0,01 %
Union Pacific Corp.	115.000	3,00 %	15.04.2027	115.513	0,01 %
Johnson & Johnson	100.000	4,50 %	01.09.2040	115.488	0,01 %
DXC Technology Co.	115.000	2,88 %	27.03.2020	115.458	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	100.000	6,38 %	01.03.2041	115.354	0,01 %
Commonwealth Edison Co.	100.000	4,60 %	15.08.2043	115.286	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Ohio Water Development Authority Water Pollution Control Loan Fund	100.000	4,88 %	01.12.2034	115.236	0,01 %
Baxter International, Inc.	125.000	3,50 %	15.08.2046	115.128	0,01 %
General Dynamics Corp.	110.000	3,88 %	15.07.2021	115.104	0,01 %
ONEOK, Inc.	100.000	6,00 %	15.06.2035	115.052	0,01 %
NYU Hospitals Center	100.000	4,78 %	01.07.2044	114.995	0,01 %
Caterpillar, Inc.	100.000	4,30 %	15.05.2044	114.954	0,01 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	100.000	4,50 %	01.12.2045	114.919	0,01 %
HCP, Inc.	110.000	4,00 %	01.12.2022	114.860	0,01 %
Commonwealth of Massachusetts	100.000	4,50 %	01.08.2031	114.779	0,01 %
Bristol-Myers Squibb Co.	100.000	4,50 %	01.03.2044	114.726	0,01 %
Farmers Exchange Capital II^	100.000	6,15 %	01.11.2053	114.687	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	75.000	8,15 %	17.10.2036	114.477	0,01 %
Southwestern Public Service Co.	100.000	4,50 %	15.08.2041	114.340	0,01 %
RPM International, Inc.	100.000	5,25 %	01.06.2045	114.260	0,01 %
Carlyle Holdings II Finance LLC	100.000	5,63 %	30.03.2043	114.165	0,01 %
Comcast Corp.	100.000	4,75 %	01.03.2044	114.155	0,01 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	100.000	6,65 %	15.01.2037	114.062	0,01 %
Celgene Corp.	110.000	3,95 %	15.10.2020	114.022	0,01 %
South Carolina Electric & Gas Co.	100.000	5,10 %	01.06.2065	114.022	0,01 %
Kansas Development Finance Authority	100.000	4,93 %	15.04.2045	113.962	0,01 %
State of Kansas Department of Transportation	100.000	4,60 %	01.09.2035	113.728	0,01 %
Jefferies Group LLC	100.000	6,25 %	15.01.2036	113.641	0,01 %
South Carolina Electric & Gas Co.	100.000	5,30 %	15.05.2033	113.530	0,01 %
Alameda County Joint Powers Authority	75.000	7,05 %	01.12.2044	112.996	0,01 %
ACE Capital Trust II	75.000	9,70 %	01.04.2030	112.875	0,01 %
Nordstrom, Inc.	100.000	6,95 %	15.03.2028	112.824	0,01 %
Puget Sound Energy, Inc.	100.000	4,30 %	20.05.2045	112.802	0,01 %
Humana, Inc.	100.000	4,80 %	15.03.2047	112.710	0,01 %
Bank of America Corp.	100.000	4,75 %	21.04.2045	112.649	0,01 %
Duke Energy Progress LLC	100.000	4,38 %	30.03.2044	112.648	0,01 %
Ecolab, Inc.	110.000	3,95 %	01.12.2047	112.458	0,01 %
State of Texas	95.000	4,68 %	01.04.2040	112.411	0,01 %
Brown-Forman Corp.	100.000	4,50 %	15.07.2045	112.368	0,01 %
Ohio State University	100.000	4,80 %	01.06.2111	112.325	0,01 %
Nationwide Mutual Insurance Co.	100.000	4,95 %	22.04.2044	112.317	0,01 %
City of Houston TX	95.000	6,29 %	01.03.2032	112.047	0,01 %
Port Authority of New York & New Jersey	100.000	5,31 %	01.08.2046	112.002	0,01 %
JobsOhio Beverage System	100.000	4,53 %	01.01.2035	111.934	0,01 %
Aetna, Inc.	100.000	4,75 %	15.03.2044	111.913	0,01 %
Markel Corp.	100.000	5,00 %	05.04.2046	111.852	0,01 %
American International Group, Inc.	100.000	4,80 %	10.07.2045	111.840	0,01 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	100.000	4,38 %	01.09.2042	111.836	0,01 %
Lockheed Martin Corp.	100.000	4,50 %	15.05.2036	111.817	0,01 %
Huntington Bancshares, Inc.	100.000	7,00 %	15.12.2020	111.663	0,01 %
Harris Corp.	100.000	4,85 %	27.04.2035	111.613	0,01 %
Dallas Independent School District	100.000	6,45 %	15.02.2035	111.587	0,01 %
Trustees of the University of Pennsylvania	100.000	4,67 %	01.09.2112	111.480	0,01 %
Alabama Power Co.	100.000	4,30 %	02.01.2046	111.457	0,01 %
Parker-Hannifin Corp.	100.000	4,45 %	21.11.2044	111.357	0,01 %
Discover Bank	110.000	3,20 %	09.08.2021	111.271	0,01 %
Spirit AeroSystems, Inc.	110.000	3,85 %	15.06.2026	111.203	0,01 %
State of Illinois	100.000	6,73 %	01.04.2035	111.054	0,01 %
Becton Dickinson and Co.	100.000	5,00 %	12.11.2040	110.991	0,01 %
Ingersoll-Rand Luxembourg Finance SA	100.000	4,65 %	01.11.2044	110.915	0,01 %
Danaher Corp.	100.000	4,38 %	15.09.2045	110.900	0,01 %
Mylan, Inc.	111.000	2,55 %	28.03.2019	110.886	0,01 %
Kroger Co.	100.000	5,40 %	15.07.2040	110.664	0,01 %
Travelers Cos, Inc.	100.000	4,30 %	25.08.2045	110.267	0,01 %
Cleco Corporate Holdings LLC	100.000	4,97 %	01.05.2046	110.192	0,01 %
Massachusetts Institute of Technology	100.000	3,96 %	01.07.2038	109.972	0,01 %
Delmarva Power & Light Co.	100.000	4,15 %	15.05.2045	109.820	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	100.000	4,25 %	15.04.2047	109.813	0,01 %
Guardian Life Insurance Co. of America	100.000	4,85 %	24.01.2077	109.812	0,01 %
American International Group, Inc.	100.000	4,70 %	10.07.2035	109.709	0,01 %
Electronic Arts, Inc.	100.000	4,80 %	01.03.2026	109.643	0,01 %
Duke Energy Progress LLC	100.000	4,15 %	01.12.2044	109.540	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Hess Corp.	100.000	6,00 %	15.01.2040	109.540	0,01 %
Fidelity National Financial, Inc.	100.000	5,50 %	01.09.2022	109.452	0,01 %
Los Angeles Department of Water & Power	100.000	6,17 %	01.07.2040	109.429	0,01 %
American Airlines 2015-2 Klasse AA Pass Through Trust	106.832	3,60 %	22.09.2027	109.162	0,01 %
Potomac Electric Power Co.	100.000	4,15 %	15.03.2043	108.991	0,01 %
Enterprise Products Operating LLC	100.000	4,95 %	15.10.2054	108.941	0,01 %
Target Corp.	75.000	7,00 %	15.01.2038	108.941	0,01 %
Dow Chemical Co.	100.000	4,63 %	01.10.2044	108.924	0,01 %
Hyatt Hotels Corp.	100.000	4,85 %	15.03.2026	108.844	0,01 %
Digital Realty Trust LP	100.000	4,75 %	01.10.2025	108.450	0,01 %
Assured Guaranty US Holdings, Inc.	100.000	5,00 %	01.07.2024	108.317	0,01 %
Union Pacific Corp.	100.000	4,15 %	15.01.2045	108.307	0,01 %
CRH America, Inc.	100.000	5,75 %	15.01.2021	108.294	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	100.000	4,25 %	15.03.2043	108.286	0,01 %
Alabama Power Co.	100.000	4,15 %	15.08.2044	108.219	0,01 %
Energy Transfer LP	100.000	6,13 %	15.12.2045	108.215	0,01 %
State of Utah	100.000	4,55 %	01.07.2024	108.183	0,01 %
Boston Properties LP	100.000	5,63 %	15.11.2020	108.131	0,01 %
Humana, Inc.	100.000	4,63 %	01.12.2042	108.090	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	100.000	5,65 %	15.08.2020	108.036	0,01 %
Altria Group, Inc.	100.000	4,50 %	02.05.2043	108.016	0,01 %
PPL Electric Utilities Corp.	100.000	3,95 %	01.06.2047	107.956	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	100.000	4,45 %	15.04.2042	107.761	0,01 %
Johns Hopkins University	100.000	4,08 %	01.07.2053	107.642	0,01 %
Altera Corp.	100.000	4,10 %	15.11.2023	107.408	0,01 %
ONEOK Partners LP	100.000	4,90 %	15.03.2025	107.395	0,01 %
Whirlpool Corp.	100.000	4,70 %	01.06.2022	107.338	0,01 %
Southern California Edison Co.	100.000	4,05 %	15.03.2042	107.330	0,01 %
Principal Financial Group, Inc.	100.000	4,35 %	15.05.2043	107.317	0,01 %
Digital Realty Trust LP	100.000	5,25 %	15.03.2021	107.271	0,01 %
Trimble, Inc.	100.000	4,75 %	01.12.2024	107.266	0,01 %
DTE Electric Co.	100.000	4,00 %	01.04.2043	107.219	0,01 %
Xylem, Inc.	100.000	4,38 %	01.11.2046	107.213	0,01 %
Aetna, Inc.	100.000	4,50 %	15.05.2042	107.195	0,01 %
Old Republic International Corp.	100.000	4,88 %	01.10.2024	107.171	0,01 %
Cardinal Health, Inc.	100.000	4,90 %	15.09.2045	107.055	0,01 %
National Fuel Gas Co.	100.000	5,20 %	15.07.2025	107.036	0,01 %
NiSource Finance Corp.	100.000	5,45 %	15.09.2020	106.924	0,01 %
CVS Health Corp.	100.000	4,75 %	01.12.2022	106.874	0,01 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	125.000	4,50 %	15.12.2034	106.726	0,01 %
AEP Transmission Co. LLC	100.000	4,00 %	01.12.2046	106.704	0,01 %
MidAmerican Energy Co.	100.000	3,95 %	01.08.2047	106.643	0,01 %
University of Southern California	100.000	3,84 %	01.10.2047	106.637	0,01 %
Coca-Cola Bottling Co. Consolidated	105.000	3,80 %	25.11.2025	106.469	0,01 %
CNA Financial Corp.	100.000	4,50 %	01.03.2026	106.454	0,01 %
Acuity Brands Lighting, Inc.	100.000	6,00 %	15.12.2019	106.416	0,01 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	100.000	5,63 %	01.09.2041	106.393	0,01 %
Western Gas Partners LP	100.000	5,45 %	01.04.2044	106.320	0,01 %
Vulcan Materials Co.	100.000	4,50 %	01.04.2025	106.316	0,01 %
Occidental Petroleum Corp.	100.000	4,10 %	15.02.2047	106.291	0,01 %
FedEx Corp.	100.000	4,00 %	15.01.2024	106.250	0,01 %
Dollar General Corp.	100.000	4,15 %	01.11.2025	106.212	0,01 %
Aspen Insurance Holdings Ltd.	100.000	4,65 %	15.11.2023	106.186	0,01 %
Williams Partners LP	100.000	4,90 %	15.01.2045	106.157	0,01 %
JM Smucker Co.	100.000	4,38 %	15.03.2045	106.113	0,01 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.^	100.000	5,25 %	20.04.2046	106.102	0,01 %
Everest Reinsurance Holdings, Inc.	100.000	4,87 %	01.06.2044	106.078	0,01 %
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	100.000	4,50 %	30.07.2029	106.076	0,01 %
Textron, Inc.	100.000	4,30 %	01.03.2024	106.020	0,01 %
Pitney Bowes, Inc.	115.000	4,13 %	15.05.2022	106.007	0,01 %
Boardwalk Pipelines LP	100.000	4,95 %	15.12.2024	105.996	0,01 %
Southern Co. Gas Capital Corp.	100.000	4,40 %	01.06.2043	105.950	0,01 %
Entergy Louisiana LLC	100.000	4,05 %	01.09.2023	105.936	0,01 %
Flowers Foods, Inc.	100.000	4,38 %	01.04.2022	105.910	0,01 %
Magellan Midstream Partners LP	100.000	6,55 %	15.07.2019	105.910	0,01 %
Appalachian Power Co.	100.000	4,60 %	30.03.2021	105.905	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Massachusetts Mutual Life Insurance Co.	100.000	4,50 %	15.04.2065	105.853	0,01 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	100.000	4,25 %	17.01.2023	105.830	0,01 %
Bio-Rad Laboratories, Inc.	100.000	4,88 %	15.12.2020	105.779	0,01 %
Prudential Financial, Inc.	75.000	6,63 %	21.06.2040	105.777	0,01 %
Southern Co.^	100.000	5,50 %	15.03.2057	105.750	0,01 %
Consumers Energy Co.	100.000	3,95 %	15.05.2043	105.722	0,01 %
Boeing Co.	100.000	4,88 %	15.02.2020	105.630	0,01 %
Masco Corp.	100.000	4,38 %	01.04.2026	105.595	0,01 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	100.000	4,38 %	15.02.2021	105.541	0,01 %
Hospitality Properties Trust	100.000	4,95 %	15.02.2027	105.438	0,01 %
Kimberly-Clark Corp.	100.000	3,90 %	04.05.2047	105.334	0,01 %
Cadence Design Systems, Inc.	100.000	4,38 %	15.10.2024	105.272	0,01 %
Southern Power Co.	100.000	4,15 %	01.12.2025	105.272	0,01 %
Southern California Edison Co.	100.000	3,90 %	15.03.2043	105.215	0,01 %
CRH America Finance, Inc.	100.000	4,40 %	09.05.2047	105.208	0,01 %
Autodesk, Inc.	100.000	4,38 %	15.06.2025	105.194	0,01 %
TECO Finance, Inc.	100.000	5,15 %	15.03.2020	105.175	0,01 %
McCormick & Co., Inc.	100.000	4,20 %	15.08.2047	105.170	0,01 %
Crown Castle International Corp.	100.000	4,75 %	15.05.2047	105.160	0,01 %
CBS Corp. ¹	100.000	4,85 %	01.07.2042	105.113	0,01 %
DDR Corp.	100.000	4,63 %	15.07.2022	105.042	0,01 %
Nucor Corp.	100.000	4,00 %	01.08.2023	104.970	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	100.000	4,00 %	01.10.2023	104.942	0,01 %
Progress Energy, Inc.	75.000	7,75 %	01.03.2031	104.932	0,01 %
Archer-Daniels-Midland Co.	100.000	4,02 %	16.04.2043	104.924	0,01 %
Discovery Communications LLC	100.000	5,63 %	15.08.2019	104.913	0,01 %
San Diego Gas & Electric Co.	100.000	3,75 %	01.06.2047	104.873	0,01 %
Duke Energy Corp.	100.000	3,95 %	15.10.2023	104.818	0,01 %
Hershey Co.	100.000	4,13 %	01.12.2020	104.766	0,01 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015	100.000	3,82 %	15.07.2048	104.760	0,01 %
General Motors Financial Co., Inc.	100.000	4,38 %	25.09.2021	104.732	0,01 %
Brown & Brown, Inc.	100.000	4,20 %	15.09.2024	104.726	0,01 %
Johnson Controls International plc	100.000	4,25 %	01.03.2021	104.711	0,01 %
UIL Holdings Corp.	100.000	4,63 %	01.10.2020	104.707	0,01 %
Hasbro, Inc.	100.000	5,10 %	15.05.2044	104.704	0,01 %
EnLink Midstream Partners LP	100.000	4,85 %	15.07.2026	104.693	0,01 %
Boston Scientific Corp.	100.000	4,13 %	01.10.2023	104.683	0,01 %
Chicago O'Hare International Airport	75.000	6,40 %	01.01.2040	104.683	0,01 %
South Carolina Electric & Gas Co.	100.000	4,35 %	01.02.2042	104.682	0,01 %
Domtar Corp.	100.000	4,40 %	01.04.2022	104.664	0,01 %
Highmark, Inc.	100.000	4,75 %	15.05.2021	104.663	0,01 %
Emerson Electric Co.	100.000	4,88 %	15.10.2019	104.662	0,01 %
QVC, Inc.	100.000	4,85 %	01.04.2024	104.625	0,01 %
CSAIL 2015-C4 Commercial Mortgage Trust	100.000	3,81 %	15.11.2048	104.597	0,01 %
Union Pacific Corp.	100.000	4,00 %	01.02.2021	104.583	0,01 %
WP Carey, Inc.	100.000	4,60 %	01.04.2024	104.549	0,01 %
Raytheon Co.	100.000	4,40 %	15.02.2020	104.547	0,01 %
Duke Energy Florida LLC	100.000	3,85 %	15.11.2042	104.523	0,01 %
Expedia, Inc.	100.000	4,50 %	15.08.2024	104.448	0,01 %
Indianapolis Power & Light Co.	100.000	4,05 %	01.05.2046	104.421	0,01 %
Welltower, Inc.	100.000	4,25 %	01.04.2026	104.419	0,01 %
Dollar General Corp.	100.000	3,88 %	15.04.2027	104.363	0,01 %
Realty Income Corp.	100.000	4,13 %	15.10.2026	104.345	0,01 %
Amphenol Corp.	100.000	4,00 %	01.02.2022	104.338	0,01 %
Home Depot, Inc.	100.000	3,95 %	15.09.2020	104.296	0,01 %
University of Virginia	100.000	4,18 %	01.09.2117	104.282	0,01 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	100.000	4,20 %	01.04.2027	104.243	0,01 %
State of Utah	100.000	3,54 %	01.07.2025	104.235	0,01 %
Textron, Inc.	100.000	4,00 %	15.03.2026	104.226	0,01 %
Partners Healthcare System, Inc.	100.000	4,12 %	01.07.2055	104.181	0,01 %
Simon Property Group LP	100.000	3,75 %	01.02.2024	104.168	0,01 %
ONEOK, Inc.	100.000	4,95 %	13.07.2047	104.071	0,01 %
Lam Research Corp.	100.000	3,80 %	15.03.2025	104.060	0,01 %
American Campus Communities Operating Partnership LP	100.000	4,13 %	01.07.2024	104.048	0,01 %
Simon Property Group LP	75.000	6,75 %	01.02.2040	104.042	0,01 %
Harman International Industries, Inc.	100.000	4,15 %	15.05.2025	104.024	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
State of Wisconsin	100.000	3,95 %	01.05.2036	104.005	0,01 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	100.000	3,80 %	30.09.2047	103.931	0,01 %
Ameriprise Financial, Inc.	100.000	3,70 %	15.10.2024	103.925	0,01 %
South Carolina Electric & Gas Co.	100.000	4,50 %	01.06.2064	103.925	0,01 %
Virginia Electric & Power Co.	100.000	5,00 %	30.06.2019	103.887	0,01 %
Southern California Gas Co.	100.000	3,75 %	15.09.2042	103.876	0,01 %
Colonial Pipeline Co.	100.000	3,75 %	01.10.2025	103.781	0,01 %
CCRE2 Commercial Mortgage Trust 2012	101.000	3,79 %	15.08.2045	103.740	0,01 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. ^	100.000	4,75 %	30.04.2043	103.686	0,01 %
Agilent Technologies, Inc.	100.000	3,88 %	15.07.2023	103.682	0,01 %
Textron, Inc.	100.000	3,88 %	01.03.2025	103.673	0,01 %
Welltower, Inc.	100.000	3,75 %	15.03.2023	103.658	0,01 %
Eversource Energy	100.000	4,50 %	15.11.2019	103.654	0,01 %
Lockheed Martin Corp.	99.000	4,09 %	15.09.2052	103.645	0,01 %
Public Service Co. of Colorado	100.000	5,13 %	01.06.2019	103.639	0,01 %
Union Electric Co.	100.000	3,50 %	15.04.2024	103.628	0,01 %
Air Lease Corp.	100.000	3,88 %	01.04.2021	103.577	0,01 %
Waste Management, Inc.	100.000	3,50 %	15.05.2024	103.555	0,01 %
McDonald's Corp.	100.000	3,63 %	20.05.2021	103.542	0,01 %
Precision Castparts Corp.	100.000	3,90 %	15.01.2043	103.524	0,01 %
Energy Transfer LP/Regency Energy Finance Corp.	100.000	4,50 %	01.11.2023	103.500	0,01 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017^	100.000	4,06 %	15.12.2050	103.471	0,01 %
CenterPoint Energy Resources Corp.	99.000	4,50 %	15.01.2021	103.465	0,01 %
Boston Scientific Corp.	75.000	7,38 %	15.01.2040	103.454	0,01 %
Bank of America Corp.	100.000	5,49 %	15.03.2019	103.420	0,01 %
Constellation Brands, Inc.	100.000	3,75 %	01.05.2021	103.399	0,01 %
Air Products & Chemicals, Inc.	100.000	4,38 %	21.08.2019	103.398	0,01 %
Board of Trustees of The Leland Stanford Junior University	100.000	4,75 %	01.05.2019	103.392	0,01 %
Tampa Electric Co.	100.000	4,10 %	15.06.2042	103.392	0,01 %
Invesco Finance plc	100.000	3,75 %	15.01.2026	103.334	0,01 %
Danaher Corp.	100.000	3,35 %	15.09.2025	103.331	0,01 %
Broadridge Financial Solutions, Inc.	100.000	3,95 %	01.09.2020	103.293	0,01 %
Roper Technologies, Inc.	100.000	3,85 %	15.12.2025	103.290	0,01 %
Athene Global Funding	100.000	4,00 %	25.01.2022	103.197	0,01 %
Delmarva Power & Light Co.	100.000	3,50 %	15.11.2023	103.187	0,01 %
John Deere Capital Corp.	100.000	3,40 %	11.09.2025	103.111	0,01 %
Roper Technologies, Inc.	100.000	3,80 %	15.12.2026	103.106	0,01 %
General Electric Co.	100.000	3,45 %	15.05.2024	103.089	0,01 %
UnitedHealth Group, Inc.	100.000	3,38 %	15.11.2021	103.075	0,01 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017	100.000	3,54 %	15.11.2052	103.071	0,01 %
First American Financial Corp.	100.000	4,60 %	15.11.2024	103.055	0,01 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015	100.000	3,53 %	15.10.2048	102.986	0,01 %
Black Hills Corp.	100.000	4,20 %	15.09.2046	102.979	0,01 %
Consumers Energy Co.	100.000	3,38 %	15.08.2023	102.943	0,01 %
FMC Corp.	100.000	4,10 %	01.02.2024	102.901	0,01 %
McDonald's Corp.	100.000	5,00 %	01.02.2019	102.885	0,01 %
Tyco Electronics Group SA	100.000	3,50 %	03.02.2022	102.858	0,01 %
Nordstrom, Inc.	100.000	4,00 %	15.10.2021	102.845	0,01 %
Florida Power & Light Co.	100.000	3,25 %	01.06.2024	102.774	0,01 %
Clorox Co.	100.000	3,50 %	15.12.2024	102.770	0,01 %
Kimco Realty Corp.	100.000	4,45 %	01.09.2047	102.770	0,01 %
BorgWarner, Inc.	100.000	4,38 %	15.03.2045	102.763	0,01 %
DTE Electric Co.	100.000	3,38 %	01.03.2025	102.759	0,01 %
Praxair, Inc.	100.000	3,20 %	30.01.2026	102.693	0,01 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013	100.000	3,34 %	15.06.2046	102.663	0,01 %
UDR, Inc.	100.000	3,70 %	01.10.2020	102.655	0,01 %
EOG Resources, Inc.	100.000	3,90 %	01.04.2035	102.616	0,01 %
American Campus Communities Operating Partnership LP	100.000	3,75 %	15.04.2023	102.578	0,01 %
George Washington University	100.000	3,49 %	15.09.2022	102.574	0,01 %
Whirlpool Corp.	100.000	3,70 %	01.05.2025	102.552	0,01 %
Newell Brands Inc.	100.000	3,90 %	01.11.2025	102.546	0,01 %
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017	100.000	3,41 %	15.10.2050	102.521	0,01 %
People's United Financial, Inc.	100.000	3,65 %	06.12.2022	102.500	0,01 %
American Airlines 2017-1 Klasse AA Pass Through Trust	100.000	3,65 %	15.02.2029	102.493	0,01 %
Southwestern Electric Power Co.	100.000	3,90 %	01.04.2045	102.477	0,01 %
ERAC USA Finance LLC	100.000	4,50 %	15.02.2045	102.447	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Packaging Corp. of America	100.000	3,65 %	15.09.2024	102.421	0,01 %
National Retail Properties, Inc.	100.000	4,00 %	15.11.2025	102.409	0,01 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014	100.000	3,41 %	15.12.2047	102.389	0,01 %
Arch Capital Group Ltd.	75.000	7,35 %	01.05.2034	102.343	0,01 %
Pacific Gas & Electric Co.	100.000	4,00 %	01.12.2046	102.335	0,01 %
Flowserve Corp.	100.000	4,00 %	15.11.2023	102.283	0,01 %
21st Century Fox America, Inc.	100.000	3,38 %	15.11.2026	102.237	0,01 %
CCRE23 Commercial Mortgage Trust 2015	100.000	3,50 %	10.05.2048	102.224	0,01 %
JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017	100.000	3,74 %	15.07.2050	102.222	0,01 %
Parker-Hannifin Corp.	100.000	3,30 %	21.11.2024	102.199	0,01 %
Assurant, Inc.	100.000	4,00 %	15.03.2023	102.188	0,01 %
Baxalta, Inc.	100.000	3,60 %	23.06.2022	102.179	0,01 %
CA, Inc.	100.000	3,60 %	01.08.2020	102.152	0,01 %
Johnson & Johnson	100.000	2,95 %	01.09.2020	102.138	0,01 %
Aetna, Inc.	75.000	6,75 %	15.12.2037	102.112	0,01 %
Colgate-Palmolive Co.	100.000	3,70 %	01.08.2047	102.107	0,01 %
Masco Corp.	100.000	4,50 %	15.05.2047	102.081	0,01 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013	100.000	3,13 %	15.12.2048	102.056	0,01 %
Hyatt Hotels Corp.	100.000	3,38 %	15.07.2023	102.028	0,01 %
EPR Properties	100.000	4,50 %	01.04.2025	102.011	0,01 %
Lazard Group LLC	100.000	3,75 %	13.02.2025	101.974	0,01 %
Norfolk Southern Corp.	100.000	3,25 %	01.12.2021	101.972	0,01 %
Mylan NV	100.000	3,75 %	15.12.2020	101.934	0,01 %
Kemper Corp.	100.000	4,35 %	15.02.2025	101.931	0,01 %
Merck & Co., Inc.	100.000	3,60 %	15.09.2042	101.911	0,01 %
Macy's Retail Holdings, Inc.	100.000	6,38 %	15.03.2037	101.901	0,01 %
Bank 2018-BNK ³	100.000	3,39 %	15.06.2060	101.878	0,01 %
Appalachian Power Co.	100.000	3,40 %	01.06.2025	101.875	0,01 %
Enable Midstream Partners LP	100.000	4,40 %	15.03.2027	101.856	0,01 %
Ventas Realty LP	100.000	3,85 %	01.04.2027	101.833	0,01 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2012	100.000	3,18 %	15.08.2045	101.831	0,01 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	100.000	3,00 %	15.05.2022	101.827	0,01 %
Eaton Vance Corp.	100.000	3,50 %	06.04.2027	101.825	0,01 %
Exelon Generation Co. LLC	100.000	3,40 %	15.03.2022	101.823	0,01 %
Neuberger Berman Group LLC/Neuberger Berman Finance Corp.	100.000	4,88 %	15.04.2045	101.812	0,01 %
Kohl's Corp.	100.000	4,25 %	17.07.2025	101.778	0,00 %
Wyndham Worldwide Corp.	100.000	4,50 %	01.04.2027	101.778	0,01 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	100.000	2,88 %	23.01.2023	101.747	0,00 %
DDR Corp.	100.000	4,25 %	01.02.2026	101.747	0,00 %
Wyndham Worldwide Corp.	100.000	4,25 %	01.03.2022	101.733	0,00 %
Physicians Realty LP	100.000	4,30 %	15.03.2027	101.711	0,00 %
New York City Water & Sewer System	75.000	5,72 %	15.06.2042	101.657	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015	100.000	3,31 %	15.04.2048	101.656	0,00 %
People's United Bank NA	100.000	4,00 %	15.07.2024	101.646	0,00 %
Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri	100.000	3,65 %	15.08.2057	101.635	0,00 %
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust 2013	100.000	3,24 %	10.04.2046	101.623	0,00 %
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	100.000	3,38 %	01.02.2022	101.602	0,00 %
Express Scripts Holding Co.	100.000	3,30 %	25.02.2021	101.539	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	100.000	3,00 %	25.12.2025	101.510	0,00 %
Xcel Energy, Inc.	100.000	3,35 %	01.12.2026	101.507	0,00 %
ERP Operating LP	100.000	4,00 %	01.08.2047	101.501	0,00 %
Wisconsin Power & Light Co.	75.000	6,38 %	15.08.2037	101.485	0,00 %
Xcel Energy, Inc.	100.000	3,30 %	01.06.2025	101.483	0,00 %
Marriott International, Inc.	100.000	3,25 %	15.09.2022	101.460	0,00 %
Boardwalk Pipelines LP	100.000	4,45 %	15.07.2027	101.440	0,00 %
Boston Scientific Corp.	100.000	3,38 %	15.05.2022	101.420	0,00 %
American Electric Power Co., Inc.	100.000	2,95 %	15.12.2022	101.407	0,00 %
State of Wisconsin	100.000	3,15 %	01.05.2027	101.398	0,00 %
JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017	100.000	3,05 %	15.07.2050	101.371	0,00 %
Dover Corp.	100.000	3,15 %	15.11.2025	101.361	0,00 %
CCRE6 Commercial Mortgage Trust 2013	100.000	3,10 %	10.03.2046	101.353	0,00 %
JB Hunt Transport Services, Inc.	100.000	3,30 %	15.08.2022	101.348	0,00 %
Pacific Gas & Electric Co.	100.000	3,40 %	15.08.2024	101.334	0,00 %
WP Carey, Inc.	100.000	4,00 %	01.02.2025	101.325	0,00 %
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust 2013	100.000	3,18 %	10.03.2046	101.323	0,00 %
Mercury General Corp.	100.000	4,40 %	15.03.2027	101.321	0,00 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Mutual of Omaha Insurance Co.^	100.000	4,30 %	15.07.2054	101.321	0,00 %
FedEx Corp.	100.000	3,20 %	01.02.2025	101.301	0,00 %
Northrop Grumman Corp.	100.000	3,85 %	15.04.2045	101.297	0,00 %
Marathon Petroleum Corp.	100.000	5,00 %	15.09.2054	101.284	0,00 %
Host Hotels & Resorts LP	100.000	3,88 %	01.04.2024	101.276	0,00 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017^	100.000	3,74 %	15.08.2050	101.229	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015	100.000	3,23 %	15.10.2048	101.217	0,00 %
Scripps Networks Interactive, Inc.	100.000	3,50 %	15.06.2022	101.215	0,00 %
Teachers Insurance & Annuity Association of America^	100.000	4,38 %	15.09.2054	101.215	0,00 %
FedEx Corp.	100.000	3,90 %	01.02.2035	101.205	0,00 %
3M Co.	100.000	3,00 %	07.08.2025	101.191	0,00 %
Select Income	100.000	4,15 %	01.02.2022	101.177	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	100.000	3,34 %	28.03.2022	101.168	0,00 %
Emerson Electric Co.	100.000	3,15 %	01.06.2025	101.158	0,00 %
Walgreen Co.	100.000	4,40 %	15.09.2042	101.145	0,00 %
Andeavor	100.000	4,50 %	01.04.2048	101.102	0,00 %
Oracle Corp.	100.000	3,25 %	15.05.2030	101.072	0,00 %
Perrigo Finance Unlimited Co.	100.000	3,90 %	15.12.2024	101.065	0,00 %
Union Pacific Corp.	100.000	3,80 %	01.10.2051	101.060	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015	100.000	2,92 %	15.05.2048	101.054	0,00 %
Maxim Integrated Products, Inc.	100.000	3,38 %	15.03.2023	101.046	0,00 %
Hubbell, Inc.	100.000	3,35 %	01.03.2026	101.035	0,00 %
Energy Transfer LP	95.000	6,05 %	01.06.2041	101.006	0,00 %
Andeavor Logistics LP/Tesoro Logistics Finance Corp.	100.000	4,25 %	01.12.2027	101.000	0,00 %
Concho Resources, Inc.	100.000	3,75 %	01.10.2027	101.000	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	100.000	3,66 %	08.09.2024	100.999	0,00 %
University of Notre Dame du Lac	100.000	3,44 %	15.02.2045	100.947	0,00 %
Magellan Midstream Partners LP	100.000	4,20 %	03.10.2047	100.943	0,00 %
Dr Pepper Snapple Group, Inc.	100.000	3,40 %	15.11.2025	100.931	0,00 %
FedEx Corp.	100.000	4,10 %	01.02.2045	100.927	0,00 %
Consumers Energy Co.	100.000	2,85 %	15.05.2022	100.922	0,00 %
Johnson & Johnson	100.000	2,45 %	05.12.2021	100.916	0,00 %
Fortune Brands Home & Security, Inc.	100.000	3,00 %	15.06.2020	100.898	0,00 %
Kimco Realty Corp.	100.000	3,80 %	01.04.2027	100.816	0,00 %
DBJPM 17-C6 Mortgage Trust^	100.000	3,56 %	10.06.2050	100.806	0,00 %
Bristol-Myers Squibb Co.	105.000	3,25 %	01.08.2042	100.800	0,00 %
Kennametal, Inc.	100.000	3,88 %	15.02.2022	100.794	0,00 %
Motorola Solutions, Inc.	100.000	5,50 %	01.09.2044	100.786	0,00 %
DDR Corp.	100.000	3,90 %	15.08.2024	100.784	0,00 %
Federal National Mortgage Association^	100.000	3,09 %	25.04.2027	100.728	0,00 %
Agilent Technologies, Inc.	100.000	3,20 %	01.10.2022	100.722	0,00 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013	100.000	3,42 %	10.04.2046	100.712	0,00 %
Marriott International, Inc.	100.000	2,88 %	01.03.2021	100.692	0,00 %
AvalonBay Communities, Inc.	100.000	3,35 %	15.05.2027	100.683	0,00 %
Boeing Co.	100.000	2,85 %	30.10.2024	100.651	0,00 %
Starbucks Corp.	100.000	2,70 %	15.06.2022	100.649	0,00 %
Cintas Corp. No 2	100.000	2,90 %	01.04.2022	100.616	0,00 %
RWJ Barnabas Health, Inc.	100.000	3,95 %	01.07.2046	100.602	0,00 %
Discover Financial Services	100.000	3,75 %	04.03.2025	100.594	0,00 %
University of Notre Dame du Lac	100.000	3,39 %	15.02.2048	100.572	0,00 %
CSX Corp.	100.000	4,25 %	01.11.2066	100.547	0,00 %
Carlisle Cos, Inc.	100.000	3,50 %	01.12.2024	100.545	0,00 %
Flowserve Corp.	100.000	3,50 %	15.09.2022	100.537	0,00 %
Ingersoll-Rand Global Holding Co., Ltd.	100.000	2,88 %	15.01.2019	100.519	0,00 %
QVC, Inc.	100.000	3,13 %	01.04.2019	100.486	0,00 %
Eversource Energy	100.000	3,15 %	15.01.2025	100.474	0,00 %
Boeing Co.	100.000	3,65 %	01.03.2047	100.467	0,00 %
Southern California Edison Co.	100.000	3,60 %	01.02.2045	100.451	0,00 %
Praxair, Inc.	100.000	3,55 %	07.11.2042	100.429	0,00 %
Ralph Lauren Corp.	100.000	2,63 %	18.08.2020	100.418	0,00 %
Union Pacific Corp.	100.000	3,38 %	01.02.2035	100.409	0,00 %
Timken Co.	100.000	3,88 %	01.09.2024	100.408	0,00 %
Dignity Health	100.000	3,13 %	01.11.2022	100.400	0,00 %
Senior Housing Properties Trust	100.000	3,25 %	01.05.2019	100.394	0,00 %
SunTrust Banks, Inc.	100.000	2,50 %	01.05.2019	100.386	0,00 %
New York Life Global Funding	100.000	2,90 %	17.01.2024	100.330	0,00 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sherwin-Williams Co.	100.000	3,13 %	01.06.2024	100.290	0,00 %
Ameren Illinois Co.	100.000	2,70 %	01.09.2022	100.283	0,00 %
Andeavor	100.000	3,80 %	01.04.2028	100.219	0,00 %
Walt Disney Co.	100.000	2,55 %	15.02.2022	100.214	0,00 %
Packaging Corp. of America	100.000	3,40 %	15.12.2027	100.213	0,00 %
EQT Midstream Partners LP	100.000	4,00 %	01.08.2024	100.201	0,00 %
NIKE, Inc.	100.000	3,63 %	01.05.2043	100.191	0,00 %
Deere & Co.	100.000	2,60 %	08.06.2022	100.188	0,00 %
Hess Corp.	100.000	4,30 %	01.04.2027	100.188	0,00 %
Pricoa Global Funding I	100.000	2,55 %	24.11.2020	100.168	0,00 %
Arizona Public Service Co.	100.000	3,15 %	15.05.2025	100.165	0,00 %
John Deere Capital Corp.	100.000	2,38 %	14.07.2020	100.161	0,00 %
Humana, Inc.	100.000	2,63 %	01.10.2019	100.154	0,00 %
JM Smucker Co.	100.000	2,50 %	15.03.2020	100.150	0,00 %
Lam Research Corp.	100.000	2,75 %	15.03.2020	100.149	0,00 %
Packaging Corp. of America	100.000	2,45 %	15.12.2020	100.144	0,00 %
Church & Dwight Co., Inc.	100.000	3,95 %	01.08.2047	100.106	0,00 %
CenterPoint Energy Houston Electric LLC	100.000	3,55 %	01.08.2042	100.100	0,00 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	100.000	2,15 %	14.12.2018	100.090	0,00 %
PG&E Corp.	100.000	2,40 %	01.03.2019	100.075	0,00 %
National Retail Properties, Inc.	100.000	3,30 %	15.04.2023	100.071	0,00 %
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	100.000	2,40 %	15.09.2019	100.060	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	100.000	2,22 %	25.12.2018	100.053	0,00 %
Ingersoll-Rand Luxembourg Finance SA	100.000	2,63 %	01.05.2020	100.047	0,00 %
Athene Global Funding	100.000	2,75 %	20.04.2020	100.044	0,00 %
UDR, Inc.	100.000	3,50 %	01.07.2027	100.044	0,00 %
Clorox Co.	100.000	3,10 %	01.10.2027	100.043	0,00 %
Autodesk, Inc.	100.000	3,13 %	15.06.2020	100.036	0,00 %
Citizens Bank NA	100.000	2,45 %	04.12.2019	100.029	0,00 %
Capital One Na	100.000	2,40 %	05.09.2019	100.025	0,00 %
PNC Bank NA	100.000	2,20 %	28.01.2019	99.987	0,00 %
Federal National Mortgage Association	100.000	2,72 %	25.10.2024	99.951	0,00 %
Dominion Energy Gas Holdings LLC	100.000	2,50 %	15.12.2019	99.937	0,00 %
Synchrony Credit Card Master Note Trust 2015	100.000	1,60 %	15.04.2021	99.937	0,00 %
Camden Property Trust	100.000	2,95 %	15.12.2022	99.932	0,00 %
Ventas Realty LP	100.000	3,10 %	15.01.2023	99.930	0,00 %
Barclays Dryrock Issuance Trust 2015	100.000	1,56 %	15.03.2021	99.921	0,00 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	100.000	1,60 %	17.05.2021	99.920	0,00 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	100.000	2,30 %	01.11.2020	99.920	0,00 %
Dignity Health	100.000	2,64 %	01.11.2019	99.916	0,00 %
Laboratory Corp. of America Holdings	100.000	3,25 %	01.09.2024	99.911	0,00 %
Ryder System, Inc.	100.000	2,50 %	11.05.2020	99.910	0,00 %
AIG Global Funding	100.000	2,70 %	15.12.2021	99.907	0,00 %
Public Service Electric & Gas Co.	100.000	3,00 %	15.05.2025	99.903	0,00 %
eBay, Inc.	100.000	2,20 %	01.08.2019	99.902	0,00 %
Cleveland Electric Illuminating Co.	100.000	3,50 %	01.04.2028	99.873	0,00 %
JM Smucker Co.	100.000	2,20 %	06.12.2019	99.863	0,00 %
Air Lease Corp.	100.000	3,63 %	01.12.2027	99.835	0,00 %
Sales Tax Securitization Corp.	100.000	3,59 %	01.01.2043	99.833	0,00 %
Huntington National Bank	100.000	2,40 %	01.04.2020	99.827	0,00 %
Scripps Networks Interactive, Inc.	100.000	2,80 %	15.06.2020	99.814	0,00 %
Kimco Realty Corp.	100.000	3,13 %	01.06.2023	99.802	0,00 %
Phillips 66 Partners LP	100.000	2,65 %	15.02.2020	99.788	0,00 %
Ryder System, Inc.	100.000	2,80 %	01.03.2022	99.785	0,00 %
Sherwin-Williams Co.	100.000	4,00 %	15.12.2042	99.783	0,00 %
Eversource Energy	100.000	2,75 %	15.03.2022	99.782	0,00 %
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	100.000	4,45 %	15.08.2045	99.779	0,00 %
Walt Disney Co.	100.000	1,65 %	08.01.2019	99.777	0,00 %
Corning, Inc.	100.000	2,90 %	15.05.2022	99.735	0,00 %
Kilroy Realty LP	100.000	3,45 %	15.12.2024	99.726	0,00 %
Becton Dickinson and Co.	100.000	3,00 %	15.05.2026	99.724	0,00 %
Dominion Energy, Inc.	100.000	1,88 %	15.01.2019	99.717	0,00 %
Chevron Corp.	100.000	1,69 %	28.02.2019	99.662	0,00 %
McDonald's Corp.	100.000	1,88 %	29.05.2019	99.658	0,00 %
Regency Centers LP	100.000	3,60 %	01.02.2027	99.657	0,00 %
Sherwin-Williams Co.	100.000	2,75 %	01.06.2022	99.650	0,00 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Phillips 66 Partners LP	100.000	3,75 %	01.03.2028	99.627	0,00 %
UDR, Inc.	100.000	3,50 %	15.01.2028	99.623	0,00 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	100.000	3,05 %	25.04.2027	99.592	0,00 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	100.000	1,65 %	08.02.2019	99.590	0,00 %
SL Green Operating Partnership LP	100.000	3,25 %	15.10.2022	99.581	0,00 %
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	100.000	2,40 %	15.06.2020	99.577	0,00 %
Healthcare Trust of America Holdings LP	100.000	2,95 %	01.07.2022	99.572	0,00 %
State of Oregon	90.687	5,76 %	01.06.2023	99.572	0,00 %
Federal Home Loan Mortgage Corp.	100.000	2,36 %	25.07.2022	99.571	0,00 %
Rochester Gas & Electric Corp.	100.000	3,10 %	01.06.2027	99.558	0,00 %
Georgia-Pacific LLC	75.000	7,25 %	01.06.2028	99.557	0,00 %
Anthem, Inc.	100.000	2,25 %	15.08.2019	99.553	0,00 %
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	100.000	2,00 %	27.01.2020	99.539	0,00 %
American Electric Power Co., Inc.	100.000	2,15 %	13.11.2020	99.534	0,00 %
Duquesne Light Holdings, Inc.	100.000	3,62 %	01.08.2027	99.529	0,00 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	100.000	2,05 %	15.08.2023	99.527	0,00 %
Monsanto Co.	100.000	2,13 %	15.07.2019	99.524	0,00 %
AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2016	100.000	1,46 %	10.05.2021	99.523	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2017	100.000	2,11 %	17.10.2022	99.493	0,00 %
Pinnacle West Capital Corp.	100.000	2,25 %	30.11.2020	99.472	0,00 %
US Airways 2013-1 Klasse A Pass Through Trust	96.586	3,95 %	15.11.2025	99.472	0,00 %
Citibank Credit Card Issuance Trust	100.000	1,80 %	20.09.2021	99.469	0,00 %
AmerisourceBergen Corp.	100.000	4,25 %	01.03.2045	99.456	0,00 %
Kimco Realty Corp.	100.000	4,25 %	01.04.2045	99.455	0,00 %
Amphenol Corp.	100.000	2,20 %	01.04.2020	99.436	0,00 %
Southern Co.	100.000	2,15 %	01.09.2019	99.428	0,00 %
CSX Corp.	100.000	3,80 %	01.11.2046	99.419	0,00 %
EOG Resources, Inc.	100.000	3,15 %	01.04.2025	99.391	0,00 %
AvalonBay Communities, Inc.	100.000	3,20 %	15.01.2028	99.368	0,00 %
Chevron Corp.	100.000	1,99 %	03.03.2020	99.351	0,00 %
NiSource Finance Corp.	100.000	2,65 %	17.11.2022	99.344	0,00 %
Public Storage	100.000	3,09 %	15.09.2027	99.330	0,00 %
Cigna Corp.	100.000	3,25 %	15.04.2025	99.327	0,00 %
National Fuel Gas Co.	100.000	3,95 %	15.09.2027	99.324	0,00 %
DDR Corp.	100.000	3,38 %	15.05.2023	99.319	0,00 %
Mosaic Co.	100.000	4,88 %	15.11.2041	99.314	0,00 %
Exelon Corp.	100.000	2,45 %	15.04.2021	99.296	0,00 %
Toyota Auto Receivables 2016	100.000	1,14 %	17.08.2020	99.284	0,00 %
NIKE, Inc.	100.000	2,25 %	01.05.2023	99.279	0,00 %
Sysco Corp.	100.000	2,60 %	12.06.2022	99.274	0,00 %
ERAC USA Finance LLC	100.000	3,30 %	01.12.2026	99.201	0,00 %
Brixmor Operating Partnership LP	100.000	3,65 %	15.06.2024	99.179	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2016	100.000	1,39 %	17.05.2021	99.173	0,00 %
Boeing Co.	100.000	2,13 %	01.03.2022	99.172	0,00 %
Analog Devices, Inc.	100.000	2,50 %	05.12.2021	99.168	0,00 %
Rockwell Automation, Inc.	100.000	2,05 %	01.03.2020	99.164	0,00 %
EQT Corp.	100.000	3,90 %	01.10.2027	99.160	0,00 %
Coca-Cola Co.	100.000	1,38 %	30.05.2019	99.159	0,00 %
Kohl's Corp.	100.000	3,25 %	01.02.2023	99.144	0,00 %
PepsiCo, Inc.	100.000	2,00 %	15.04.2021	99.103	0,00 %
Wyndham Worldwide Corp.	100.000	3,90 %	01.03.2023	99.098	0,00 %
3M Co.	100.000	2,25 %	15.03.2023	99.091	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	100.000	1,95 %	15.10.2020	99.086	0,00 %
Consolidated Edison, Inc.	100.000	2,00 %	15.03.2020	99.064	0,00 %
Tapestry Inc.	100.000	3,00 %	15.07.2022	99.058	0,00 %
Physicians Realty LP	100.000	3,95 %	15.01.2028	99.056	0,00 %
Southern Power Co.	100.000	2,50 %	15.12.2021	99.052	0,00 %
NetApp, Inc.	100.000	3,30 %	29.09.2024	99.016	0,00 %
PACCAR Financial Corp.	100.000	2,05 %	13.11.2020	98.985	0,00 %
American Electric Power Co., Inc.	100.000	3,20 %	13.11.2027	98.958	0,00 %
Los Angeles Department of Water & Power	75.000	5,72 %	01.07.2039	98.954	0,00 %
Capital One Multi-Asset Execution Trust	100.000	1,34 %	15.04.2022	98.946	0,00 %
PECO Energy Co.	100.000	2,38 %	15.09.2022	98.945	0,00 %
Great-West Life & Annuity Insurance Capital LP II^	100.000	3,96 %	16.05.2046	98.920	0,00 %
Phillips 66 Partners LP	100.000	3,55 %	01.10.2026	98.851	0,00 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	100.000	5,30 %	01.04.2044	98.829	0,00 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Buckeye Partners LP	100.000	4,13 %	01.12.2027	98.825	0,00 %
Energy Transfer LP	100.000	4,20 %	15.04.2027	98.825	0,00 %
Brixmor Operating Partnership LP	100.000	3,90 %	15.03.2027	98.819	0,00 %
Church & Dwight Co., Inc.	100.000	2,45 %	01.08.2022	98.782	0,00 %
Guardian Life Global Funding	100.000	2,50 %	08.05.2022	98.719	0,00 %
EQT Corp.	100.000	3,00 %	01.10.2022	98.669	0,00 %
Federal National Mortgage Association	100.000	2,98 %	25.08.2029	98.668	0,00 %
Monsanto Co.	100.000	3,95 %	15.04.2045	98.617	0,00 %
Dignity Health	100.000	4,50 %	01.11.2042	98.614	0,00 %
San Jose Redevelopment Agency Successor Agency	100.000	3,38 %	01.08.2034	98.520	0,00 %
Visa, Inc.	100.000	2,15 %	15.09.2022	98.435	0,00 %
Church & Dwight Co., Inc.	100.000	3,15 %	01.08.2027	98.416	0,00 %
Consolidated Edison, Inc.	100.000	2,00 %	15.05.2021	98.411	0,00 %
MUFG Americas Holdings Corp.	100.000	3,00 %	10.02.2025	98.396	0,00 %
Piedmont Natural Gas Co., Inc.	100.000	3,64 %	01.11.2046	98.350	0,00 %
Guardian Life Global Funding	100.000	2,00 %	26.04.2021	98.309	0,00 %
Public Service Co. of Colorado	100.000	2,25 %	15.09.2022	98.308	0,00 %
Owens Corning	100.000	4,30 %	15.07.2047	98.302	0,00 %
Marriott International, Inc.	100.000	2,30 %	15.01.2022	98.238	0,00 %
Sunoco Logistics Partners Operations LP	100.000	4,00 %	01.10.2027	98.180	0,00 %
TTX Co.	100.000	3,90 %	01.02.2045	98.138	0,00 %
American Municipal Power, Inc.	75.000	6,27 %	15.02.2050	98.123	0,00 %
VF Corp.	75.000	6,45 %	01.11.2037	98.113	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	75.000	5,70 %	15.06.2040	98.096	0,00 %
Boeing Co.	100.000	2,60 %	30.10.2025	98.087	0,00 %
Black Hills Corp.	95.000	3,95 %	15.01.2026	98.075	0,00 %
Seagate HDD Cayman	100.000	4,75 %	01.01.2025	98.000	0,00 %
National Retail Properties, Inc.	100.000	3,50 %	15.10.2027	97.845	0,00 %
Bristol-Myers Squibb Co.	100.000	2,00 %	01.08.2022	97.787	0,00 %
Kohl's Corp.	100.000	5,55 %	17.07.2045	97.746	0,00 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013	97.176	3,16 %	10.09.2046	97.709	0,00 %
Black Hills Corp.	100.000	3,15 %	15.01.2027	97.578	0,00 %
Republic Services, Inc.	100.000	2,90 %	01.07.2026	97.533	0,00 %
Flowers Foods, Inc.	100.000	3,50 %	01.10.2026	97.531	0,00 %
NYU Hospitals Center	75.000	5,75 %	01.07.2043	97.522	0,00 %
Coca-Cola Co.	100.000	2,55 %	01.06.2026	97.443	0,00 %
Hospitality Properties Trust	100.000	3,95 %	15.01.2028	97.437	0,00 %
Federal National Mortgage Association	100.000	2,50 %	25.09.2026	97.410	0,00 %
Oceaneering International, Inc.	100.000	4,65 %	15.11.2024	97.390	0,00 %
Equifax, Inc.	100.000	2,30 %	01.06.2021	97.287	0,00 %
AIG Global Funding	100.000	1,90 %	06.10.2021	97.176	0,00 %
Weyerhaeuser Co.	75.000	8,50 %	15.01.2025	97.089	0,00 %
ERP Operating LP	100.000	2,85 %	01.11.2026	97.066	0,00 %
Edison International	100.000	2,40 %	15.09.2022	97.065	0,00 %
Estee Lauder Cos, Inc.	75.000	6,00 %	15.05.2037	97.063	0,00 %
Bank of New York Mellon Corp.	100.000	3,00 %	30.10.2028	96.979	0,00 %
New York Life Global Funding	100.000	1,70 %	14.09.2021	96.933	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016	100.000	2,65 %	15.08.2049	96.926	0,00 %
Boston Scientific Corp.	75.000	7,00 %	15.11.2035	96.721	0,00 %
Entergy Mississippi, Inc.	100.000	2,85 %	01.06.2028	96.623	0,00 %
Agilent Technologies, Inc.	100.000	3,05 %	22.09.2026	96.462	0,00 %
Block Financial LLC	93.750	4,13 %	01.10.2020	96.259	0,00 %
United Technologies Corp.	100.000	2,65 %	01.11.2026	96.212	0,00 %
Westar Energy, Inc.	100.000	2,55 %	01.07.2026	96.178	0,00 %
NIKE, Inc.	100.000	3,38 %	01.11.2046	96.099	0,00 %
CBS Corp.	100.000	3,38 %	15.02.2028	96.091	0,00 %
VW Grainger, Inc.	100.000	3,75 %	15.05.2046	96.054	0,00 %
DTE Energy Co.	100.000	2,85 %	01.10.2026	95.907	0,00 %
Starbucks Corp.	100.000	2,45 %	15.06.2026	95.816	0,00 %
Consumers Energy Co.	100.000	3,25 %	15.08.2046	95.261	0,00 %
South Carolina Public Service Authority	100.000	2,39 %	01.12.2023	95.197	0,00 %
Baxter International, Inc.	100.000	2,60 %	15.08.2026	95.187	0,00 %
Hartford Financial Services Group, Inc.	75.000	5,95 %	15.10.2036	95.180	0,00 %
Cleveland Clinic Foundation	85.000	4,86 %	01.01.2114	95.114	0,00 %
CubeSmart LP	100.000	3,13 %	01.09.2026	95.023	0,00 %
Boeing Co.	100.000	2,25 %	15.06.2026	94.838	0,00 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
US Airways 2012-2 Klasse A Pass Through Trust	89.293	4,63 %	03.06.2025	94.756	0,00 %
McDonald's Corp.	100.000	3,63 %	01.05.2043	94.612	0,00 %
Kimberly-Clark Corp.	75.000	5,30 %	01.03.2041	94.588	0,00 %
Microsoft Corp.	75.000	5,20 %	01.06.2039	94.570	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013	93.000	3,07 %	15.03.2045	94.343	0,00 %
Comcast Corp.	100.000	2,35 %	15.01.2027	94.323	0,00 %
Activision Blizzard, Inc.	90.000	4,50 %	15.06.2047	94.321	0,00 %
Southern California Edison Co.	96.429	1,85 %	01.02.2022	94.277	0,00 %
Ingersoll-Rand Global Holding Co., Ltd.	75.000	5,75 %	15.06.2043	94.247	0,00 %
Hershey Co.	100.000	3,38 %	15.08.2046	94.227	0,00 %
United Airlines 2015-1 Klasse AA Pass Through Trust	92.747	3,45 %	01.12.2027	94.212	0,00 %
University of Southern California	75.000	5,25 %	01.10.2111	93.499	0,00 %
Cleveland Electric Illuminating Co.	75.000	5,95 %	15.12.2036	93.341	0,00 %
Spirit Airlines Pass Through Trust 2015-1A	89.684	4,10 %	01.04.2028	93.088	0,00 %
McDonald's Corp.	85.000	4,45 %	01.03.2047	92.414	0,00 %
Norfolk Southern Corp.	76.000	6,00 %	15.03.2105	92.377	0,00 %
Charles Schwab Corp.	90.000	3,45 %	13.02.2026	92.218	0,00 %
Pitney Bowes, Inc.	100.000	4,70 %	01.04.2023	91.784	0,00 %
UBS2 Commercial Mortgage Trust 2014	87.000	3,96 %	10.03.2047	91.412	0,00 %
Cigna Corp.	75.000	5,38 %	15.02.2042	91.008	0,00 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015	90.000	3,19 %	10.04.2048	90.814	0,00 %
Aon plc	90.000	2,80 %	15.03.2021	90.254	0,00 %
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012	87.149	3,51 %	15.05.2045	89.917	0,00 %
Duke Energy Indiana LLC	75.000	4,90 %	15.07.2043	89.871	0,00 %
State of Mississippi	75.000	5,25 %	01.11.2034	89.766	0,00 %
Santander Drive Auto Receivables Trust 2017	90.000	1,87 %	15.06.2021	89.637	0,00 %
Allstate Corp.	75.000	5,35 %	01.06.2033	89.500	0,00 %
Walt Disney Co.	100.000	3,00 %	30.07.2046	89.456	0,00 %
CBS Corp.	75.000	5,90 %	15.10.2040	89.224	0,00 %
Federal National Mortgage Association	86.308	4,45 %	25.09.2019	89.010	0,00 %
Prudential Financial, Inc.	75.000	5,10 %	15.08.2043	88.907	0,00 %
XLIT Ltd.	75.000	6,25 %	15.05.2027	88.815	0,00 %
Emerson Electric Co.	75.000	5,25 %	15.11.2039	88.651	0,00 %
Albemarle Corp.	75.000	5,45 %	01.12.2044	88.621	0,00 %
District of Columbia Water & Sewer Authority	75.000	4,81 %	01.10.2114	87.672	0,00 %
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012-CIBX	85.000	3,48 %	15.06.2045	87.456	0,00 %
Jefferies Group LLC	75.000	6,50 %	20.01.2043	87.452	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015	86.000	3,34 %	15.03.2048	87.431	0,00 %
Anthem, Inc.	75.000	5,10 %	15.01.2044	87.420	0,00 %
Jefferies Group LLC	75.000	6,45 %	08.06.2027	87.110	0,00 %
XLIT Ltd.	75.000	6,38 %	15.11.2024	87.041	0,00 %
Verisk Analytics, Inc.	75.000	5,50 %	15.06.2045	86.703	0,00 %
City of San Antonio TX Electric & Gas Systems Revenue Energy Transfer LP	75.000	4,43 %	01.02.2042	86.630	0,00 %
Oglethorpe Power Corp.	75.000	6,63 %	15.10.2036	85.914	0,00 %
Oglethorpe Power Corp.	75.000	5,25 %	01.09.2050	85.791	0,00 %
Indiana Michigan Power Co.	75.000	4,55 %	15.03.2046	85.758	0,00 %
GS Mortgage Securities Trust 2013-GCJ12	85.000	3,38 %	10.06.2046	85.699	0,00 %
Rockwell Collins, Inc.	75.000	4,80 %	15.12.2043	85.644	0,00 %
Cleveland Electric Illuminating Co.	75.000	5,50 %	15.08.2024	85.333	0,00 %
Dominion Energy, Inc.	75.000	4,70 %	01.12.2044	85.162	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2015	85.154	1,63 %	15.05.2020	85.002	0,00 %
Raymond James Financial, Inc.	75.000	4,95 %	15.07.2046	84.907	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013	81.000	3,66 %	15.07.2045	84.465	0,00 %
Masco Corp.	76.000	5,95 %	15.03.2022	84.260	0,00 %
CSX Corp.	75.000	4,75 %	30.05.2042	84.048	0,00 %
Precision Castparts Corp.	75.000	4,38 %	15.06.2045	83.955	0,00 %
Lincoln National Corp.	77.000	8,75 %	01.07.2019	83.917	0,00 %
State Public School Building Authority	75.000	5,00 %	15.09.2027	83.881	0,00 %
Harris Corp.	80.000	4,40 %	15.12.2020	83.856	0,00 %
Hackensack Meridian Health, Inc.	75.000	4,50 %	01.07.2057	83.765	0,00 %
Voya Financial, Inc.	75.000	4,80 %	15.06.2046	83.051	0,00 %
American Water Capital Corp.	75.000	4,30 %	01.09.2045	82.896	0,00 %
McDonald's Corp.	75.000	4,60 %	26.05.2045	82.795	0,00 %
California Institute of Technology	75.000	4,70 %	01.11.2111	82.712	0,00 %
Starbucks Corp.	75.000	4,30 %	15.06.2045	82.664	0,00 %
Connecticut Light & Power Co.	75.000	4,15 %	01.06.2045	82.651	0,00 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
UBS Commercial Mortgage Trust 2017^	81.000	3,84 %	15.10.2050	82.541	0,00 %
GS Mortgage Securities Trust 2012	80.634	3,38 %	10.05.2045	82.417	0,00 %
Host Hotels & Resorts LP	75.000	6,00 %	01.10.2021	82.393	0,00 %
Walt Disney Co.	75.000	4,38 %	16.08.2041	82.384	0,00 %
Union Pacific Corp.	75.000	4,00 %	15.04.2047	81.931	0,00 %
Sempra Energy	80.000	3,75 %	15.11.2025	81.891	0,00 %
Ameren Corp.	80.000	3,65 %	15.02.2026	81.552	0,00 %
Willis Towers Watson plc	75.000	5,75 %	15.03.2021	81.401	0,00 %
Morgan Stanley Capital I Trust 2012	80.000	3,24 %	15.03.2045	81.357	0,00 %
Ford Motor Credit Co. LLC	75.000	5,75 %	01.02.2021	81.266	0,00 %
Harley-Davidson, Inc.	75.000	4,63 %	28.07.2045	81.266	0,00 %
Tampa Electric Co.	75.000	4,35 %	15.05.2044	81.255	0,00 %
Alleghany Corp.	75.000	4,90 %	15.09.2044	80.936	0,00 %
Consumers Energy Co.	75.000	3,95 %	15.07.2047	80.838	0,00 %
Oklahoma Gas & Electric Co.	75.000	4,15 %	01.04.2047	80.803	0,00 %
Western Union Co.	75.000	6,20 %	17.11.2036	80.801	0,00 %
Host Hotels & Resorts LP	75.000	5,25 %	15.03.2022	80.704	0,00 %
Unum Group	75.000	5,63 %	15.09.2020	80.654	0,00 %
Kimco Realty Corp.	75.000	6,88 %	01.10.2019	80.639	0,00 %
Janus Capital Group, Inc.	75.000	4,88 %	01.08.2025	80.391	0,00 %
Reinsurance Group of America, Inc.	75.000	6,45 %	15.11.2019	80.292	0,00 %
Fidelity National Information Services, Inc.	75.000	4,50 %	15.10.2022	80.201	0,00 %
Whirlpool Corp.	75.000	4,85 %	15.06.2021	80.137	0,00 %
Prudential Financial, Inc.	75.000	4,50 %	16.11.2021	79.913	0,00 %
Energy Transfer LP/Regency Energy Finance Corp.	75.000	5,00 %	01.10.2022	79.875	0,00 %
AvalonBay Communities, Inc.	75.000	4,20 %	15.12.2023	79.850	0,00 %
American Water Capital Corp.	75.000	4,00 %	01.12.2046	79.847	0,00 %
Dignity Health	75.000	5,27 %	01.11.2064	79.831	0,00 %
Avnet, Inc.	75.000	5,88 %	15.06.2020	79.801	0,00 %
Host Hotels & Resorts LP	75.000	4,75 %	01.03.2023	79.772	0,00 %
Cigna Corp.	75.000	5,13 %	15.06.2020	79.523	0,00 %
JobsOhio Beverage System	75.000	3,99 %	01.01.2029	79.507	0,00 %
Affiliated Managers Group, Inc.	75.000	4,25 %	15.02.2024	79.279	0,00 %
Mayo Clinic	75.000	4,13 %	15.11.2052	79.249	0,00 %
Kohl's Corp.	75.000	4,75 %	15.12.2023	79.110	0,00 %
International Paper Co.	68.000	7,50 %	15.08.2021	79.109	0,00 %
Mid-America Apartments LP	75.000	4,30 %	15.10.2023	79.059	0,00 %
Reliance Steel & Aluminum Co.	75.000	4,50 %	15.04.2023	79.050	0,00 %
Cigna Corp.	75.000	4,50 %	15.03.2021	78.980	0,00 %
MetLife, Inc.	75.000	4,13 %	13.08.2042	78.956	0,00 %
California State University	75.000	3,90 %	01.11.2047	78.881	0,00 %
CenterPoint Energy Resources Corp.	75.000	4,10 %	01.09.2047	78.790	0,00 %
Kilroy Realty LP	75.000	4,38 %	01.10.2025	78.716	0,00 %
Crane Co.	75.000	4,45 %	15.12.2023	78.489	0,00 %
Air Lease Corp.	75.000	4,25 %	15.09.2024	78.447	0,00 %
Air Lease Corp.	75.000	4,75 %	01.03.2020	78.399	0,00 %
Walt Disney Co.	75.000	3,75 %	01.06.2021	78.334	0,00 %
Corning, Inc.	75.000	4,25 %	15.08.2020	78.324	0,00 %
Enterprise Products Operating LLC	75.000	6,50 %	31.01.2019	78.292	0,00 %
Verisk Analytics, Inc.	75.000	4,13 %	12.09.2022	78.214	0,00 %
Piedmont Operating Partnership LP	75.000	4,45 %	15.03.2024	78.111	0,00 %
Carnival Corp.	75.000	3,95 %	15.10.2020	78.050	0,00 %
Unum Group	75.000	4,00 %	15.03.2024	78.045	0,00 %
Newell Brands Inc.	75.000	4,00 %	01.12.2024	77.963	0,00 %
UBS4 Commercial Mortgage Trust 2014	75.000	3,69 %	10.08.2047	77.823	0,00 %
Oklahoma Gas & Electric Co.	75.000	3,85 %	15.08.2047	77.786	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015	75.000	3,64 %	15.10.2048	77.760	0,00 %
Williams Partners LP	75.000	4,13 %	15.11.2020	77.698	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	75.000	4,00 %	15.11.2057	77.691	0,00 %
Harris Corp.	75.000	3,83 %	27.04.2025	77.550	0,00 %
Johnson Controls International plc	75.000	3,75 %	01.12.2021	77.523	0,00 %
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates^	75.000	3,30 %	25.11.2027	77.425	0,00 %
Northwestern University	75.000	3,66 %	01.12.2057	77.375	0,00 %
Eaton Vance Corp.	75.000	3,63 %	15.06.2023	77.370	0,00 %
Anthem, Inc.	75.000	3,70 %	15.08.2021	77.292	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014	75.000	3,53 %	15.12.2047	77.287	0,00 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	75.000	3,90 %	15.06.2023	77.209	0,00 %
Digital Realty Trust LP	75.000	3,63 %	01.10.2022	77.107	0,00 %
Stifel Financial Corp.	75.000	4,25 %	18.07.2024	77.049	0,00 %
Prospect Capital Corp.	75.000	5,00 %	15.07.2019	77.011	0,00 %
Celgene Corp.	75.000	3,55 %	15.08.2022	77.010	0,00 %
Dominion Energy, Inc.	75.000	4,05 %	15.09.2042	76.965	0,00 %
Phillips 66 Partners LP	75.000	4,68 %	15.02.2045	76.942	0,00 %
Baltimore Gas & Electric Co.	75.000	3,75 %	15.08.2047	76.847	0,00 %
Louisville Gas & Electric Co.	75.000	3,30 %	01.10.2025	76.780	0,00 %
Citigroup, Inc.	75.000	3,88 %	26.03.2025	76.758	0,00 %
Public Service Electric & Gas Co.	75.000	3,60 %	01.12.2047	76.752	0,00 %
Principal Financial Group, Inc.^	75.000	4,70 %	15.05.2055	76.708	0,00 %
CGMS Commercial Mortgage Trust 2017^	75.000	3,71 %	15.08.2050	76.706	0,00 %
Cabot Corp.	75.000	3,70 %	15.07.2022	76.619	0,00 %
Apollo Investment Corp.	75.000	5,25 %	03.03.2025	76.590	0,00 %
Washington	75.000	3,95 %	15.10.2022	76.589	0,00 %
Brandywine Operating Partnership LP	75.000	3,95 %	15.02.2023	76.550	0,00 %
Raytheon Co.	75.000	3,15 %	15.12.2024	76.530	0,00 %
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	75.000	3,95 %	15.01.2027	76.518	0,00 %
Lincoln National Corp.	75.000	3,63 %	12.12.2026	76.498	0,00 %
Cardinal Health, Inc.	75.000	3,75 %	15.09.2025	76.434	0,00 %
PPL Electric Utilities Corp.	75.000	3,00 %	15.09.2021	76.330	0,00 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	75.000	3,30 %	14.03.2023	76.273	0,00 %
Beam Suntory, Inc.	75.000	3,25 %	15.05.2022	76.238	0,00 %
Snap-on, Inc.	75.000	3,25 %	01.03.2027	76.162	0,00 %
Indiana Michigan Power Co.	75.000	3,75 %	01.07.2047	76.160	0,00 %
Columbia Property Trust Operating Partnership LP	75.000	4,15 %	01.04.2025	76.149	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017	75.000	3,28 %	15.11.2052	76.130	0,00 %
Avnet, Inc.	75.000	3,75 %	01.12.2021	76.022	0,00 %
Allstate Corp.	75.000	3,28 %	15.12.2026	76.021	0,00 %
Alterra Finance LLC	70.000	6,25 %	30.09.2020	75.981	0,00 %
Texas Instruments, Inc.	75.000	2,75 %	12.03.2021	75.974	0,00 %
Mayo Clinic	75.000	3,77 %	15.11.2043	75.954	0,00 %
General Dynamics Corp.	75.000	3,60 %	15.11.2042	75.940	0,00 %
LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2008^	75.813	6,32 %	15.04.2041	75.932	0,00 %
Andeavor	69.000	5,13 %	15.12.2026	75.900	0,00 %
Virginia Electric & Power Co.	75.000	3,15 %	15.01.2026	75.720	0,00 %
TD Ameritrade Holding Corp.	75.000	2,95 %	01.04.2022	75.713	0,00 %
Mount Sinai Hospitals Group, Inc.	75.000	3,98 %	01.07.2048	75.676	0,00 %
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2013	75.000	3,37 %	15.12.2047	75.637	0,00 %
Exelon Corp.	75.000	2,85 %	15.06.2020	75.621	0,00 %
Southwest Gas Corp.	75.000	3,80 %	29.09.2046	75.603	0,00 %
Southwest Airlines Co.	75.000	2,75 %	06.11.2019	75.600	0,00 %
Highwoods Realty LP	75.000	3,20 %	15.06.2021	75.598	0,00 %
HCP, Inc.	75.000	3,15 %	01.08.2022	75.590	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013	74.000	3,20 %	15.03.2048	75.494	0,00 %
FS Investment Corp.	75.000	4,00 %	15.07.2019	75.472	0,00 %
Gulf Power Co.	75.000	3,30 %	30.05.2027	75.455	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	75.000	3,13 %	15.11.2027	75.446	0,00 %
Affiliated Managers Group, Inc.	75.000	3,50 %	01.08.2025	75.424	0,00 %
Citigroup, Inc.	75.000	3,30 %	27.04.2025	75.413	0,00 %
Weingarten Realty Investors	75.000	3,50 %	15.04.2023	75.413	0,00 %
Highwoods Realty LP	75.000	3,88 %	01.03.2027	75.403	0,00 %
Permanent University Fund-University of Texas System	75.000	3,38 %	01.07.2047	75.333	0,00 %
Harris Corp.	75.000	2,70 %	27.04.2020	75.218	0,00 %
HCP, Inc.	75.000	2,63 %	01.02.2020	75.205	0,00 %
Kimberly-Clark Corp.	75.000	3,05 %	15.08.2025	75.128	0,00 %
John Deere Capital Corp.	75.000	2,45 %	11.09.2020	75.117	0,00 %
State Board of Administration Finance Corp.	75.000	2,64 %	01.07.2021	75.077	0,00 %
Air Products & Chemicals, Inc.	75.000	2,75 %	03.02.2023	75.053	0,00 %
Westar Energy, Inc.	75.000	3,10 %	01.04.2027	75.031	0,00 %
CCRE4 Commercial Mortgage Trust 2012	75.000	2,85 %	15.10.2045	75.010	0,00 %
Mastercard, Inc.	75.000	2,00 %	01.04.2019	74.923	0,00 %
General Electric Co.	75.000	2,10 %	11.12.2019	74.910	0,00 %
Aetna, Inc.	75.000	2,20 %	15.03.2019	74.890	0,00 %
Merck & Co., Inc.	75.000	2,35 %	10.02.2022	74.840	0,00 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Federal Home Loan Mortgage Corp.	75.000	2,40 %	25.06.2022	74.822	0,00 %
Hudson Pacific Properties LP	75.000	3,95 %	01.11.2027	74.785	0,00 %
BMW Vehicle Lease Trust 2017	75.000	2,07 %	20.10.2020	74.782	0,00 %
Wisconsin Power & Light Co.	75.000	3,05 %	15.10.2027	74.781	0,00 %
Eaton Corp.	75.000	3,92 %	15.09.2047	74.754	0,00 %
ITC Holdings Corp.	75.000	2,70 %	15.11.2022	74.745	0,00 %
Oncor Electric Delivery Co. LLC	75.000	2,95 %	01.04.2025	74.734	0,00 %
Trinity Industries, Inc.	75.000	4,55 %	01.10.2024	74.718	0,00 %
Nissan Auto Lease Trust 2017	75.000	2,17 %	15.12.2021	74.683	0,00 %
Simon Property Group LP	75.000	2,75 %	01.02.2023	74.666	0,00 %
Cboe Global Markets Inc.	75.000	1,95 %	28.06.2019	74.528	0,00 %
Textron, Inc.	75.000	3,38 %	01.03.2028	74.504	0,00 %
Fortive Corp.	75.000	1,80 %	15.06.2019	74.486	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2017	75.000	2,33 %	15.05.2023	74.484	0,00 %
Texas Instruments, Inc.	75.000	2,63 %	15.05.2024	74.479	0,00 %
Piedmont Operating Partnership LP	75.000	3,40 %	01.06.2023	74.468	0,00 %
Eversource Energy	75.000	2,90 %	01.10.2024	74.317	0,00 %
Tanger Properties LP	75.000	3,88 %	15.07.2027	74.294	0,00 %
Northern Trust Corp.^	75.000	3,38 %	08.05.2032	74.289	0,00 %
Healthcare Realty Trust, Inc.	75.000	3,63 %	15.01.2028	74.190	0,00 %
AutoNation, Inc.	75.000	3,80 %	15.11.2027	74.139	0,00 %
Commonwealth Edison Co.	75.000	2,95 %	15.08.2027	74.103	0,00 %
CMS Energy Corp.	75.000	3,00 %	15.05.2026	74.044	0,00 %
Vereit Operating Partnership LP	70.000	4,88 %	01.06.2026	73.938	0,00 %
CD 2006-CD3 Mortgage Trust	73.769	5,65 %	15.10.2048	73.893	0,00 %
Blackstone Holdings Finance Co. LLC	75.000	4,00 %	02.10.2047	73.793	0,00 %
ERAC USA Finance LLC	75.000	2,60 %	01.12.2021	73.739	0,00 %
CBS Corp.	75.000	2,90 %	01.06.2023	73.687	0,00 %
Healthcare Trust of America Holdings LP	75.000	3,50 %	01.08.2026	73.578	0,00 %
Boeing Co.	50.000	6,88 %	15.03.2039	73.428	0,00 %
Arizona Public Service Co.	75.000	2,95 %	15.09.2027	73.295	0,00 %
Guardian Life Global Funding	75.000	1,95 %	27.10.2021	73.081	0,00 %
Verizon Communications, Inc.	75.000	1,75 %	15.08.2021	72.978	0,00 %
Honeywell International, Inc.	70.000	3,35 %	01.12.2023	72.801	0,00 %
Boeing Co.	75.000	3,38 %	15.06.2046	72.742	0,00 %
Apache Corp.	75.000	4,25 %	15.01.2044	72.688	0,00 %
Providence St Joseph Health Obligated Group	75.000	2,75 %	01.10.2026	72.505	0,00 %
Southwest Airlines Co.	75.000	3,00 %	15.11.2026	72.414	0,00 %
Bed Bath & Beyond, Inc.	80.000	4,92 %	01.08.2034	72.258	0,00 %
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	70.000	3,95 %	15.01.2028	71.370	0,00 %
Bunge Ltd. Finance Corp.	70.000	3,50 %	24.11.2020	71.333	0,00 %
Tanger Properties LP	75.000	3,13 %	01.09.2026	70.736	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012	70.000	2,87 %	15.11.2045	70.371	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017^	69.000	3,67 %	15.07.2050	69.875	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015	66.000	3,80 %	15.08.2048	69.066	0,00 %
Teachers Insurance & Annuity Association of America	48.000	6,85 %	16.12.2039	67.746	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013	67.000	3,00 %	15.05.2045	67.669	0,00 %
East Bay Municipal Utility District Water System Revenue	50.000	5,87 %	01.06.2040	66.977	0,00 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	60.000	4,13 %	15.06.2047	66.937	0,00 %
CBL & Associates LP	75.000	4,60 %	15.10.2024	66.766	0,00 %
Prudential Financial, Inc.	50.000	6,20 %	15.11.2040	66.350	0,00 %
Morgan Stanley Capital I Trust 2016	65.000	3,28 %	15.11.2049	65.896	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015	65.000	3,18 %	15.04.2050	65.402	0,00 %
GS Mortgage Securities Trust 2012	64.862	2,77 %	10.11.2045	65.013	0,00 %
Cincinnati Financial Corp.	50.000	6,92 %	15.05.2028	64.583	0,00 %
Loews Corp.	50.000	6,00 %	01.02.2035	62.691	0,00 %
Dallas County Hospital District	50.000	5,62 %	15.08.2044	62.425	0,00 %
KeyBank NA	50.000	6,95 %	01.02.2028	62.348	0,00 %
District of Columbia	50.000	5,59 %	01.12.2034	61.794	0,00 %
FS Investment Corp.	60.000	4,75 %	15.05.2022	61.657	0,00 %
United Airlines 2015-1 Klasse A Pass Through Trust	60.000	3,70 %	01.12.2022	61.422	0,00 %
CD 2017-CD3 Mortgage Trust	59.000	3,83 %	10.02.2050	60.566	0,00 %
AHS Hospital Corp.	50.000	5,02 %	01.07.2045	60.251	0,00 %
Illinois Tool Works, Inc.	50.000	4,88 %	15.09.2041	60.160	0,00 %
Danaher Corp.	60.000	2,40 %	15.09.2020	60.110	0,00 %
JPMorgan Chase & Co.	60.000	2,20 %	22.10.2019	59.932	0,00 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
ITC Holdings Corp.	60.000	3,25 %	30.06.2026	59.628	0,00 %
Apache Corp.	61.000	2,63 %	15.01.2023	59.618	0,00 %
Duke Energy Carolinas LLC	60.000	2,95 %	01.12.2026	59.606	0,00 %
Toyota Auto Receivables 2015-B Owner Trust	59.551	1,27 %	15.05.2019	59.418	0,00 %
CCRE8 Commercial Mortgage Trust 2013^	56.000	3,61 %	10.06.2046	58.136	0,00 %
XLIT Ltd.	50.000	5,25 %	15.12.2043	57.867	0,00 %
GATX Corp.	50.000	5,20 %	15.03.2044	57.432	0,00 %
LC6Commercial Mortgage Trust 2013	57.000	3,28 %	10.01.2046	57.431	0,00 %
California Institute of Technology	50.000	4,32 %	01.08.2045	57.283	0,00 %
El du Pont de Nemours & Co.	50.000	4,90 %	15.01.2041	56.945	0,00 %
GS Mortgage Securities Trust 2011	55.000	3,71 %	10.08.2044	56.930	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013^	54.000	4,03 %	15.07.2045	56.473	0,00 %
Union Pacific Corp.	55.000	3,88 %	01.02.2055	55.561	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2015	55.326	1,41 %	15.02.2020	55.222	0,00 %
Westar Energy, Inc.	50.000	4,25 %	01.12.2045	55.002	0,00 %
Principal Financial Group, Inc.	50.000	4,63 %	15.09.2042	54.929	0,00 %
American Water Capital Corp.	50.000	4,30 %	01.12.2042	54.767	0,00 %
Harris Corp.	50.000	5,55 %	01.10.2021	54.733	0,00 %
Concho Resources, Inc.	50.000	4,88 %	01.10.2047	54.625	0,00 %
General Motors Co.	50.000	5,40 %	01.04.2048	54.539	0,00 %
Children's Hospital Medical Center	50.000	4,27 %	15.05.2044	54.455	0,00 %
HP, Inc.	53.000	3,75 %	01.12.2020	54.414	0,00 %
ERP Operating LP	50.000	4,50 %	01.07.2044	54.115	0,00 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013^	50.000	4,37 %	10.09.2046	53.911	0,00 %
GS Mortgage Securities Trust 2013	50.000	4,27 %	10.11.2046	53.681	0,00 %
Hexcel Corp.	50.000	4,70 %	15.08.2025	53.481	0,00 %
Primerica, Inc.	50.000	4,75 %	15.07.2022	53.410	0,00 %
Xerox Corp.	50.000	6,75 %	15.12.2039	53.377	0,00 %
Comm 2013-CCRE13 Mortgage Trust^	50.000	4,19 %	12.11.2046	53.344	0,00 %
Texas Health Resources	50.000	4,33 %	15.11.2055	53.328	0,00 %
Energy Transfer LP/Regency Energy Finance Corp.	50.000	5,75 %	01.09.2020	53.313	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013^	50.000	4,17 %	15.08.2046	53.287	0,00 %
Gilead Sciences, Inc.	50.000	4,40 %	01.12.2021	53.259	0,00 %
Virginia Electric & Power Co.	50.000	4,00 %	15.11.2046	53.163	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	50.000	4,70 %	15.02.2021	53.146	0,00 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	50.000	3,90 %	01.08.2046	53.095	0,00 %
TD Ameritrade Holding Corp.	50.000	5,60 %	01.12.2019	53.025	0,00 %
Dr Pepper Snapple Group, Inc.	50.000	4,42 %	15.12.2046	52.751	0,00 %
Wyndham Worldwide Corp.	50.000	5,10 %	01.10.2025	52.694	0,00 %
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	50.000	6,65 %	01.04.2019	52.681	0,00 %
Duke Energy Carolinas LLC	50.000	3,88 %	15.03.2046	52.660	0,00 %
American International Group, Inc.	50.000	4,13 %	15.02.2024	52.650	0,00 %
DR Horton, Inc.	50.000	4,38 %	15.09.2022	52.644	0,00 %
Republic Services, Inc.	50.000	5,50 %	15.09.2019	52.640	0,00 %
CSX Corp.	50.000	4,25 %	01.06.2021	52.534	0,00 %
Franklin Resources, Inc.	50.000	4,63 %	20.05.2020	52.512	0,00 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014	50.000	3,86 %	10.05.2047	52.503	0,00 %
Advance Auto Parts, Inc.	50.000	4,50 %	01.12.2023	52.499	0,00 %
GS Mortgage Securities Trust 2015	50.000	3,76 %	10.07.2048	52.380	0,00 %
LC6 Commercial Mortgage Trust 2013	52.000	2,94 %	10.01.2046	52.366	0,00 %
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	50.000	4,30 %	15.01.2026	52.335	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014	50.000	3,77 %	15.08.2047	52.293	0,00 %
FirstEnergy Corp.	50.000	4,25 %	15.03.2023	52.215	0,00 %
PNC Bank NA	50.000	3,80 %	25.07.2023	52.131	0,00 %
Valero Energy Partners LP	50.000	4,38 %	15.12.2026	52.107	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014	50.000	4,07 %	15.11.2047	52.079	0,00 %
Simon Property Group LP	50.000	4,25 %	01.10.2044	52.007	0,00 %
Andeavor Logistics LP/Tesoro Logistics Finance Corp.	50.000	5,20 %	01.12.2047	52.000	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012^	50.000	4,09 %	15.06.2045	51.891	0,00 %
CCRE16 Commercial Mortgage Trust 2014	50.000	3,65 %	10.04.2047	51.809	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013^	50.000	3,76 %	15.08.2046	51.759	0,00 %
CCRE12 Commercial Mortgage Trust 2013	50.000	3,62 %	10.10.2046	51.718	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017^	50.000	3,85 %	15.10.2050	51.682	0,00 %
Princeton University	50.000	4,95 %	01.03.2019	51.570	0,00 %
Mayo Clinic	50.000	4,00 %	15.11.2047	51.524	0,00 %
L3 Technologies, Inc.	50.000	3,85 %	15.12.2026	51.433	0,00 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Dow Chemical Co.	50.000	3,50 %	01.10.2024	51.378	0,00 %
UBS Commercial Mortgage Trust 2017^	50.000	3,74 %	15.08.2050	51.378	0,00 %
Carlisle Cos, Inc.	50.000	3,75 %	15.11.2022	51.241	0,00 %
Marathon Petroleum Corp.	50.000	3,40 %	15.12.2020	51.087	0,00 %
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust 2013	50.000	3,47 %	10.04.2046	51.086	0,00 %
Laboratory Corp. of America Holdings	50.000	3,20 %	01.02.2022	50.969	0,00 %
Thermo Fisher Scientific, Inc.	50.000	3,30 %	15.02.2022	50.956	0,00 %
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017^	50.000	3,71 %	15.10.2050	50.938	0,00 %
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017	50.000	3,76 %	12.10.2050	50.918	0,00 %
Sabra Health Care LP	50.000	5,13 %	15.08.2026	50.905	0,00 %
Healthcare Trust of America Holdings LP	50.000	3,38 %	15.07.2021	50.902	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013	50.000	3,46 %	15.05.2046	50.897	0,00 %
Darden Restaurants, Inc.	50.000	3,85 %	01.05.2027	50.844	0,00 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	50.000	2,90 %	15.10.2020	50.832	0,00 %
GATX Corp.	50.000	3,85 %	30.03.2027	50.798	0,00 %
Northern States Power Co.	50.000	3,60 %	15.05.2046	50.769	0,00 %
Union Electric Co.	50.000	3,65 %	15.04.2045	50.747	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013	50.000	3,10 %	15.05.2046	50.696	0,00 %
Stifel Financial Corp.	50.000	3,50 %	01.12.2020	50.679	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012	50.000	3,00 %	15.08.2045	50.666	0,00 %
MetLife, Inc.	50.000	3,05 %	15.12.2022	50.607	0,00 %
Priceline Group, Inc.	50.000	3,65 %	15.03.2025	50.585	0,00 %
Reliance Standard Life Global Funding II	50.000	3,05 %	20.01.2021	50.575	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013	50.000	3,38 %	15.12.2048	50.526	0,00 %
RPM International, Inc.	50.000	3,75 %	15.03.2027	50.485	0,00 %
Weingarten Realty Investors	50.000	3,38 %	15.10.2022	50.396	0,00 %
Essex Portfolio LP	50.000	3,63 %	01.05.2027	50.395	0,00 %
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2012	49.962	2,92 %	15.10.2045	50.352	0,00 %
Hershey Co.	50.000	3,20 %	21.08.2025	50.287	0,00 %
University of Texas System	50.000	3,35 %	15.08.2047	50.278	0,00 %
CCRE12 Commercial Mortgage Trust 2013	50.000	2,90 %	10.10.2046	50.265	0,00 %
United Parcel Service, Inc.	50.000	3,63 %	01.10.2042	50.257	0,00 %
Wells Fargo & Co.	50.000	2,55 %	07.12.2020	50.184	0,00 %
Laboratory Corp. of America Holdings	50.000	2,63 %	01.02.2020	50.147	0,00 %
Principal Life Global Funding II	50.000	2,63 %	19.11.2020	50.146	0,00 %
Precision Castparts Corp.	50.000	2,25 %	15.06.2020	50.084	0,00 %
LYB International Finance II BV	50.000	3,50 %	02.03.2027	50.063	0,00 %
Enable Midstream Partners LP	50.000	3,90 %	15.05.2024	50.042	0,00 %
Ventas Realty LP	50.000	3,13 %	15.06.2023	50.000	0,00 %
Starbucks Corp.	50.000	2,20 %	22.11.2020	49.987	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2014	50.000	1,73 %	18.02.2020	49.963	0,00 %
Church & Dwight Co., Inc.	50.000	2,45 %	15.12.2019	49.893	0,00 %
Kroger Co.	50.000	2,00 %	15.01.2019	49.892	0,00 %
Kennametal, Inc.	50.000	2,65 %	01.11.2019	49.890	0,00 %
Procter & Gamble Co.	50.000	1,90 %	01.11.2019	49.890	0,00 %
Illinois Tool Works, Inc.	50.000	1,95 %	01.03.2019	49.889	0,00 %
AutoZone, Inc.	50.000	2,88 %	15.01.2023	49.815	0,00 %
Life Storage LP	50.000	3,88 %	15.12.2027	49.796	0,00 %
Southern Power Co.	50.000	2,38 %	01.06.2020	49.786	0,00 %
Andeavor Logistics LP/Tesoro Logistics Finance Corp.	50.000	3,50 %	01.12.2022	49.750	0,00 %
AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2017	50.000	1,90 %	18.03.2022	49.635	0,00 %
Hubbell, Inc.	50.000	3,15 %	15.08.2027	49.611	0,00 %
Southwest Airlines Co.	50.000	3,45 %	16.11.2027	49.608	0,00 %
EQT Corp.	50.000	2,50 %	01.10.2020	49.607	0,00 %
Federal Realty Investment Trust	50.000	3,25 %	15.07.2027	49.576	0,00 %
Apple, Inc.	50.000	3,00 %	20.06.2027	49.574	0,00 %
Boeing Co.	50.000	2,80 %	01.03.2027	49.542	0,00 %
Berkshire Hathaway Finance Corp.	50.000	1,30 %	15.08.2019	49.373	0,00 %
John Deere Capital Corp.	50.000	2,65 %	24.06.2024	49.341	0,00 %
Tyson Foods, Inc.	50.000	2,25 %	23.08.2021	49.336	0,00 %
DDR Corp.	50.000	3,63 %	01.02.2025	49.264	0,00 %
Boeing Co.	50.000	1,65 %	30.10.2020	49.198	0,00 %
Allergan, Inc.	50.000	2,80 %	15.03.2023	49.154	0,00 %
Spectra Energy Partners LP	50.000	3,38 %	15.10.2026	49.141	0,00 %
Owens Corning	50.000	3,40 %	15.08.2026	49.102	0,00 %
Centerpoint Energy Transition Bond Co. II LLC	47.848	5,30 %	01.08.2020	49.081	0,00 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
State of California Department of Water Resources Power Supply Revenue	50.000	2,00 %	01.05.2022	48.869	0,00 %
Smithfield Foods, Inc.	50.000	2,65 %	03.10.2021	48.801	0,00 %
GATX Corp.	50.000	3,25 %	15.09.2026	48.794	0,00 %
Mississippi Power Co.	50.000	4,25 %	15.03.2042	48.787	0,00 %
Omega Healthcare Investors, Inc.	50.000	4,50 %	01.04.2027	48.688	0,00 %
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	50.000	5,15 %	01.06.2042	48.622	0,00 %
Toyota Auto Receivables 2016-B Owner Trust	48.742	1,30 %	15.04.2020	48.561	0,00 %
Quest Diagnostics, Inc.	42.000	5,75 %	30.01.2040	48.372	0,00 %
Nissan Auto Receivables 2015-B Owner Trust	48.149	1,34 %	16.03.2020	48.037	0,00 %
Burlington Northern Santa Fe LLC	45.000	3,65 %	01.09.2025	47.162	0,00 %
UBS4 Commercial Mortgage Trust 2014	45.000	3,97 %	10.08.2047	46.596	0,00 %
CME Group, Inc.	45.000	3,00 %	15.03.2025	45.666	0,00 %
American Airlines 2013-1 Klasse A Pass Through Trust	44.057	4,00 %	15.07.2025	45.378	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2017	45.000	1,87 %	15.09.2022	44.565	0,00 %
Pfizer, Inc.	45.000	2,75 %	03.06.2026	44.351	0,00 %
Newmont Mining Corp.	40.000	4,88 %	15.03.2042	43.926	0,00 %
GM Financial Automobile Leasing Trust 2015	43.245	1,69 %	20.03.2019	43.228	0,00 %
CCRE10 Commercial Mortgage Trust 2013^	40.000	4,21 %	10.08.2046	42.708	0,00 %
CCRE11 Commercial Mortgage Trust 2013	40.000	3,98 %	10.08.2050	42.206	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013^	40.000	4,36 %	15.08.2046	42.128	0,00 %
Federal National Mortgage Association	41.982	2,57 %	25.08.2024	41.923	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013	40.000	3,72 %	15.08.2046	41.374	0,00 %
Continental Airlines 2012-1 Klasse A Pass Through Trust	38.926	4,15 %	11.04.2024	40.624	0,00 %
Massachusetts Institute of Technology	40.000	3,89 %	01.07.2116	40.012	0,00 %
World Omni Auto Receivables Trust 2014	39.852	1,53 %	15.06.2020	39.834	0,00 %
American Financial Group, Inc.	40.000	3,50 %	15.08.2026	39.692	0,00 %
Kroger Co.	40.000	3,50 %	01.02.2026	39.626	0,00 %
Ally Auto Receivables Trust 2015	38.984	1,49 %	15.11.2019	38.954	0,00 %
Newell Brands Inc.	38.000	2,60 %	29.03.2019	38.058	0,00 %
Mead Johnson Nutrition Co.	30.000	5,90 %	01.11.2039	37.971	0,00 %
Mercedes-Benz Auto Receivables Trust 2015	37.636	1,34 %	16.12.2019	37.556	0,00 %
L3 Technologies, Inc.	35.000	3,95 %	28.05.2024	36.368	0,00 %
Church & Dwight Co., Inc.	36.000	2,88 %	01.10.2022	36.047	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013	35.000	3,56 %	15.03.2048	35.628	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013	35.000	2,92 %	15.02.2046	35.227	0,00 %
Fidelity National Information Services, Inc.	34.000	3,88 %	05.06.2024	35.213	0,00 %
GS Mortgage Securities Corp.II	34.000	3,28 %	10.02.2046	34.299	0,00 %
Viacom, Inc.	33.000	2,75 %	15.12.2019	32.985	0,00 %
Masco Corp.	27.000	6,50 %	15.08.2032	32.918	0,00 %
CCRE11 Commercial Mortgage Trust 2013^	30.000	4,72 %	10.08.2050	32.436	0,00 %
GS Mortgage Securities Trust 2013-GCJ14	32.281	3,00 %	10.08.2046	32.359	0,00 %
Toledo Edison Co.	25.000	6,15 %	15.05.2037	32.221	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013^	30.000	4,67 %	15.09.2046	32.139	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013^	30.000	4,26 %	15.10.2046	32.136	0,00 %
LC13Commercial Mortgage Trust 2013	30.000	4,21 %	10.08.2046	32.020	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013^	30.000	4,37 %	15.08.2046	31.684	0,00 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	25.000	5,88 %	15.06.2035	31.596	0,00 %
Conagra Brands, Inc.	25.000	7,00 %	01.10.2028	31.162	0,00 %
CCRE11 Commercial Mortgage Trust 2013	30.000	3,66 %	10.08.2050	31.144	0,00 %
American Campus Communities Operating Partnership LP	30.000	3,35 %	01.10.2020	30.576	0,00 %
Honda Auto Receivables 2015-3 Owner Trust	30.382	1,27 %	18.04.2019	30.358	0,00 %
CCRE11 Commercial Mortgage Trust 2013	30.000	3,05 %	10.08.2050	30.265	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013	30.000	3,00 %	15.10.2046	30.186	0,00 %
GM Financial Automobile Leasing Trust 2015	29.050	1,68 %	20.12.2018	29.044	0,00 %
CCRE2 Commercial Mortgage Trust 2012	28.000	3,15 %	15.08.2045	28.424	0,00 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	25.000	4,35 %	30.01.2047	27.721	0,00 %
Nissan Auto Receivables 2015-A Owner Trust	27.094	1,05 %	15.10.2019	27.036	0,00 %
Memorial Sloan-Kettering Cancer Center	25.000	4,20 %	01.07.2055	26.970	0,00 %
CMS Energy Corp.	25.000	6,25 %	01.02.2020	26.871	0,00 %
HCP, Inc.	25.000	5,38 %	01.02.2021	26.851	0,00 %
Hospitality Properties Trust	25.000	5,25 %	15.02.2026	26.834	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014	25.000	4,00 %	15.04.2047	26.443	0,00 %
Simon Property Group LP	25.000	4,25 %	30.11.2046	26.357	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014^	25.000	4,24 %	15.04.2047	26.327	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014	25.000	4,00 %	15.05.2047	26.323	0,00 %
CCRE17 Commercial Mortgage Trust 2014	25.000	3,98 %	10.05.2047	26.295	0,00 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Enbridge Energy Partners LP	25.000	5,20 %	15.03.2020	26.233	0,00 %
CCRE19 Commercial Mortgage Trust 2014	25.000	3,80 %	10.08.2047	26.220	0,00 %
DCT Industrial Operating Partnership LP	25.000	4,50 %	15.10.2023	26.039	0,00 %
GS Mortgage Securities Trust 2013-GCJ14	25.000	3,82 %	10.08.2046	25.966	0,00 %
CCRE17 Commercial Mortgage Trust 2014	25.000	3,60 %	10.05.2047	25.831	0,00 %
CCRE17 Commercial Mortgage Trust 2014	25.000	4,38 %	10.05.2047	25.782	0,00 %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014	25.000	3,67 %	15.04.2047	25.731	0,00 %
CD 2017-CD3 Mortgage Trust	25.000	3,45 %	10.02.2050	25.714	0,00 %
Citigroup, Inc.	25.000	3,70 %	12.01.2026	25.674	0,00 %
UnitedHealth Group, Inc.	20.000	5,70 %	15.10.2040	25.674	0,00 %
Tyco Electronics Group SA	25.000	3,45 %	01.08.2024	25.630	0,00 %
Bank 2018-BNK ³	25.000	3,73 %	15.11.2050	25.629	0,00 %
PNC Bank NA	25.000	3,30 %	30.10.2024	25.524	0,00 %
Welltower, Inc.	25.000	4,13 %	01.04.2019	25.465	0,00 %
CCRE17 Commercial Mortgage Trust 2014	25.000	3,01 %	10.05.2047	25.266	0,00 %
Essex Portfolio LP	25.000	3,25 %	01.05.2023	25.201	0,00 %
Marsh & McLennan Cos, Inc.	25.000	2,35 %	06.03.2020	24.948	0,00 %
EnLink Midstream Partners LP	25.000	5,05 %	01.04.2045	24.803	0,00 %
Texas Eastern Transmission LP	25.000	2,80 %	15.10.2022	24.762	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2015	24.041	1,16 %	15.11.2019	23.990	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2015	22.665	1,37 %	16.03.2020	22.614	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013	22.000	3,35 %	15.05.2045	22.149	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013	20.000	4,42 %	15.09.2046	21.644	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013	20.000	3,96 %	15.09.2046	20.845	0,00 %
Ecolab, Inc.	14.000	5,50 %	08.12.2041	17.505	0,00 %
Lincoln National Corp.	14.000	6,15 %	07.04.2036	17.307	0,00 %
Ally Auto Receivables Trust 2015	16.212	1,39 %	16.09.2019	16.199	0,00 %
World Omni Auto Receivables Trust 2014	16.216	1,14 %	15.01.2020	16.193	0,00 %
AEP Texas Central Transition Funding II LLC	16.010	5,17 %	01.01.2018	16.013	0,00 %
Masco Corp.	13.000	7,13 %	15.03.2020	14.191	0,00 %
Honda Auto Receivables 2015-2 Owner Trust	13.071	1,04 %	21.02.2019	13.044	0,00 %
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013	12.756	3,22 %	15.09.2046	12.830	0,00 %
Ford Credit Auto Owner Trust 2015	11.563	1,28 %	15.09.2019	11.551	0,00 %
TIAA Seasoned Commercial Mortgage Trust 2007 [^]	10.992	5,48 %	15.08.2039	10.984	0,00 %
Kinder Morgan Energy Partners LP	10.000	9,00 %	01.02.2019	10.660	0,00 %
Ally Auto Receivables Trust 2014	10.106	1,28 %	17.06.2019	10.102	0,00 %
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013	10.000	3,21 %	15.02.2046	10.040	0,00 %
New York Life Global Funding	10.000	2,15 %	18.06.2019	10.017	0,00 %
Nissan Auto Receivables 2014-B Owner Trust	7.274	1,11 %	15.05.2019	7.268	0,00 %
BMW Vehicle Lease Trust 2015	6.521	1,40 %	20.09.2018	6.520	0,00 %
Federal National Mortgage Association	6.075	1,63 %	25.02.2018	6.067	0,00 %
CCRE12 Commercial Mortgage Trust 2013	6.066	1,30 %	10.10.2046	6.055	0,00 %
Honda Auto Receivables 2015-1 Owner Trust	5.201	1,05 %	15.10.2018	5.200	0,00 %
CarMax Auto Owner Trust 2014	4.891	1,16 %	17.06.2019	4.889	0,00 %
				1.194.963.851	59,91 %

Nicht-US-Bonds**Australien 1,85 % (2016: 2,05 %)**

National Australia Bank Ltd.	1.125.000	2,25 %	16.03.2021	1.115.385	0,06 %
Commonwealth Bank of Australia	850.000	2,13 %	22.07.2020	843.846	0,04 %
Westpac Banking Corp. [^]	800.000	4,32 %	23.11.2031	821.644	0,04 %
WEA Finance LLC/Westfield UK & Europe Finance plc	800.000	3,75 %	17.09.2024	820.767	0,04 %
BHP Billiton Finance USA Ltd. [^]	600.000	6,75 %	19.10.2075	700.500	0,04 %
Westpac Banking Corp.	600.000	2,30 %	26.05.2020	598.618	0,03 %
Macquarie Bank Ltd.	550.000	3,90 %	15.01.2026	569.794	0,03 %
Macquarie Group Ltd. [^]	560.000	3,76 %	28.11.2028	557.838	0,03 %
Woodside Finance Ltd.	550.000	3,65 %	05.03.2025	553.628	0,03 %
National Australia Bank Ltd.	550.000	2,00 %	14.01.2019	548.755	0,03 %
APT Pipelines Ltd.	500.000	4,20 %	23.03.2025	519.086	0,03 %
Commonwealth Bank of Australia	500.000	3,90 %	12.07.2047	508.488	0,03 %
Macquarie Group Ltd. [^]	510.000	3,19 %	28.11.2023	506.426	0,03 %
National Australia Bank Ltd.	500.000	2,80 %	10.01.2022	501.991	0,03 %
Commonwealth Bank of Australia	500.000	2,75 %	10.03.2022	501.471	0,03 %
National Australia Bank Ltd.	500.000	2,25 %	01.07.2019	500.124	0,03 %
National Australia Bank Ltd.	500.000	2,25 %	10.01.2020	498.833	0,03 %
Westpac Banking Corp.	500.000	1,85 %	26.11.2018	498.111	0,02 %
Westpac Banking Corp.	500.000	2,15 %	06.03.2020	497.581	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
BHP Billiton Finance USA Ltd.	400.000	5,00 %	30.09.2043	487.051	0,02 %
Commonwealth Bank of Australia	500.000	2,63 %	06.09.2026	477.830	0,02 %
Barrick PD Australia Finance Pty Ltd.	375.000	5,95 %	15.10.2039	465.469	0,02 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.	425.000	3,85 %	30.09.2023	450.248	0,02 %
Commonwealth Bank of Australia	420.000	5,00 %	15.10.2019	439.515	0,02 %
Westpac Banking Corp.	425.000	2,25 %	17.01.2019	425.637	0,02 %
Macquarie Bank Ltd.	400.000	4,88 %	10.06.2025	422.194	0,02 %
Westpac Banking Corp.	400.000	2,75 %	11.01.2023	398.599	0,02 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	400.000	2,05 %	23.09.2019	398.094	0,02 %
Westpac Banking Corp.	400.000	2,10 %	13.05.2021	394.554	0,02 %
Commonwealth Bank of Australia	400.000	2,85 %	18.05.2026	389.937	0,02 %
Transurban Finance Co. Pty Ltd.	360.000	4,13 %	02.02.2026	369.450	0,02 %
Commonwealth Bank of Australia	350.000	2,05 %	15.03.2019	349.159	0,02 %
Westpac Banking Corp.	350.000	1,60 %	19.08.2019	346.143	0,02 %
Westpac Banking Corp.	350.000	2,00 %	19.08.2021	343.548	0,02 %
Macquarie Bank Ltd.	300.000	6,63 %	07.04.2021	332.398	0,02 %
Westpac Banking Corp.	325.000	3,35 %	08.03.2027	327.695	0,02 %
SGSP Australia Assets Pty Ltd.	325.000	3,30 %	09.04.2023	326.677	0,02 %
Rio Tinto Finance USA plc	300.000	4,13 %	21.08.2042	322.533	0,02 %
Rio Tinto Finance USA Ltd.	290.000	3,75 %	15.06.2025	303.740	0,02 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	300.000	2,70 %	16.11.2020	301.573	0,02 %
Westpac Banking Corp.	300.000	2,60 %	23.11.2020	301.169	0,02 %
Macquarie Bank Ltd.	300.000	2,35 %	15.01.2019	300.050	0,02 %
Commonwealth Bank of Australia	300.000	2,25 %	10.03.2020	299.303	0,02 %
Macquarie Bank Ltd.	300.000	2,40 %	21.01.2020	299.289	0,02 %
Westpac Banking Corp.	300.000	2,00 %	21.05.2019	299.075	0,02 %
Westpac Banking Corp.	300.000	2,25 %	09.11.2020	298.199	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	300.000	2,55 %	23.11.2021	298.184	0,01 %
Westpac Banking Corp.	300.000	2,50 %	28.06.2022	297.798	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	300.000	2,13 %	22.05.2020	297.757	0,01 %
Rio Tinto Finance USA Ltd.	225.000	7,13 %	15.07.2028	296.699	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	300.000	2,00 %	06.09.2021	293.677	0,01 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.	275.000	4,13 %	24.02.2042	292.916	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	275.000	3,70 %	16.11.2025	288.901	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	275.000	2,25 %	13.06.2019	275.064	0,01 %
Westpac Banking Corp.	250.000	4,88 %	19.11.2019	261.603	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	250.000	4,50 %	09.12.2025	261.109	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	250.000	4,40 %	19.05.2026	259.858	0,01 %
WEA Finance LLC	250.000	3,15 %	05.04.2022	252.688	0,01 %
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd.	250.000	3,63 %	28.04.2026	251.970	0,01 %
Scentre Group Trust 1/Scentre Group Trust 2	250.000	2,38 %	05.11.2019	249.408	0,01 %
Woodside Finance Ltd.	250.000	3,70 %	15.03.2028	248.635	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	250.000	2,13 %	19.08.2020	247.822	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	250.000	2,50 %	22.05.2022	247.587	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	250.000	1,60 %	15.07.2019	247.552	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	250.000	2,30 %	01.06.2021	247.526	0,01 %
GAIF Bond Issuer Pty Ltd.	250.000	3,40 %	30.09.2026	245.242	0,01 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.	200.000	6,42 %	01.03.2026	244.885	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	225.000	5,00 %	19.03.2020	237.123	0,01 %
Macquarie Bank Ltd.	225.000	4,00 %	29.07.2025	234.790	0,01 %
Rio Tinto Finance USA Ltd.	225.000	3,75 %	20.09.2021	233.816	0,01 %
Macquarie Bank Ltd.	225.000	2,85 %	29.07.2020	226.171	0,01 %
Macquarie Bank Ltd.	225.000	2,85 %	15.01.2021	225.880	0,01 %
Westpac Banking Corp.^	225.000	3,63 %	28.02.2023	225.531	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	225.000	2,25 %	09.11.2020	223.649	0,01 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	225.000	2,63 %	09.11.2022	223.578	0,01 %
Westpac Banking Corp.	225.000	1,65 %	13.05.2019	223.339	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	225.000	2,05 %	18.09.2020	222.484	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	225.000	1,38 %	12.07.2019	222.221	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	225.000	1,88 %	12.07.2021	219.430	0,01 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.^	200.000	6,25 %	19.10.2075	216.500	0,01 %
Westpac Banking Corp.	225.000	2,70 %	19.08.2026	216.170	0,01 %
Rio Tinto Finance USA Ltd.	205.000	4,13 %	20.05.2021	215.086	0,01 %
AusNet Services Holdings Pty Ltd.^	200.000	5,75 %	17.03.2076	215.046	0,01 %
Telstra Corp., Ltd.	200.000	4,80 %	12.10.2021	214.375	0,01 %
Incitec Pivot Finance LLC	200.000	6,00 %	10.12.2019	211.916	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	200.000	4,50 %	19.03.2024	209.651	0,01 %
Brambles USA, Inc.	200.000	4,13 %	23.10.2025	206.607	0,01 %
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd.	200.000	3,90 %	22.03.2023	206.338	0,01 %
WEA Finance LLC/Westfield UK & Europe Finance plc	200.000	3,25 %	05.10.2020	203.596	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	200.000	3,38 %	14.01.2026	202.964	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	200.000	2,63 %	23.07.2020	201.014	0,01 %
Woodside Finance Ltd.	200.000	3,70 %	15.09.2026	199.926	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	200.000	2,55 %	15.03.2021	199.784	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	200.000	2,40 %	02.11.2020	199.513	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	200.000	2,00 %	18.06.2019	199.277	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	200.000	1,75 %	07.11.2019	198.048	0,01 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.	196.000	2,88 %	24.02.2022	197.987	0,01 %
Westpac Banking Corp.	200.000	2,10 %	25.02.2021	197.539	0,01 %
Amcor Finance USA, Inc.	200.000	3,63 %	28.04.2026	197.172	0,01 %
QBE Capital Funding III Ltd.^	175.000	7,25 %	24.05.2041	194.250	0,01 %
Newcrest Finance Pty Ltd.	185.000	4,20 %	01.10.2022	191.799	0,01 %
Rio Tinto Finance USA Ltd.	150.000	5,20 %	02.11.2040	182.278	0,01 %
Telstra Corp., Ltd.	175.000	3,13 %	07.04.2025	175.114	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	175.000	2,30 %	06.09.2019	175.046	0,01 %
Scentre Group Trust 1/Scentre Group Trust 2	175.000	3,25 %	28.10.2025	172.175	0,01 %
Goodman US Finance Four LLC	150.000	4,50 %	15.10.2037	155.507	0,01 %
Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd.	150.000	3,38 %	30.04.2025	149.350	0,01 %
Suncorp-Metway Ltd.	150.000	2,38 %	09.11.2020	149.063	0,01 %
Transurban Finance Co. Pty Ltd.	150.000	3,38 %	22.03.2027	146.165	0,01 %
Scentre Group Trust 1/Scentre Group Trust 2	125.000	3,75 %	23.03.2027	126.250	0,01 %
Suncorp-Metway Ltd.	125.000	2,35 %	27.04.2020	124.398	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	125.000	2,50 %	18.09.2022	123.655	0,01 %
Rio Tinto Finance USA plc	100.000	4,75 %	22.03.2042	115.578	0,01 %
Commonwealth Bank of Australia	115.000	3,15 %	19.09.2027	113.343	0,01 %
APT Pipelines Ltd.	100.000	4,25 %	15.07.2027	103.460	0,01 %
National Australia Bank Ltd.	100.000	2,13 %	09.09.2019	99.771	0,01 %
Westpac Banking Corp.	100.000	2,00 %	03.03.2020	99.153	0,00 %
Macquarie Group Ltd.	80.000	7,63 %	13.08.2019	86.322	0,00 %
Newcrest Finance Pty Ltd.	75.000	5,75 %	15.11.2041	85.358	0,00 %
Virgin Australia 2013-1A Pass Through Trust	54.652	5,00 %	23.10.2023	56.839	0,00 %
BHP Billiton Finance USA Ltd.	50.000	3,25 %	21.11.2021	51.333	0,00 %
Rio Tinto Finance USA plc	9.000	2,88 %	21.08.2022	9.051	0,00 %
				36.850.675	1,85 %
Österreich 0,10 % (2016: 0,11 %)					
Oesterreichische Kontrollbank AG	600.000	1,63 %	12.03.2019	597.828	0,03 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	475.000	1,13 %	26.04.2019	469.129	0,02 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	300.000	2,38 %	01.10.2021	300.426	0,02 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	300.000	1,50 %	21.10.2020	294.413	0,01 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	200.000	1,38 %	10.02.2020	196.752	0,01 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	100.000	1,75 %	24.01.2020	99.260	0,01 %
Oesterreichische Kontrollbank AG	100.000	1,88 %	20.01.2021	98.888	0,00 %
				2.056.696	0,10 %
Belgien 0,24 % (2016: 0,24 %)					
Kingdom of Belgium Government International Bond	1.000.000	1,13 %	03.08.2019	984.960	0,05 %
Dexia Credit Local SA	750.000	2,38 %	20.09.2022	740.749	0,04 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	675.000	3,75 %	15.01.2022	704.676	0,04 %
Dexia Credit Local SA	500.000	2,25 %	18.02.2020	498.769	0,03 %
Belgium Government International Bond	450.000	2,88 %	18.09.2024	455.783	0,02 %
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	375.000	4,95 %	15.01.2042	434.526	0,02 %
Solvay Finance America LLC	375.000	3,40 %	03.12.2020	381.898	0,02 %
Koninklijke Ahold Delhaize NV	253.000	5,70 %	01.10.2040	297.779	0,01 %
Dexia Credit Local SA	250.000	1,88 %	15.09.2021	244.120	0,01 %
				4.743.260	0,24 %
Bermuda 0,08 % (2016: 0,10 %)					
Bermuda Government International Bond	500.000	3,72 %	25.01.2027	500.180	0,03 %
Bermuda Government International Bond	250.000	4,14 %	03.01.2023	262.236	0,01 %
Allied World Assurance Co. Holdings Ltd.	175.000	4,35 %	29.10.2025	175.509	0,01 %
Bacardi Ltd.	150.000	2,75 %	15.07.2026	143.211	0,01 %
Bermuda Government International Bond	100.000	4,85 %	06.02.2024	108.083	0,01 %
Wilton Re Finance LLC^	100.000	5,88 %	30.03.2033	105.372	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Montpelier Re Holdings Ltd.	75.000	4,70 %	15.10.2022	78.879	0,00 %
Enstar Group Ltd.	75.000	4,50 %	10.03.2022	76.500	0,00 %
RenaissanceRe Finance, Inc.	75.000	3,45 %	01.07.2027	73.390	0,00 %
				1.523.360	0,08 %
Brasilien 0,39 % (2016: 0,33 %)					
Vale Overseas Ltd.	675.000	6,88 %	21.11.2036	827.719	0,04 %
Vale Overseas Ltd.	600.000	4,38 %	11.01.2022	621.000	0,03 %
Vale SA	525.000	5,63 %	11.09.2042	574.875	0,03 %
GTL Trade Finance, Inc./Gerdau Holdings, Inc.	534.000	5,89 %	29.04.2024	572.048	0,03 %
Braskem Netherlands Finance BV	500.000	4,50 %	10.01.2028	492.692	0,02 %
Vale Overseas Ltd.	450.000	5,88 %	10.06.2021	491.063	0,02 %
Vale Overseas Ltd.	400.000	6,25 %	10.08.2026	463.500	0,02 %
Vale Overseas Ltd.	325.000	6,88 %	10.11.2039	397.313	0,02 %
Braskem America Finance Co.	250.000	7,13 %	22.07.2041	298.125	0,01 %
Vale Overseas Ltd.	225.000	8,25 %	17.01.2034	297.844	0,01 %
Fibra Overseas Finance Ltd.	200.000	5,50 %	17.01.2027	214.500	0,01 %
Braskem Finance Ltd.	200.000	5,75 %	15.04.2021	212.750	0,01 %
Gerdau Trade, Inc.	200.000	5,75 %	30.01.2021	212.750	0,01 %
Embraer Netherlands Finance BV	200.000	5,05 %	15.06.2025	212.424	0,01 %
Raizen Fuels Finance SA	200.000	5,30 %	20.01.2027	209.139	0,01 %
Gerdau Trade, Inc.	200.000	4,88 %	24.10.2027	199.686	0,01 %
BRF SA	200.000	3,95 %	22.05.2023	197.750	0,01 %
BRF GmbH	200.000	4,35 %	29.09.2026	193.000	0,01 %
Braskem Finance Ltd.	150.000	6,45 %	03.02.2024	167.812	0,01 %
Embraer Netherlands Finance BV	150.000	5,40 %	01.02.2027	161.768	0,01 %
Fibra Overseas Finance Ltd.	150.000	5,25 %	12.05.2024	160.500	0,01 %
Embraer Overseas Ltd.	125.000	5,70 %	16.09.2023	137.278	0,01 %
Embraer SA	125.000	5,15 %	15.06.2022	133.192	0,01 %
Vale Overseas Ltd.	125.000	4,63 %	15.09.2020	132.344	0,01 %
Gerdau Trade, Inc.	100.000	4,75 %	15.04.2023	102.000	0,01 %
Fibra Overseas Finance Ltd.	100.000	4,00 %	14.01.2025	99.174	0,01 %
				7.782.246	0,39 %
Kanada 3,51 % (2016: 3,49 %)					
Province Ontario Kanada	1.200.000	1,63 %	18.01.2019	1.195.835	0,06 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	1.000.000	2,55 %	16.06.2022	993.129	0,05 %
Province Ontario Kanada	950.000	2,00 %	30.01.2019	950.266	0,05 %
Provinz Quebec (Kanada)	850.000	2,75 %	25.08.2021	858.982	0,04 %
Province Ontario Kanada	825.000	4,00 %	07.10.2019	851.028	0,04 %
Toronto-Dominion Bank	800.000	2,25 %	25.09.2019	800.082	0,04 %
Province of Alberta Canada	850.000	2,05 %	17.08.2026	797.429	0,04 %
Province Ontario Kanada	750.000	4,40 %	14.04.2020	785.818	0,04 %
Canada Government International Bond	735.000	1,63 %	27.02.2019	733.346	0,04 %
Provinz Britisch-Kolumbien	725.000	2,65 %	22.09.2021	732.568	0,04 %
Toronto-Dominion Bank	700.000	2,13 %	02.07.2019	700.842	0,04 %
Toronto-Dominion Bank	700.000	2,13 %	07.04.2021	693.232	0,03 %
Province Ontario Kanada	700.000	2,25 %	18.05.2022	692.647	0,03 %
Canada Government International Bond	700.000	2,00 %	15.11.2022	690.227	0,03 %
Provinz Quebec (Kanada)	650.000	2,88 %	16.10.2024	656.816	0,03 %
CDP Financial, Inc.	625.000	4,40 %	25.11.2019	650.211	0,03 %
Toronto-Dominion Bank	650.000	2,25 %	15.03.2021	645.325	0,03 %
Province Ontario Kanada	600.000	2,50 %	10.09.2021	601.063	0,03 %
Toronto-Dominion Bank^	600.000	3,63 %	15.09.2031	599.087	0,03 %
Bank of Montreal^	600.000	3,80 %	15.12.2032	598.853	0,03 %
Royal Bank of Canada	600.000	2,13 %	02.03.2020	597.550	0,03 %
Provinz Quebec (Kanada)	600.000	2,50 %	20.04.2026	588.733	0,03 %
Suncor Energy, Inc.	440.000	6,50 %	15.06.2038	587.906	0,03 %
Encana Corp.	450.000	7,38 %	01.11.2031	578.592	0,03 %
Bank of Montreal	575.000	2,10 %	12.12.2019	572.858	0,03 %
Export Development Canada	550.000	1,50 %	26.05.2021	537.201	0,03 %
Agrium, Inc.	525.000	3,15 %	01.10.2022	530.655	0,03 %
TransCanada PipeLines Ltd.	525.000	2,50 %	01.08.2022	520.620	0,03 %
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust	500.000	3,88 %	20.03.2027	510.505	0,03 %
Air Canada 2017-1 Klasse AA Pass Through Trust	500.000	3,30 %	15.01.2030	505.224	0,03 %
Manulife Financial Corp.	475.000	4,90 %	17.09.2020	502.466	0,03 %
Royal Bank of Canada	500.000	2,50 %	19.01.2021	500.804	0,03 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Bank of Nova Scotia	475.000	4,50 %	16.12.2025	499.814	0,03 %
Royal Bank of Canada	500.000	2,20 %	23.09.2019	499.464	0,03 %
Toronto-Dominion Bank	500.000	2,50 %	18.01.2022	498.750	0,02 %
Province Ontario Kanada	500.000	2,45 %	29.06.2022	498.424	0,02 %
National Bank of Canada	500.000	2,15 %	12.06.2020	497.650	0,02 %
CPPIB Capital, Inc.	500.000	2,25 %	25.01.2022	496.829	0,02 %
Export Development Canada	500.000	1,63 %	17.01.2020	495.787	0,02 %
Royal Bank of Canada	500.000	1,50 %	29.07.2019	494.595	0,02 %
CPPIB Capital, Inc.	500.000	1,25 %	20.09.2019	492.687	0,02 %
Bank of Montreal	500.000	2,50 %	11.01.2022	488.833	0,02 %
Bank of Nova Scotia	500.000	1,88 %	20.09.2021	487.851	0,02 %
Hydro-Quebec	400.000	8,40 %	15.01.2022	483.256	0,02 %
Cenovus Energy, Inc.	400.000	6,75 %	15.11.2039	477.500	0,02 %
TransCanada PipeLines Ltd.	450.000	3,75 %	16.10.2023	470.600	0,02 %
Bank of Nova Scotia	450.000	1,65 %	14.06.2019	446.599	0,02 %
TransCanada PipeLines Ltd.	400.000	4,63 %	01.03.2034	446.564	0,02 %
Province of Alberta Canada	450.000	2,20 %	26.07.2022	443.544	0,02 %
Provinz Quebec (Kanada)	300.000	7,50 %	15.09.2029	424.890	0,02 %
Royal Bank of Canada	425.000	2,30 %	22.03.2021	423.567	0,02 %
Agrium, Inc.	375.000	4,90 %	01.06.2043	418.026	0,02 %
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	400.000	4,00 %	15.12.2026	414.612	0,02 %
Canadian Natural Resources Ltd.	400.000	3,45 %	15.11.2021	409.682	0,02 %
Canadian Natural Resources Ltd.	325.000	6,25 %	15.03.2038	405.208	0,02 %
Hydro-Quebec	275.000	8,50 %	01.12.2029	405.104	0,02 %
Federation des Caisses Desjardins du Quebec	400.000	2,25 %	30.10.2020	397.618	0,02 %
Cenovus Energy, Inc.	400.000	4,25 %	15.04.2027	397.000	0,02 %
Bank of Montreal	400.000	1,50 %	18.07.2019	396.179	0,02 %
CDP Financial, Inc.	300.000	5,60 %	25.11.2039	393.390	0,02 %
Provinz Britisch-Kolumbien	400.000	2,00 %	23.10.2022	392.154	0,02 %
Bank of Montreal	400.000	1,90 %	27.08.2021	391.471	0,02 %
TransCanada PipeLines Ltd.	300.000	5,85 %	15.03.2036	375.994	0,02 %
Encana Corp.	300.000	6,50 %	15.08.2034	371.118	0,02 %
Royal Bank of Canada	325.000	4,65 %	27.01.2026	350.246	0,02 %
Bank of Nova Scotia	350.000	2,35 %	21.10.2020	349.156	0,02 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	350.000	2,25 %	21.07.2020	348.802	0,02 %
Provinz Quebec (Kanada)	350.000	2,75 %	12.04.2027	347.313	0,02 %
Royal Bank of Canada	350.000	2,10 %	14.10.2020	346.638	0,02 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	350.000	1,60 %	06.09.2019	346.203	0,02 %
Province of Alberta Canada	350.000	1,75 %	26.08.2020	344.912	0,02 %
Cenovus Energy, Inc.	325.000	5,40 %	15.06.2047	339.625	0,02 %
Provinz Quebec (Kanada)	275.000	7,13 %	09.02.2024	338.310	0,02 %
Thomson Reuters Corp.	275.000	5,65 %	23.11.2043	330.982	0,02 %
Emera US Finance LP	300.000	4,75 %	15.06.2046	329.155	0,02 %
Bank of Nova Scotia	325.000	2,80 %	21.07.2021	327.577	0,02 %
Toronto-Dominion Bank	325.000	2,25 %	05.11.2019	325.386	0,02 %
Bank of Nova Scotia	325.000	1,85 %	14.04.2020	321.458	0,02 %
Rogers Communications, Inc.	275.000	5,00 %	15.03.2044	315.773	0,02 %
Petro-Canada	225.000	6,80 %	15.05.2038	308.564	0,02 %
Canadian Natural Resources Ltd.	300.000	3,85 %	01.06.2027	306.309	0,02 %
Goldcorp, Inc.	300.000	3,63 %	09.06.2021	306.122	0,02 %
Bank of Nova Scotia	300.000	1,95 %	15.01.2019	299.868	0,02 %
Royal Bank of Canada	300.000	2,35 %	30.10.2020	299.759	0,02 %
Bank of Nova Scotia	300.000	2,13 %	11.09.2019	298.919	0,01 %
Export Development Canada	300.000	1,63 %	03.12.2019	297.876	0,01 %
Royal Bank of Canada	300.000	2,15 %	26.10.2020	297.733	0,01 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	300.000	2,10 %	05.10.2020	297.456	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	225.000	6,20 %	15.10.2037	296.478	0,01 %
Canadian National Railway Co.	300.000	2,75 %	01.03.2026	296.433	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	250.000	5,00 %	16.10.2043	295.644	0,01 %
Ontario Teachers' Finance Trust	300.000	2,13 %	19.09.2022	294.308	0,01 %
Province of Manitoba Canada	300.000	2,10 %	06.09.2022	293.761	0,01 %
Alimentation Couche-Tard, Inc.	295.000	2,70 %	26.07.2022	291.438	0,01 %
Bank of Montreal	300.000	1,75 %	15.06.2021	291.397	0,01 %
Export Development Canada	300.000	1,38 %	21.10.2021	290.438	0,01 %
Cenovus Energy, Inc.	275.000	5,70 %	15.10.2019	289.094	0,01 %
Rio Tinto Alcan, Inc.	225.000	6,13 %	15.12.2033	282.996	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Cenovus Energy, Inc.	275.000	3,80 %	15.09.2023	280.844	0,01 %
Canadian Pacific Railway Co.	200.000	7,13 %	15.10.2031	274.095	0,01 %
Rogers Communications, Inc.	255.000	4,50 %	15.03.2043	272.847	0,01 %
Magna International, Inc.	260.000	3,63 %	15.06.2024	268.314	0,01 %
Fortis Inc	275.000	3,06 %	04.10.2026	265.375	0,01 %
Canadian Natural Resources Ltd.	225.000	5,85 %	01.02.2035	264.361	0,01 %
Manulife Financial Corp.	250.000	4,15 %	04.03.2026	263.917	0,01 %
Canadian Pacific Railway Co.	200.000	6,13 %	15.09.2115	263.615	0,01 %
Barrick Gold Corp.	225.000	5,25 %	01.04.2042	262.830	0,01 %
Encana Corp.	250.000	6,50 %	15.05.2019	262.538	0,01 %
Hydro-Quebec	200.000	8,05 %	07.07.2024	258.374	0,01 %
Province of Manitoba Canada	250.000	3,05 %	14.05.2024	254.785	0,01 %
CDP Financial, Inc.	250.000	3,15 %	24.07.2024	253.938	0,01 %
Agrium, Inc.	250.000	3,38 %	15.03.2025	250.795	0,01 %
Provinz Quebec (Kanada)	250.000	2,63 %	13.02.2023	250.476	0,01 %
Alimentation Couche-Tard, Inc.	250.000	3,55 %	26.07.2027	249.705	0,01 %
Manulife Financial Corp.	200.000	5,38 %	04.03.2046	249.601	0,01 %
Bank of Nova Scotia	250.000	2,70 %	07.03.2022	249.557	0,01 %
CPPIB Capital, Inc.	250.000	2,75 %	02.11.2027	249.258	0,01 %
Province Ontario Kanada	250.000	2,40 %	08.02.2022	249.177	0,01 %
Export Development Canada	250.000	1,75 %	19.08.2019	249.149	0,01 %
Royal Bank of Canada	250.000	2,15 %	06.03.2020	248.948	0,01 %
Bank of Nova Scotia	250.000	2,15 %	14.07.2020	248.906	0,01 %
Canadian Natural Resources Ltd.	250.000	2,95 %	15.01.2023	248.554	0,01 %
Export Development Canada	250.000	1,50 %	04.04.2019	248.419	0,01 %
National Bank of Canada	250.000	2,20 %	02.11.2020	248.101	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	250.000	1,45 %	13.08.2019	247.269	0,01 %
Canadian Imperial Bank of Commerce	250.000	2,35 %	27.07.2022	246.742	0,01 %
Province Ontario Kanada	250.000	2,50 %	27.04.2026	244.931	0,01 %
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	200.000	5,88 %	01.12.2036	244.187	0,01 %
Toronto-Dominion Bank	250.000	1,80 %	13.07.2021	244.169	0,01 %
Fortis, Inc.	250.000	2,10 %	04.10.2021	243.849	0,01 %
Enbridge, Inc.	200.000	5,50 %	01.12.2046	240.478	0,01 %
Husky Energy, Inc.	225.000	3,95 %	15.04.2022	232.951	0,01 %
Provinz Quebec (Kanada)	225.000	3,50 %	29.07.2020	232.108	0,01 %
Canadian Pacific Railway Co.	180.000	5,95 %	15.05.2037	231.439	0,01 %
Repsol Oil & Gas Canada, Inc.	225.000	3,75 %	01.02.2021	226.406	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	200.000	4,88 %	15.01.2026	224.249	0,01 %
Export Development Canada	225.000	2,00 %	30.11.2020	224.121	0,01 %
Thomson Reuters Corp.	225.000	3,35 %	15.05.2026	223.137	0,01 %
Bank of Montreal	225.000	2,55 %	06.11.2022	222.619	0,01 %
Manulife Financial Corp.^	220.000	4,06 %	24.02.2032	221.543	0,01 %
Barrick North America Finance LLC	175.000	5,75 %	01.05.2043	218.499	0,01 %
Barrick North America Finance LLC	175.000	5,70 %	30.05.2041	214.056	0,01 %
Rogers Communications, Inc.	200.000	4,10 %	01.10.2023	210.177	0,01 %
Enbridge, Inc.	200.000	4,25 %	01.12.2026	208.675	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	200.000	3,80 %	01.10.2020	207.232	0,01 %
Husky Energy, Inc.	200.000	4,00 %	15.04.2024	207.222	0,01 %
Goldcorp, Inc.	200.000	3,70 %	15.03.2023	205.130	0,01 %
Cenovus Energy, Inc.	200.000	5,25 %	15.06.2037	205.000	0,01 %
Agrium, Inc.	200.000	3,50 %	01.06.2023	204.107	0,01 %
TransAlta Corp.	200.000	4,50 %	15.11.2022	203.094	0,01 %
Canadian National Railway Co.	150.000	6,25 %	01.08.2034	201.235	0,01 %
Enbridge, Inc.	200.000	3,70 %	15.07.2027	200.406	0,01 %
Emera US Finance LP	200.000	3,55 %	15.06.2026	200.223	0,01 %
Alimentation Couche-Tard, Inc.	200.000	2,35 %	13.12.2019	199.711	0,01 %
Export Development Canada	200.000	1,25 %	04.02.2019	198.559	0,01 %
Enbridge, Inc.	200.000	2,90 %	15.07.2022	198.363	0,01 %
Province Ontario Kanada	200.000	1,65 %	27.09.2019	198.329	0,01 %
Suncor Energy, Inc.	150.000	7,15 %	01.02.2032	197.903	0,01 %
Petro-Canada	150.000	5,95 %	15.05.2035	188.878	0,01 %
Province of Manitoba Canada	200.000	2,13 %	22.06.2026	188.369	0,01 %
Canadian Pacific Railway Co.	175.000	4,45 %	15.03.2023	186.478	0,01 %
Air Canada 2015-1 Klasse A Pass Through Trust	182.399	3,60 %	15.03.2027	184.451	0,01 %
Rio Tinto Alcan, Inc.	150.000	5,75 %	01.06.2035	181.763	0,01 %
Brookfield Finance LLC	175.000	4,00 %	01.04.2024	180.116	0,01 %
Rogers Communications, Inc.	175.000	3,63 %	15.12.2025	178.646	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Enbridge, Inc.	175.000	3,50 %	10.06.2024	175.353	0,01 %
Suncor Energy, Inc.	125.000	6,85 %	01.06.2039	173.148	0,01 %
Alimentation Couche-Tard, Inc.	165.000	4,50 %	26.07.2047	172.365	0,01 %
Canadian Natural Resources Ltd.	150.000	4,95 %	01.06.2047	166.080	0,01 %
Husky Energy, Inc.	125.000	6,80 %	15.09.2037	162.217	0,01 %
Canadian Pacific Railway Co.	150.000	7,25 %	15.05.2019	159.774	0,01 %
Magna International, Inc.	150.000	4,15 %	01.10.2025	159.653	0,01 %
Thomson Reuters Corp.	150.000	4,70 %	15.10.2019	155.868	0,01 %
Suncor Energy, Inc.	150.000	4,00 %	15.11.2047	153.565	0,01 %
Canadian Natural Resources Ltd.	150.000	3,90 %	01.02.2025	153.309	0,01 %
Great-West Lifeco Finance Delaware LP	145.000	4,15 %	03.06.2047	151.469	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	100.000	7,63 %	15.01.2039	150.592	0,01 %
Bank of Montreal	150.000	2,38 %	25.01.2019	150.221	0,01 %
Rogers Communications, Inc.	150.000	3,00 %	15.03.2023	150.106	0,01 %
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	125.000	5,63 %	01.12.2040	149.928	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	150.000	2,13 %	15.11.2019	149.541	0,01 %
Schlumberger Finance Canada Ltd.	150.000	2,20 %	20.11.2020	149.255	0,01 %
Emera US Finance LP	150.000	2,70 %	15.06.2021	149.144	0,01 %
Royal Bank of Canada	150.000	1,63 %	15.04.2019	149.020	0,01 %
Royal Bank of Canada	150.000	1,88 %	05.02.2020	148.667	0,01 %
Province Ontario Kanada	150.000	2,20 %	03.10.2022	147.830	0,01 %
TransCanada PipeLines Ltd.	100.000	7,25 %	15.08.2038	145.447	0,01 %
Thomson Reuters Corp.	125.000	5,50 %	15.08.2035	142.660	0,01 %
TELUS Corp.	150.000	2,80 %	16.02.2027	142.486	0,01 %
Husky Energy, Inc.	125.000	7,25 %	15.12.2019	135.649	0,01 %
Canadian National Railway Co.	100.000	6,20 %	01.06.2036	134.876	0,01 %
Canadian National Railway Co.	100.000	6,90 %	15.07.2028	132.078	0,01 %
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	125.000	4,88 %	30.03.2020	130.663	0,01 %
Enbridge, Inc.	125.000	4,50 %	10.06.2044	128.847	0,01 %
Canadian Natural Resources Ltd.	100.000	6,75 %	01.02.2039	128.116	0,01 %
Barrick North America Finance LLC	121.000	4,40 %	30.05.2021	127.998	0,01 %
Suncor Energy, Inc.	125.000	3,60 %	01.12.2024	127.948	0,01 %
Canadian National Railway Co.	125.000	2,85 %	15.12.2021	126.472	0,01 %
WestJet Airlines Ltd.	125.000	3,50 %	16.06.2021	125.992	0,01 %
Canadian Natural Resources Ltd.	100.000	6,50 %	15.02.2037	124.514	0,01 %
Schlumberger Finance Canada Ltd.	125.000	2,65 %	20.11.2022	124.235	0,01 %
Potash Corp. of Saskatchewan, Inc.	125.000	3,00 %	01.04.2025	121.875	0,01 %
Rogers Communications, Inc.	125.000	2,90 %	15.11.2026	120.858	0,01 %
Provinz Neubraunschweig	120.000	2,50 %	12.12.2022	119.600	0,01 %
Agrium, Inc.	100.000	5,25 %	15.01.2045	116.446	0,01 %
Goldcorp, Inc.	100.000	5,45 %	09.06.2044	115.898	0,01 %
Canadian National Railway Co.	80.000	6,38 %	15.11.2037	111.820	0,01 %
Yamana Gold, Inc.	100.000	4,95 %	15.07.2024	104.375	0,01 %
Canadian National Railway Co.	100.000	5,55 %	01.03.2019	103.766	0,01 %
Brookfield Finance, Inc.	100.000	4,25 %	02.06.2026	103.107	0,01 %
Thomson Reuters Corp.	100.000	3,85 %	29.09.2024	103.025	0,01 %
TELUS Corp.	100.000	3,70 %	15.09.2027	102.254	0,01 %
Brookfield Asset Management, Inc.	100.000	4,00 %	15.01.2025	102.063	0,01 %
Agrium, Inc.	80.000	6,13 %	15.01.2041	101.157	0,01 %
Methanex Corp.	100.000	4,25 %	01.12.2024	101.045	0,01 %
Royal Bank of Canada	100.000	2,75 %	01.02.2022	100.944	0,01 %
Cenovus Energy, Inc.	100.000	5,20 %	15.09.2043	100.500	0,01 %
Methanex Corp.	100.000	3,25 %	15.12.2019	100.294	0,01 %
Yamana Gold, Inc.	100.000	4,63 %	15.12.2027	99.750	0,00 %
Bank of Nova Scotia	100.000	2,05 %	05.06.2019	99.661	0,00 %
Bank of Montreal	100.000	2,10 %	15.06.2020	99.292	0,00 %
Canadian Pacific Railway Co.	100.000	2,90 %	01.02.2025	98.959	0,00 %
CCL Industries, Inc.	100.000	3,25 %	01.10.2026	95.904	0,00 %
Emera US Finance LP	75.000	2,15 %	15.06.2019	74.593	0,00 %
Canadian Natural Resources Ltd.	50.000	7,20 %	15.01.2032	63.424	0,00 %
Canadian Natural Resources Ltd.	50.000	6,45 %	30.06.2033	60.958	0,00 %
Canadian Pacific Railway Co.	50.000	4,80 %	01.08.2045	59.033	0,00 %
Brookfield Finance, Inc.	50.000	4,70 %	20.09.2047	52.353	0,00 %
Export Development Canada	25.000	1,63 %	01.06.2020	24.474	0,00 %
				70.006.602	3,51 %
Kaimaninseln 0,16 % (2016: 0,23 %)					

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
IPIC GMTN Ltd.	1.300.000	5,50 %	01.03.2022	1.429.159	0,07 %
IPIC GMTN Ltd.	400.000	5,00 %	15.11.2020	426.631	0,02 %
ADCB Finance Cayman Ltd.	425.000	2,75 %	16.09.2019	423.929	0,02 %
ADCB Finance Cayman Ltd.	400.000	4,50 %	06.03.2023	419.500	0,02 %
MAF Global Securities Ltd.	200.000	4,75 %	07.05.2024	210.500	0,01 %
ADCB Finance Cayman Ltd.	200.000	2,63 %	10.03.2020	198.498	0,01 %
Lamar Funding Ltd.	200.000	3,96 %	07.05.2025	184.500	0,01 %
				3.292.717	0,16 %
Chile 0,55 % (2016: 0,50 %)					
Corp. Nacional del Cobre de Chile	800.000	4,50 %	13.08.2023	853.344	0,04 %
Chile Government International Bond	646.000	3,13 %	21.01.2026	653.752	0,03 %
Corp. Nacional del Cobre de Chile	500.000	4,88 %	04.11.2044	564.111	0,03 %
Corp. Nacional del Cobre de Chile	500.000	4,50 %	16.09.2025	536.900	0,03 %
Corp. Nacional del Cobre de Chile	425.000	3,00 %	17.07.2022	424.019	0,02 %
Chile Government International Bond	400.000	3,86 %	21.06.2047	411.148	0,02 %
Empresa Nacional del Petroleo	400.000	3,75 %	05.08.2026	397.608	0,02 %
Transelec SA	400.000	3,88 %	12.01.2029	396.826	0,02 %
Chile Government International Bond	375.000	2,25 %	30.10.2022	369.167	0,02 %
Engie Energia Chile SA	350.000	4,50 %	29.01.2025	366.067	0,02 %
Celulosa Arauco y Constitucion SA	300.000	4,75 %	11.01.2022	317.363	0,02 %
Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA	300.000	4,75 %	01.08.2026	312.375	0,02 %
Cencosud SA	298.000	4,88 %	20.01.2023	311.962	0,02 %
Itau CorpBanca	300.000	3,88 %	22.09.2019	306.000	0,02 %
Empresa Nacional del Petroleo	300.000	4,50 %	14.09.2047	287.015	0,01 %
Inversiones CMPC SA	250.000	6,13 %	05.11.2019	266.857	0,01 %
Corp. Nacional del Cobre de Chile	250.000	4,25 %	17.07.2042	259.162	0,01 %
Cencosud SA	225.000	4,38 %	17.07.2027	222.758	0,01 %
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	200.000	5,00 %	25.01.2047	220.083	0,01 %
Cencosud SA	200.000	5,15 %	12.02.2025	212.042	0,01 %
Inversiones CMPC SA	200.000	4,75 %	15.09.2024	211.203	0,01 %
Corp. Nacional del Cobre de Chile	175.000	5,63 %	21.09.2035	209.751	0,01 %
GNL Quintero SA	200.000	4,63 %	31.07.2029	208.414	0,01 %
Celulosa Arauco y Constitucion SA	200.000	5,50 %	02.11.2047	207.980	0,01 %
Banco Santander Chile	200.000	3,88 %	20.09.2022	207.769	0,01 %
Telefonica Chile SA	200.000	3,88 %	12.10.2022	206.064	0,01 %
SACI Falabella	200.000	3,75 %	30.04.2023	204.901	0,01 %
Inversiones CMPC SA	200.000	4,38 %	04.04.2027	204.275	0,01 %
Corp. Nacional del Cobre de Chile	200.000	3,63 %	01.08.2027	200.326	0,01 %
Empresa Electrica Angamos SA	200.000	4,88 %	25.05.2029	199.412	0,01 %
Celulosa Arauco y Constitucion SA	200.000	3,88 %	02.11.2027	197.904	0,01 %
Itau CorpBanca	175.000	3,88 %	22.09.2019	178.536	0,01 %
Enel Americas SA	175.000	4,00 %	25.10.2026	177.796	0,01 %
Banco del Estado de Chile	150.000	3,88 %	08.02.2022	156.195	0,01 %
Latam Airlines 2015-1 Pass Through Trust A	134.724	4,20 %	15.11.2027	136.577	0,01 %
Colbun SA	125.000	3,95 %	11.10.2027	125.352	0,01 %
Empresa Nacional del Petroleo	100.000	4,75 %	06.12.2021	106.125	0,00 %
Celulosa Arauco y Constitucion SA	100.000	4,50 %	01.08.2024	105.440	0,00 %
AES Gener SA	49.000	5,25 %	15.08.2021	51.389	0,00 %
				10.983.968	0,55 %
China 3,02 % (2016: 2,57 %)					
Huarong Finance II Co., Ltd.	1.500.000	2,88 %	22.11.2019	1.486.905	0,07 %
Sinopec Capital 2013 Ltd.	1.100.000	3,13 %	24.04.2023	1.094.756	0,05 %
Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd.	1.050.000	2,50 %	28.04.2020	1.043.326	0,05 %
ICBCIL Finance Co., Ltd.	1.000.000	3,00 %	05.04.2020	997.500	0,05 %
Huarong Finance II Co., Ltd.	1.000.000	3,25 %	03.06.2021	993.750	0,05 %
CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	1.000.000	3,50 %	19.07.2022	992.470	0,05 %
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	1.000.000	1,88 %	23.05.2019	988.740	0,05 %
Sinopec Group Overseas Development 2016 Ltd.	1.000.000	2,00 %	29.09.2021	970.000	0,05 %
China Cinda Finance 2015 I Ltd.	875.000	3,13 %	23.04.2020	872.673	0,04 %
Skysea International Capital Management Ltd.	800.000	4,88 %	07.12.2021	855.104	0,04 %
CNOOC Nexen Finance 2014 ULC	800.000	4,25 %	30.04.2024	843.762	0,04 %
China Construction Bank Asia Corp., Ltd.^	800.000	4,25 %	20.08.2024	812.000	0,04 %
Bank of China Ltd.	800.000	2,88 %	30.06.2020	801.928	0,04 %
Export-Import Bank von China	800.000	2,88 %	26.04.2026	775.880	0,04 %
State Grid Overseas Investment 2014 Ltd.	750.000	2,75 %	07.05.2019	751.868	0,04 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Bank of China Ltd.	700.000	5,00 %	13.11.2024	746.704	0,04 %
China Development Bank	750.000	2,50 %	09.10.2020	743.363	0,04 %
Sinopec Group Overseas Development 2013 Ltd.	700.000	4,38 %	17.10.2023	743.311	0,04 %
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	700.000	4,88 %	21.09.2025	741.139	0,04 %
Huarong Finance II Co., Ltd.	700.000	4,50 %	16.01.2020	714.819	0,04 %
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.	700.000	3,00 %	12.04.2022	699.292	0,03 %
Bank of China Ltd.	600.000	5,00 %	13.11.2024	640.319	0,03 %
CNOOC Finance 2013 Ltd.	625.000	3,00 %	09.05.2023	618.274	0,03 %
Avi Funding Co., Ltd.	600.000	3,80 %	16.09.2025	613.584	0,03 %
State Grid Overseas Investment 2013 Ltd.	600.000	3,13 %	22.05.2023	600.076	0,03 %
Export-Import Bank von China	600.000	2,50 %	31.07.2019	600.036	0,03 %
Bluestar Finance Holdings Ltd.	600.000	3,50 %	30.09.2021	599.952	0,03 %
China Overseas Finance Cayman V Ltd.	570.000	3,95 %	15.11.2022	585.686	0,03 %
BOC Aviation Ltd.	550.000	3,88 %	27.04.2026	554.768	0,03 %
Alibaba Group Holding Ltd.	550.000	2,50 %	28.11.2019	550.691	0,03 %
Alibaba Group Holding Ltd.	550.000	3,40 %	06.12.2027	549.785	0,03 %
Agricultural Bank of China Ltd.	550.000	2,75 %	21.05.2020	548.243	0,03 %
COSL Finance BVI Ltd.	550.000	3,25 %	06.09.2022	546.208	0,03 %
Alibaba Group Holding Ltd.	525.000	3,60 %	28.11.2024	544.682	0,03 %
Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd.	550.000	3,25 %	28.04.2025	543.901	0,03 %
CITIC Ltd.	500.000	6,38 %	10.04.2020	534.375	0,03 %
Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd.	500.000	4,38 %	10.04.2024	530.719	0,03 %
China Cinda Finance 2017 I Ltd.	500.000	4,10 %	09.03.2024	510.800	0,03 %
CNOOC Finance 2015 USA LLC	500.000	3,50 %	05.05.2025	504.035	0,03 %
China Construction Bank Asia Corp., Ltd.	500.000	3,25 %	02.07.2019	503.090	0,03 %
Sunshine Life Insurance Corp., Ltd.	500.000	4,50 %	20.04.2026	500.930	0,03 %
ICBCIL Finance Co., Ltd.	500.000	3,25 %	17.03.2020	500.605	0,03 %
Export-Import Bank von China	500.000	2,50 %	31.07.2019	500.091	0,02 %
China Development Bank	500.000	1,63 %	22.06.2019	493.125	0,02 %
Azure Orbit III International Finance Ltd.	500.000	2,63 %	21.03.2021	491.850	0,02 %
China Development Bank	500.000	2,13 %	01.06.2021	488.065	0,02 %
State Grid Overseas Investment 2014 Ltd.	400.000	4,13 %	07.05.2024	421.502	0,02 %
CNPC HK Overseas Capital Ltd.	400.000	4,50 %	28.04.2021	420.558	0,02 %
Sinochem Overseas Capital Co., Ltd.	400.000	4,50 %	12.11.2020	417.593	0,02 %
Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd.	400.000	3,90 %	17.05.2022	413.564	0,02 %
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.	400.000	4,00 %	04.05.2047	412.352	0,02 %
Hongkong International Qingdao Co., Ltd.	400.000	4,75 %	12.02.2020	408.000	0,02 %
Alibaba Group Holding Ltd.	400.000	3,13 %	28.11.2021	406.181	0,02 %
CNPC General Capital Ltd.	400.000	3,40 %	16.04.2023	405.114	0,02 %
Tencent Holdings Ltd.	400.000	3,38 %	02.05.2019	404.580	0,02 %
China Construction Bank Corp.^	400.000	3,88 %	13.05.2025	403.528	0,02 %
Amber Circle Funding Ltd.	400.000	3,25 %	04.12.2022	403.164	0,02 %
Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.	400.000	3,50 %	30.07.2020	402.500	0,02 %
CITIC Ltd.	400.000	3,70 %	14.06.2026	396.212	0,02 %
Nexen Energy ULC	300.000	6,40 %	15.05.2037	389.986	0,02 %
Huarong Finance II Co., Ltd.^	400.000	2,88 %	14.03.2166	389.272	0,02 %
BOC Aviation Ltd.	400.000	2,38 %	15.09.2021	389.092	0,02 %
CNOOC Finance 2012 Ltd.	350.000	3,88 %	02.05.2022	361.122	0,02 %
China Overseas Finance Cayman VI Ltd.	350.000	4,25 %	08.05.2019	356.122	0,02 %
Tencent Holdings Ltd.	350.000	2,88 %	11.02.2020	352.279	0,02 %
China Shenhua Overseas Capital Co., Ltd.	350.000	3,13 %	20.01.2020	350.438	0,02 %
China Overseas Finance Cayman VI Ltd.	300.000	5,95 %	08.05.2024	340.125	0,02 %
CITIC Ltd.	300.000	6,63 %	15.04.2021	331.125	0,02 %
Huarong Finance II Co., Ltd.	300.000	5,50 %	16.01.2025	324.069	0,02 %
CNOOC Curtis Funding No 1 Pty Ltd.	300.000	4,50 %	03.10.2023	319.267	0,02 %
Alibaba Group Holding Ltd.	300.000	4,20 %	06.12.2047	312.349	0,02 %
CNOOC Finance 2011 Ltd.	300.000	4,25 %	26.01.2021	311.656	0,02 %
COSCO Finance 2011 Ltd.	300.000	4,00 %	03.12.2022	309.795	0,02 %
China Development Bank	300.000	4,00 %	24.01.2037	309.231	0,02 %
China Cinda Finance 2015 I Ltd.	300.000	4,25 %	23.04.2025	307.140	0,02 %
Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.	300.000	4,20 %	27.07.2026	306.471	0,02 %
CITIC Securities Finance MTN Co., Ltd.	300.000	3,50 %	30.10.2019	301.545	0,02 %
China Development Bank	300.000	3,00 %	01.06.2026	293.604	0,01 %
Three Gorges Finance I Cayman Islands Ltd.	300.000	3,15 %	02.06.2026	293.211	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2013 Ltd.	275.000	4,38 %	17.10.2023	292.088	0,01 %
CITIC Ltd.	250.000	6,80 %	17.01.2023	288.437	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Nexen Energy ULC	225.000	5,88 %	10.03.2035	275.354	0,01 %
Sino-Ocean Land Treasure Finance II Ltd.	250.000	4,45 %	04.02.2020	254.063	0,01 %
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	250.000	3,23 %	13.11.2019	251.921	0,01 %
China Life Insurance Co., Ltd.^	250.000	4,00 %	03.07.2075	251.235	0,01 %
Baidu, Inc.	250.000	2,75 %	09.06.2019	250.371	0,01 %
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	250.000	2,91 %	13.11.2020	249.423	0,01 %
Bank of China Ltd.	250.000	3,50 %	20.04.2027	248.772	0,01 %
China Southern Power Grid International Finance BVI Co., Ltd.	250.000	2,75 %	08.05.2022	247.921	0,01 %
Baidu, Inc.	250.000	2,88 %	06.07.2022	247.290	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.	250.000	2,25 %	13.09.2020	246.905	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.	250.000	2,50 %	13.09.2022	244.508	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.	250.000	3,25 %	13.09.2027	244.197	0,01 %
Alibaba Group Holding Ltd.	225.000	4,40 %	06.12.2057	235.297	0,01 %
State Grid Overseas Investment 2014 Ltd.	200.000	4,85 %	07.05.2044	232.441	0,01 %
China Resources Land Ltd.	200.000	6,00 %	27.02.2024	226.824	0,01 %
CNOOC Nexen Finance 2014 ULC	200.000	4,88 %	30.04.2044	225.720	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd.	200.000	4,88 %	17.05.2042	225.273	0,01 %
King Power Capital Ltd.	200.000	5,63 %	03.11.2024	223.250	0,01 %
Nexen Energy ULC	150.000	7,50 %	30.07.2039	221.896	0,01 %
China Cinda Finance 2014 Ltd.	200.000	5,63 %	14.05.2024	221.499	0,01 %
Sino-Ocean Land Treasure Finance I Ltd.	200.000	6,00 %	30.07.2024	220.250	0,01 %
Charming Light Investments Ltd.	200.000	5,00 %	03.09.2024	214.726	0,01 %
Prosperous Ray Ltd.	200.000	4,63 %	12.11.2023	213.212	0,01 %
China Merchants Finance Co., Ltd.	200.000	5,00 %	04.05.2022	212.582	0,01 %
State Grid Overseas Investment 2014 Ltd.	200.000	4,13 %	07.05.2024	210.840	0,01 %
China Resources Gas Group Ltd.	200.000	4,50 %	05.04.2022	210.340	0,01 %
Bank of China Hong Kong Ltd.	200.000	5,55 %	11.02.2020	210.287	0,01 %
Baidu, Inc.	200.000	4,13 %	30.06.2025	207.580	0,01 %
Tencent Holdings Ltd.	200.000	3,80 %	11.02.2025	207.382	0,01 %
China Clean Energy Development Ltd.	200.000	4,00 %	05.11.2025	207.250	0,01 %
Alibaba Group Holding Ltd.	200.000	4,00 %	06.12.2037	206.557	0,01 %
Franshion Brilliant Ltd.	200.000	5,75 %	19.03.2019	206.012	0,01 %
Beijing State-Owned Assets Management Hong Kong Co., Ltd.	200.000	4,13 %	26.05.2025	205.250	0,01 %
CNOOC Finance 2013 Ltd.	200.000	4,25 %	09.05.2043	205.211	0,01 %
Three Gorges Finance I Cayman Islands Ltd.	200.000	3,70 %	10.06.2025	205.074	0,01 %
China Taiping Insurance Holdings Co., Ltd.^	200.000	5,45 %		205.000	0,01 %
Leading Affluence Ltd.	200.000	4,50 %	24.01.2023	204.514	0,01 %
Kunlun Energy Co., Ltd.	200.000	3,75 %	13.05.2025	204.098	0,01 %
Azure Orbit International Finance Ltd.	200.000	3,75 %	06.03.2023	204.032	0,01 %
Bank of Communications Co., Ltd.^	200.000	4,50 %	03.10.2024	203.762	0,01 %
CRCC Yuxiang Ltd.	200.000	3,50 %	16.05.2023	203.080	0,01 %
Semiconductor Manufacturing International Corp.	200.000	4,13 %	07.10.2019	202.000	0,01 %
COSL Singapore Capital Ltd.	200.000	3,50 %	30.07.2020	201.750	0,01 %
Haitong International Finance Holdings Ltd.	200.000	3,95 %	29.10.2018	201.750	0,01 %
Dianjian Haixing Ltd.^	200.000	4,05 %	21.04.2166	201.548	0,01 %
Huarong Finance Co., Ltd.	200.000	4,00 %	17.07.2019	201.508	0,01 %
CRCC Yupeng Ltd.^	200.000	3,95 %	01.02.2166	201.012	0,01 %
Bank of China Ltd.	200.000	3,13 %	23.01.2019	200.990	0,01 %
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.	200.000	3,50 %	04.05.2027	200.967	0,01 %
China Development Bank	200.000	3,38 %	24.01.2027	200.820	0,01 %
Sinochem Offshore Capital Co., Ltd.	200.000	3,25 %	29.04.2019	200.785	0,01 %
Azure Nova International Finance Ltd.	200.000	3,50 %	21.03.2022	200.764	0,01 %
Baidu, Inc.	200.000	3,00 %	30.06.2020	200.750	0,01 %
JD.com, Inc.	200.000	3,88 %	29.04.2026	200.706	0,01 %
CITIC Ltd.	200.000	3,88 %	28.02.2027	199.578	0,01 %
CCCI Treasure Ltd.^	200.000	3,50 %	21.10.2166	199.496	0,01 %
CNOOC Finance 2015 Australia Pty Ltd.	200.000	2,63 %	05.05.2020	199.259	0,01 %
Avi Funding Co., Ltd.	200.000	2,85 %	16.09.2020	198.787	0,01 %
Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd.	200.000	4,00 %	13.09.2047	198.486	0,01 %
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.	200.000	2,75 %	04.05.2022	198.019	0,01 %
CNRC Capitale Ltd.^	200.000	3,90 %	02.12.2166	198.000	0,01 %
Baidu, Inc.	200.000	3,63 %	06.07.2027	197.473	0,01 %
Azure Nova International Finance Ltd.	200.000	2,25 %	01.11.2019	196.770	0,01 %
ICBCIL Finance Co., Ltd.	200.000	2,75 %	19.05.2021	196.540	0,01 %
China Great Wall International Holdings III Ltd.	200.000	2,63 %	27.10.2021	194.762	0,01 %
Charming Light Investments Ltd.	200.000	2,38 %	30.08.2021	193.202	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Industrial & Commercial Bank of China Asia Ltd.	125.000	5,13 %	30.11.2020	131.577	0,01 %
Sinochem Overseas Capital Co., Ltd.	100.000	6,30 %	12.11.2040	130.944	0,01 %
CNOOC Finance 2011 Ltd.	100.000	5,75 %	26.01.2041	124.394	0,01 %
CNOOC Finance 2012 Ltd.	100.000	5,00 %	02.05.2042	113.539	0,01 %
Alibaba Group Holding Ltd.	100.000	4,50 %	28.11.2034	109.801	0,01 %
Nexen Energy ULC	100.000	6,20 %	30.07.2019	105.265	0,01 %
Sinochem Global Capital Co., Ltd.^	100.000	5,00 %	02.11.2166	101.250	0,00 %
State Elite Global Ltd.	100.000	3,13 %	20.01.2020	100.257	0,00 %
Mega Advance Investments Ltd.	50.000	5,00 %	12.05.2021	52.884	0,00 %
Alibaba Group Holding Ltd.	50.000	2,80 %	06.06.2023	49.714	0,00 %
Three Gorges Finance I Cayman Islands Ltd.	50.000	2,30 %	02.06.2021	49.189	0,00 %
CNPC General Capital Ltd.	25.000	2,75 %	14.05.2019	25.035	0,00 %
				60.137.222	3,02 %
Kolumbien 0,50 % (2016: 0,52 %)					
Colombia Government International Bond	1.500.000	5,00 %	15.06.2045	1.586.250	0,08 %
Colombia Government International Bond	800.000	3,88 %	25.04.2027	814.420	0,04 %
Ecopetrol SA	750.000	5,88 %	28.05.2045	761.250	0,04 %
Colombia Government International Bond	600.000	11,75 %	25.02.2020	716.052	0,03 %
Ecopetrol SA	625.000	5,88 %	18.09.2023	691.406	0,03 %
Colombia Government International Bond	500.000	4,00 %	26.02.2024	518.000	0,03 %
Ecopetrol SA	400.000	7,63 %	23.07.2019	429.048	0,02 %
Colombia Government International Bond	350.000	6,13 %	18.01.2041	425.688	0,02 %
Colombia Government International Bond	300.000	7,38 %	18.09.2037	405.075	0,02 %
Colombia Government International Bond	325.000	7,38 %	18.03.2019	344.243	0,02 %
Colombia Government International Bond	300.000	5,63 %	26.02.2044	343.500	0,02 %
Colombia Government International Bond	350.000	2,63 %	15.03.2023	342.125	0,02 %
GrupoSura Finance SA	300.000	5,50 %	29.04.2026	325.064	0,02 %
Ecopetrol SA	300.000	5,38 %	26.06.2026	322.500	0,02 %
Colombia Government International Bond	300.000	2,63 %	15.03.2023	293.250	0,01 %
SUAM Finance BV	250.000	4,88 %	17.04.2024	266.594	0,01 %
Bancolumbia SA	225.000	5,95 %	03.06.2021	243.318	0,01 %
Ecopetrol SA	200.000	7,38 %	18.09.2043	239.750	0,01 %
Transportadora de Gas Internacional SA ESP	225.000	5,70 %	20.03.2022	230.704	0,01 %
Colombia Government International Bond	200.000	4,50 %	28.01.2026	213.800	0,01 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA	200.000	4,88 %	21.04.2025	206.342	0,01 %
Colombia Government International Bond	100.000	10,38 %	28.01.2033	157.945	0,01 %
Empresas Publicas de Medellin ESP	125.000	7,63 %	29.07.2019	134.381	0,01 %
				10.010.705	0,50 %
Dänemark 0,14 % (2016: 0,11 %)					
Kommunekredit	1.047.000	1,75 %	10.01.2020	1.040.352	0,05 %
Danske Bank	400.000	2,70 %	02.03.2022	400.075	0,02 %
Danske Bank A/S	300.000	2,80 %	10.03.2021	301.957	0,02 %
Kommunekredit	250.000	1,63 %	01.06.2021	244.663	0,01 %
Danske Bank A/S	225.000	2,75 %	17.09.2020	226.125	0,01 %
AP Moller – Maersk A/S	200.000	2,55 %	22.09.2019	200.287	0,01 %
Danske Bank A/S	200.000	2,20 %	02.03.2020	199.038	0,01 %
Danske Bank	200.000	2,00 %	08.09.2021	195.572	0,01 %
				2.808.069	0,14 %
Ägypten 0,01 % (2016: 0,01 %)					
African Export-Import Bank	200.000	4,75 %	29.07.2019	205.004	0,01 %
				205.004	0,01 %
Finnland 0,19 % (2016: 0,20 %)					
Finland Government International Bond	850.000	1,00 %	23.04.2019	839.495	0,04 %
Municipality Finance plc	775.000	1,13 %	16.09.2019	762.433	0,04 %
Municipality Finance plc	500.000	1,50 %	23.03.2020	492.563	0,03 %
Finland Government International Bond	400.000	1,75 %	10.09.2019	398.551	0,02 %
Finland Government International Bond	400.000	1,50 %	21.09.2020	393.493	0,02 %
Finnvera OYJ	400.000	2,38 %	04.06.2025	387.254	0,02 %
Municipality Finance plc	250.000	1,38 %	21.09.2021	241.330	0,01 %
Municipality Finance plc	200.000	2,38 %	15.03.2022	199.523	0,01 %
				3.714.642	0,19 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Frankreich 1,92 % (2016: 2,16 %)					
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	1.040.000	3,00 %	26.10.2020	1.053.874	0,05 %
Air Liquide Finance SA	1.000.000	2,50 %	27.09.2026	954.788	0,05 %
BNP Paribas SA	900.000	3,80 %	10.01.2024	929.625	0,05 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	900.000	1,50 %	28.01.2019	894.437	0,04 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	900.000	1,88 %	28.07.2020	890.994	0,04 %
Orange SA	575.000	9,00 %	01.03.2031	864.292	0,04 %
Danone SA	850.000	2,59 %	02.11.2023	828.303	0,04 %
Electricite de France SA	750.000	3,63 %	13.10.2025	766.927	0,04 %
BPCE SA	750.000	2,75 %	02.12.2021	752.076	0,04 %
Electricite de France SA	700.000	2,15 %	22.01.2019	699.612	0,04 %
BNP Paribas SA	650.000	5,00 %	15.01.2021	697.284	0,04 %
Electricite de France SA^	675.000	5,25 %	29.07.2166	686.813	0,03 %
BNP Paribas SA	625.000	4,38 %	28.09.2025	652.936	0,03 %
AXA SA^	600.000	5,13 %	17.01.2047	648.780	0,03 %
Danone SA	650.000	1,69 %	30.10.2019	640.338	0,03 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	650.000	1,88 %	12.02.2022	633.724	0,03 %
Electricite de France SA	450.000	6,95 %	26.01.2039	613.065	0,03 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	585.000	3,38 %	20.03.2024	610.705	0,03 %
Caisse des Depots et Consignations	600.000	1,38 %	07.11.2019	587.700	0,03 %
Credit Agricole SA	560.000	4,38 %	17.03.2025	584.972	0,03 %
Pernod Ricard SA	525.000	5,75 %	07.04.2021	575.593	0,03 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	570.000	1,75 %	24.09.2019	566.510	0,03 %
Societe Generale SA	550.000	4,25 %	14.04.2025	559.472	0,03 %
BPCE SA	550.000	3,00 %	22.05.2022	549.436	0,03 %
BPCE SA	500.000	4,88 %	01.04.2026	535.354	0,03 %
BNP Paribas SA	500.000	4,63 %	13.03.2027	534.358	0,03 %
Credit Agricole SA	500.000	3,88 %	15.04.2024	525.322	0,03 %
Electricite de France SA	475.000	4,88 %	22.01.2044	524.377	0,03 %
Orange SA	435.000	5,38 %	13.01.2042	516.002	0,03 %
Credit Agricole SA	500.000	3,38 %	10.01.2022	506.959	0,03 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	500.000	1,88 %	12.02.2022	487.604	0,02 %
Total Capital Canada Ltd.	475.000	2,75 %	15.07.2023	477.070	0,02 %
Sanofi	450.000	4,00 %	29.03.2021	473.570	0,02 %
BPCE SA	400.000	5,70 %	22.10.2023	443.068	0,02 %
Total Capital International SA	400.000	3,70 %	15.01.2024	421.116	0,02 %
Electricite de France SA^	400.000	5,63 %	22.07.2166	413.000	0,02 %
Total Capital International SA	400.000	2,75 %	19.06.2021	404.559	0,02 %
BPCE SA	400.000	2,65 %	03.02.2021	401.119	0,02 %
Pernod Ricard SA	400.000	3,25 %	08.06.2026	399.500	0,02 %
BNP Paribas SA	400.000	3,50 %	16.11.2027	397.859	0,02 %
BPCE SA	375.000	4,00 %	15.04.2024	396.218	0,02 %
Agence Francaise de Developpement	400.000	1,38 %	02.08.2019	394.460	0,02 %
Electricite de France SA	375.000	6,50 %	26.01.2019	391.116	0,02 %
Schneider Electric SE	375.000	2,95 %	27.09.2022	372.366	0,02 %
AXA SA	250.000	8,60 %	15.12.2030	359.808	0,02 %
Total Capital International SA	300.000	3,75 %	10.04.2024	316.195	0,02 %
BNP Paribas SA	300.000	4,38 %	12.05.2026	313.456	0,02 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	300.000	2,50 %	13.04.2021	299.294	0,02 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	300.000	2,00 %	12.04.2019	299.122	0,02 %
Societe Generale SA	300.000	2,50 %	08.04.2021	298.552	0,02 %
Orange SA	300.000	1,63 %	03.11.2019	296.281	0,01 %
Societe Generale SA	275.000	5,20 %	15.04.2021	296.050	0,01 %
Societe Generale SA	275.000	5,00 %	17.01.2024	292.738	0,01 %
Orange SA	250.000	4,13 %	14.09.2021	264.484	0,01 %
BPCE SA	250.000	4,50 %	15.03.2025	261.170	0,01 %
Orange SA	250.000	5,38 %	08.07.2019	260.980	0,01 %
Societe Generale SA	250.000	4,25 %	19.08.2026	253.884	0,01 %
Danone SA	250.000	3,00 %	15.06.2022	251.298	0,01 %
Credit Agricole SA	250.000	2,50 %	15.04.2019	250.678	0,01 %
Dexia Credit Local SA	250.000	2,25 %	30.01.2019	250.360	0,01 %
BNP Paribas SA	250.000	2,38 %	21.05.2020	250.032	0,01 %
Credit Agricole SA	250.000	3,25 %	04.10.2024	247.977	0,01 %
Danone SA	250.000	2,95 %	02.11.2026	242.188	0,01 %
Pernod Ricard SA	200.000	5,50 %	15.01.2042	241.028	0,01 %
Electricite de France SA	200.000	4,95 %	13.10.2045	226.899	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Airbus Finance BV	225.000	2,70 %	17.04.2023	224.005	0,01 %
Electricite de France SA	200.000	6,00 %	22.01.2114	219.500	0,01 %
BPCE SA	200.000	5,15 %	21.07.2024	216.432	0,01 %
Total Capital SA	200.000	4,25 %	15.12.2021	213.048	0,01 %
Total Capital SA	200.000	4,45 %	24.06.2020	210.560	0,01 %
Societe Generale SA	200.000	4,75 %	24.11.2025	210.135	0,01 %
AXA SA^	200.000	6,46 %	31.12.2049	204.000	0,01 %
BNP Paribas/BNP Paribas US Medium-Term Note Program LLC	200.000	3,25 %	03.03.2023	203.575	0,01 %
Societe Generale SA	200.000	4,00 %	12.01.2027	203.115	0,01 %
Total Capital International SA	200.000	2,88 %	17.02.2022	202.368	0,01 %
Credit Agricole SA	200.000	2,75 %	10.06.2020	201.500	0,01 %
Airbus SE	190.000	3,95 %	10.04.2047	201.473	0,01 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	200.000	2,75 %	22.01.2019	201.027	0,01 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	200.000	2,75 %	15.10.2020	201.016	0,01 %
BNP Paribas SA	200.000	2,95 %	23.05.2022	200.531	0,01 %
Airbus SE	200.000	3,15 %	10.04.2027	200.402	0,01 %
Total Capital International SA	200.000	2,10 %	19.06.2019	200.048	0,01 %
Agence Francaise de Developpement	200.000	2,00 %	18.03.2019	199.754	0,01 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	200.000	2,00 %	17.04.2020	199.052	0,01 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	200.000	2,70 %	20.07.2022	198.519	0,01 %
SFIL SA	200.000	2,00 %	30.06.2020	198.484	0,01 %
Banque Federative du Credit Mutuel SA	200.000	2,20 %	20.07.2020	198.288	0,01 %
Agence Francaise de Developpement	180.000	1,63 %	21.01.2020	177.764	0,01 %
Orange SA	175.000	2,75 %	06.02.2019	176.119	0,01 %
Total Capital International SA	175.000	2,70 %	25.01.2023	175.291	0,01 %
Credit Agricole SA	175.000	2,38 %	01.07.2021	173.723	0,01 %
BPCE SA	150.000	2,25 %	27.01.2020	149.641	0,01 %
Veolia Environnement SA	100.000	6,75 %	01.06.2038	131.374	0,01 %
Lafarge SA	100.000	7,13 %	15.07.2036	131.000	0,01 %
Total Capital International SA	125.000	2,13 %	10.01.2019	125.065	0,01 %
Electricite de France SA	100.000	5,25 %	13.10.2055	115.178	0,01 %
Legrand France SA	80.000	8,50 %	15.02.2025	103.396	0,01 %
BNP Paribas SA	100.000	2,45 %	17.03.2019	100.386	0,01 %
Air Liquide Finance SA	75.000	2,25 %	27.09.2023	72.983	0,00 %
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	50.000	2,00 %	22.03.2021	49.446	0,00 %
				38.217.925	1,92 %
Deutschland 2,83 % (2016: 2,92 %)					
KFW	2.500.000	1,50 %	06.02.2019	2.487.800	0,12 %
KFW	2.000.000	1,63 %	15.03.2021	1.963.130	0,10 %
KFW	2.000.000	1,50 %	15.06.2021	1.950.162	0,10 %
KFW	1.550.000	1,88 %	01.04.2019	1.548.314	0,08 %
Deutsche Bank AG	1.475.000	4,25 %	14.10.2021	1.528.894	0,08 %
Deutsche Telekom International Finance BV	950.000	8,75 %	15.06.2030	1.419.803	0,07 %
NRW Bank	1.410.000	2,00 %	23.09.2019	1.404.628	0,07 %
KFW	1.250.000	1,00 %	15.07.2019	1.229.859	0,06 %
KFW	1.225.000	1,75 %	15.09.2021	1.202.291	0,06 %
State of North Rhine-Westphalia Germany	1.200.000	1,88 %	17.06.2019	1.195.512	0,06 %
KFW	1.200.000	1,50 %	20.04.2020	1.183.686	0,06 %
KFW	1.100.000	2,50 %	20.11.2024	1.096.916	0,06 %
KFW	1.075.000	1,63 %	29.05.2020	1.063.102	0,05 %
KFW	1.000.000	1,88 %	30.06.2020	993.860	0,05 %
KFW	1.000.000	2,13 %	07.03.2022	992.869	0,05 %
KFW	1.000.000	1,75 %	31.03.2020	992.546	0,05 %
KFW	1.000.000	1,25 %	30.09.2019	986.222	0,05 %
KFW	950.000	2,00 %	04.10.2022	935.113	0,05 %
KFW	900.000	4,00 %	27.01.2020	934.973	0,05 %
KFW	825.000	4,88 %	17.06.2019	859.179	0,04 %
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	785.000	1,63 %	01.02.2019	782.088	0,04 %
FMS Wertmanagement AoeR	765.000	2,00 %	01.08.2022	753.611	0,04 %
KFW	760.000	2,00 %	02.05.2025	732.972	0,04 %
Daimler Finance North America LLC	700.000	2,70 %	03.08.2020	703.317	0,04 %
FMS Wertmanagement AoeR	700.000	1,75 %	17.03.2020	694.993	0,03 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	700.000	1,88 %	17.04.2023	680.862	0,03 %
KFW	650.000	2,13 %	17.01.2023	642.168	0,03 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	600.000	2,38 %	24.03.2021	603.000	0,03 %
FMS Wertmanagement AoeR	600.000	1,63 %	07.03.2019	597.756	0,03 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Erste Abwicklungsanstalt	600.000	1,38 %	30.10.2019	589.242	0,03 %
Daimler Finance North America LLC	550.000	2,20 %	05.05.2020	546.898	0,03 %
KFW	925.000	0,00 %	18.04.2036	541.019	0,03 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	550.000	2,00 %	13.01.2025	531.875	0,03 %
Deutsche Bank AG	525.000	2,50 %	13.02.2019	524.461	0,03 %
Deutsche Bank AG	500.000	3,38 %	12.05.2021	504.425	0,03 %
KFW	500.000	2,38 %	25.08.2021	501.913	0,03 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	500.000	1,88 %	22.01.2020	498.110	0,03 %
Deutsche Bank AG	500.000	2,70 %	13.07.2020	497.590	0,02 %
FMS Wertmanagement AoeR	500.000	1,75 %	24.01.2020	496.959	0,02 %
KFW	500.000	1,63 %	15.08.2019	496.905	0,02 %
BMW US Capital LLC	500.000	1,50 %	11.04.2019	496.354	0,02 %
Daimler Finance North America LLC	325.000	8,50 %	18.01.2031	488.512	0,02 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	425.000	4,40 %	27.05.2045	478.809	0,02 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	500.000	2,35 %	15.10.2026	469.709	0,02 %
KFW	470.000	2,13 %	15.06.2022	466.052	0,02 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	450.000	3,25 %	27.05.2025	456.377	0,02 %
KFW	400.000	2,63 %	25.01.2022	405.092	0,02 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	400.000	2,90 %	27.05.2022	403.546	0,02 %
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	400.000	2,00 %	05.02.2019	398.983	0,02 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	400.000	1,38 %	23.10.2019	395.074	0,02 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	325.000	6,13 %	17.08.2026	393.274	0,02 %
Deutsche Telekom International Finance BV	350.000	3,60 %	19.01.2027	351.990	0,02 %
KFW	350.000	1,75 %	15.10.2019	348.295	0,02 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	350.000	2,50 %	15.11.2027	346.832	0,02 %
BMW US Capital LLC	350.000	2,00 %	11.04.2021	344.827	0,02 %
Volkswagen International Finance NV	325.000	4,00 %	12.08.2020	336.024	0,02 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	300.000	4,20 %	16.03.2047	329.258	0,02 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	330.000	1,75 %	27.07.2026	309.201	0,02 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	300.000	3,40 %	16.03.2027	304.634	0,02 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	300.000	3,13 %	16.03.2024	303.968	0,02 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	300.000	2,20 %	16.03.2020	299.618	0,02 %
State of North Rhine-Westphalia Germany	300.000	2,38 %	16.09.2021	299.604	0,02 %
Daimler Finance North America LLC	300.000	2,25 %	02.03.2020	298.682	0,02 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	300.000	1,30 %	13.09.2019	295.536	0,01 %
FMS Wertmanagement AoeR	300.000	1,00 %	16.08.2019	295.180	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	300.000	2,20 %	30.10.2021	294.984	0,01 %
Deutsche Bank AG	275.000	2,85 %	10.05.2019	275.746	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	275.000	2,00 %	06.12.2021	271.973	0,01 %
Fresenius Medical Care US Finance, Inc.	250.000	5,75 %	15.02.2021	270.312	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	250.000	3,25 %	01.08.2024	253.934	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	250.000	2,88 %	10.03.2021	251.914	0,01 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	250.000	2,70 %	16.03.2022	251.633	0,01 %
Deutsche Bank AG	250.000	3,70 %	30.05.2024	251.350	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	250.000	2,25 %	03.09.2019	249.454	0,01 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	250.000	2,15 %	27.05.2020	249.075	0,01 %
Volkswagen Group of America Finance LLC	250.000	2,13 %	23.05.2019	248.950	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	250.000	2,38 %	10.06.2025	247.312	0,01 %
State of North Rhine-Westphalia Germany	250.000	1,63 %	22.01.2020	247.185	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	250.000	2,00 %	06.07.2021	244.572	0,01 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	250.000	2,00 %	15.09.2023	239.270	0,01 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	250.000	3,30 %	15.09.2046	236.909	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	200.000	4,88 %	06.03.2042	225.816	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	225.000	2,23 %	17.01.2020	223.914	0,01 %
BMW US Capital LLC	220.000	2,80 %	11.04.2026	214.661	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	200.000	3,45 %	06.01.2027	204.603	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	200.000	3,30 %	19.05.2025	202.821	0,01 %
Deutsche Bank AG	200.000	2,95 %	20.08.2020	200.253	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	200.000	2,82 %	19.01.2022	200.040	0,01 %
Volkswagen Group of America Finance LLC	200.000	2,45 %	20.11.2019	199.802	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	200.000	2,30 %	06.01.2020	199.536	0,01 %
Landwirtschaftliche Rentenbank	200.000	1,75 %	15.04.2019	199.536	0,01 %
E.ON International Finance BV	150.000	6,65 %	30.04.2038	198.569	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	200.000	1,50 %	05.07.2019	197.664	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	200.000	1,50 %	19.09.2019	197.001	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	200.000	1,95 %	19.09.2021	194.563	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
KFW	195.000	1,88 %	15.12.2020	193.920	0,01 %
Fresenius Medical Care US Finance II, Inc.	185.000	4,13 %	15.10.2020	190.550	0,01 %
Deutsche Telekom International Finance BV	175.000	6,00 %	08.07.2019	184.651	0,01 %
Deutsche Bank AG	175.000	4,10 %	13.01.2026	181.616	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	180.000	2,25 %	31.07.2019	180.116	0,01 %
BMW US Capital LLC	165.000	2,15 %	06.04.2020	164.388	0,01 %
BMW US Capital LLC	160.000	3,30 %	06.04.2027	161.339	0,01 %
BMW US Capital LLC	150.000	1,45 %	13.09.2019	148.155	0,01 %
EMD Finance LLC	145.000	3,25 %	19.03.2025	145.697	0,01 %
EMD Finance LLC	100.000	2,95 %	19.03.2022	100.452	0,01 %
BMW US Capital LLC	100.000	2,70 %	06.04.2022	100.059	0,01 %
Daimler Finance North America LLC	100.000	2,45 %	18.05.2020	99.909	0,01 %
Deutsche Bank AG	100.000	3,30 %	16.11.2022	99.531	0,01 %
BMW US Capital LLC	100.000	1,85 %	15.09.2021	97.422	0,00 %
BMW US Capital LLC	100.000	2,25 %	15.09.2023	97.170	0,00 %
Daimler Finance North America LLC	50.000	2,85 %	06.01.2022	50.241	0,00 %
Siemens Financieringsmaatschappij NV	50.000	1,70 %	15.09.2021	48.569	0,00 %
				56.391.591	2,83 %
Guernsey 0,02 % (2016: 0,02 %)					
Pershing Square Holdings Ltd.	300.000	5,50 %	15.07.2022	312.210	0,02 %
				312.210	0,02 %
Hongkong 0,37 % (2016: 0,52 %)					
Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd.	725.000	4,50 %	14.02.2022	768.442	0,04 %
AIA Group Ltd.	500.000	3,20 %	11.03.2025	497.301	0,02 %
Swire Pacific MTN Financing Ltd.	425.000	4,50 %	28.02.2022	449.106	0,02 %
Hutchison Whampoa International 03/33 Ltd.	300.000	7,45 %	24.11.2033	430.445	0,02 %
Hutchison Whampoa International 14 Ltd.	400.000	3,63 %	31.10.2024	409.732	0,02 %
Link Finance Cayman 2009 Ltd.	400.000	3,60 %	03.09.2024	408.993	0,02 %
CK Hutchison International 16 Ltd.	400.000	1,88 %	03.10.2021	386.705	0,02 %
CLP Power Hong Kong Financing Ltd.	350.000	3,38 %	26.10.2027	348.338	0,02 %
Hutchison Whampoa International 09 Ltd.	300.000	7,63 %	09.04.2019	319.107	0,02 %
Hutchison Whampoa International 11 Ltd.	300.000	4,63 %	13.01.2022	318.897	0,02 %
Hutchison Whampoa International 14 Ltd.	300.000	3,63 %	31.10.2024	307.516	0,02 %
CK Hutchison International 16 Ltd.	300.000	2,75 %	03.10.2026	285.242	0,01 %
HKCG Finance Ltd.	275.000	6,25 %	07.08.2018	281.173	0,01 %
Hongkong Electric Finance Ltd.	225.000	4,25 %	14.12.2020	234.027	0,01 %
AIA Group Ltd.	200.000	4,50 %	16.03.2046	222.977	0,01 %
Nan Fung Treasury Ltd.	200.000	4,50 %	20.09.2022	207.976	0,01 %
Kowloon-Canton Railway Corp.	200.000	5,13 %	20.05.2019	207.288	0,01 %
Li & Fung Ltd. ^	200.000	6,00 %	25.05.2166	200.866	0,01 %
CK Hutchison International 17 Ltd.	200.000	3,50 %	05.04.2027	199.923	0,01 %
CK Hutchison International 17 Ltd.	200.000	2,88 %	05.04.2022	199.362	0,01 %
CK Hutchison International 17 II Ltd.	200.000	2,25 %	29.09.2020	197.537	0,01 %
CK Hutchison International 17 II Ltd.	200.000	3,25 %	29.09.2027	195.340	0,01 %
Hutchison Whampoa International 09/19 Ltd.	125.000	5,75 %	11.09.2019	131.568	0,01 %
Hutchison Whampoa International 09 Ltd.	100.000	7,63 %	09.04.2019	106.378	0,01 %
AIA Group Ltd.	50.000	4,88 %	11.03.2044	58.098	0,00 %
				7.372.337	0,37 %
Ungarn 0,19 % (2016: 0,21 %)					
Hungary Government International Bond	1.500.000	6,38 %	29.03.2021	1.666.875	0,09 %
Hungary Government International Bond	700.000	6,25 %	29.01.2020	749.896	0,04 %
Hungary Government International Bond	600.000	5,38 %	21.02.2023	667.500	0,03 %
Hungary Government International Bond	400.000	7,63 %	29.03.2041	627.666	0,03 %
				3.711.937	0,19 %
Indien 0,44 % (2016: 0,44 %)					
Bharti Airtel International Netherlands BV	750.000	5,35 %	20.05.2024	808.125	0,04 %
ICICI Bank Ltd.	575.000	3,50 %	18.03.2020	580.049	0,03 %
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	500.000	3,95 %	19.01.2022	510.214	0,03 %
ICICI Bank Ltd.	500.000	3,25 %	09.09.2022	496.310	0,02 %
ICICI Bank Ltd.	400.000	4,00 %	18.03.2026	404.326	0,02 %
Reliance Industries Ltd.	400.000	3,67 %	30.11.2027	395.161	0,02 %
Reliance Holding USA, Inc.	300.000	5,40 %	14.02.2022	325.469	0,02 %
Bank of India	300.000	6,25 %	16.02.2021	323.601	0,02 %
ONGC Videsh Ltd.	300.000	4,63 %	15.07.2024	319.158	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Reliance Industries Ltd.	300.000	4,13 %	28.01.2025	310.500	0,02 %
Export-Import Bank of India	300.000	3,88 %	02.10.2019	305.631	0,02 %
Axis Bank Ltd.	300.000	3,00 %	08.08.2022	296.377	0,01 %
Export-Import Bank of India	300.000	3,38 %	05.08.2026	294.512	0,01 %
Reliance Holding USA, Inc.	250.000	4,50 %	19.10.2020	261.071	0,01 %
Export-Import Bank of India	250.000	4,00 %	14.01.2023	259.093	0,01 %
ONGC Videsh Vankorneft Pte Ltd.	250.000	3,75 %	27.07.2026	249.050	0,01 %
Bank of India	250.000	3,13 %	06.05.2020	248.768	0,01 %
Indian Oil Corp., Ltd.	200.000	5,63 %	02.08.2021	217.040	0,01 %
State Bank of India	200.000	4,88 %	17.04.2024	216.779	0,01 %
ICICI Bank Ltd.	200.000	5,75 %	16.11.2020	214.242	0,01 %
NTPC Ltd.	200.000	4,75 %	03.10.2022	213.532	0,01 %
Bharat Petroleum Corp., Ltd.	200.000	4,63 %	25.10.2022	211.590	0,01 %
NTPC Ltd.	200.000	4,38 %	26.11.2024	210.986	0,01 %
Bank of Baroda	200.000	4,88 %	23.07.2019	205.762	0,01 %
Oil India Ltd.	200.000	3,88 %	17.04.2019	202.506	0,01 %
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	200.000	3,50 %	29.07.2020	201.988	0,01 %
Axis Bank Ltd.	200.000	3,25 %	21.05.2020	200.752	0,01 %
ICICI Bank Ltd.	200.000	3,80 %	14.12.2027	197.638	0,01 %
Adani Transmission Ltd.	100.000	4,00 %	03.08.2026	99.177	0,01 %
Reliance Industries Ltd.	50.000	4,88 %	10.02.2045	55.317	0,00 %
AE-Rotor Holding BV	17.496	4,97 %	28.03.2018	17.452	0,00 %
				8.852.176	0,44 %
Indonesien 0,88 % (2016: 0,91 %)					
Indonesia Government International Bond	950.000	6,63 %	17.02.2037	1.214.813	0,06 %
Indonesia Government International Bond	1.000.000	4,75 %	08.01.2026	1.086.342	0,05 %
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	1.000.000	4,55 %	29.03.2026	1.057.500	0,05 %
Indonesia Government International Bond	600.000	5,88 %	15.01.2024	682.500	0,03 %
Perusahaan Listrik Negara PT	600.000	5,50 %	22.11.2021	650.232	0,03 %
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	600.000	4,35 %	10.09.2024	630.066	0,03 %
Pertamina Persero PT	600.000	4,30 %	20.05.2023	624.750	0,03 %
Perusahaan Listrik Negara PT	625.000	4,13 %	15.05.2027	623.437	0,03 %
Indonesia Government International Bond	550.000	5,25 %	17.01.2042	616.000	0,03 %
Indonesia Government International Bond	550.000	5,13 %	15.01.2045	605.688	0,03 %
Indonesia Government International Bond	400.000	8,50 %	12.10.2035	598.000	0,03 %
Indonesia Government International Bond	550.000	4,88 %	05.05.2021	586.438	0,03 %
Indonesia Government International Bond	550.000	3,75 %	25.04.2022	565.813	0,03 %
Indonesia Government International Bond	400.000	6,75 %	15.01.2044	531.500	0,03 %
Perusahaan Listrik Negara PT	500.000	5,25 %	24.10.2042	518.851	0,03 %
Indonesia Government International Bond	500.000	4,13 %	15.01.2025	518.750	0,03 %
Indonesia Government International Bond	500.000	3,70 %	08.01.2022	513.750	0,03 %
Indonesia Government International Bond	500.000	3,85 %	18.07.2027	513.495	0,03 %
Pertamina Persero PT	400.000	6,45 %	30.05.2044	479.633	0,02 %
Pertamina Persero PT	400.000	5,63 %	20.05.2043	435.516	0,02 %
Indonesia Government International Bond	400.000	5,88 %	13.03.2020	429.504	0,02 %
Indonesia Government International Bond	275.000	7,75 %	17.01.2038	392.563	0,02 %
Indonesia Government International Bond	375.000	4,63 %	15.04.2043	388.594	0,02 %
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	300.000	6,13 %	15.03.2019	313.509	0,02 %
Pelabuhan Indonesia II PT	300.000	4,25 %	05.05.2025	306.750	0,02 %
Indonesia Government International Bond	275.000	5,88 %	13.03.2020	295.300	0,02 %
Indonesia Government International Bond	200.000	5,95 %	08.01.2046	246.250	0,01 %
Pertamina Persero PT	200.000	6,00 %	03.05.2042	227.228	0,01 %
Pertamina Persero PT	200.000	6,00 %	03.05.2042	226.946	0,01 %
Indonesia Government International Bond	200.000	5,13 %	15.01.2045	220.250	0,01 %
Perusahaan Gas Negara Persero Tbk	200.000	5,13 %	16.05.2024	214.750	0,01 %
Pertamina Persero PT	200.000	5,25 %	23.05.2021	214.250	0,01 %
Indonesia Government International Bond	200.000	4,75 %	18.07.2047	213.445	0,01 %
Pertamina Persero PT	200.000	4,88 %	03.05.2022	212.522	0,01 %
Pelabuhan Indonesia III Persero PT	200.000	4,88 %	01.10.2024	212.500	0,01 %
Pelabuhan Indonesia II PT	200.000	5,38 %	05.05.2045	209.250	0,01 %
Indonesia Government International Bond	200.000	4,13 %	15.01.2025	207.500	0,01 %
				17.584.185	0,88 %
Irland 0,18 % (2016: 0,15 %)					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	525.000	3,50 %	26.05.2022	531.563	0,03 %
CRH America Finance, Inc.	350.000	3,40 %	09.05.2027	347.648	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
SMBC Aviation Capital Finance DAC	350.000	2,65 %	15.07.2021	343.905	0,02 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	240.000	4,50 %	15.05.2021	252.000	0,01 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	210.000	3,75 %	15.05.2019	213.412	0,01 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	200.000	3,95 %	01.02.2022	206.250	0,01 %
Kerry Group Financial Services	200.000	3,20 %	09.04.2023	198.341	0,01 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	200.000	3,65 %	21.07.2027	198.000	0,01 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	150.000	4,63 %	01.07.2022	159.000	0,01 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	150.000	4,63 %	30.10.2020	157.312	0,01 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	150.000	3,50 %	15.01.2025	148.688	0,01 %
Johnson Controls International plc	125.000	3,63 %	02.07.2024	129.548	0,01 %
SMBC Aviation Capital Finance DAC	125.000	3,00 %	15.07.2022	123.999	0,01 %
Johnson Controls International plc	100.000	5,70 %	01.03.2041	117.415	0,01 %
Johnson Controls International plc	100.000	4,95 %	02.07.2064	110.565	0,00 %
Johnson Controls International plc	100.000	4,63 %	02.07.2044	110.098	0,00 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	100.000	5,00 %	01.10.2021	106.625	0,00 %
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	50.000	4,25 %	01.07.2020	51.875	0,00 %
				3.506.244	0,18 %
Israel 0,31 % (2016: 0,42 %)					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	775.000	2,20 %	21.07.2021	710.060	0,04 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	750.000	3,15 %	01.10.2026	616.748	0,03 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	700.000	2,80 %	21.07.2023	608.662	0,03 %
Israel Government International Bond	600.000	2,88 %	16.03.2026	598.703	0,03 %
Israel Government International Bond	450.000	4,50 %	30.01.2043	492.650	0,02 %
Israel Electric Corp., Ltd.	450.000	5,00 %	12.11.2024	479.448	0,02 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	475.000	1,70 %	19.07.2019	460.980	0,02 %
Israel Government International Bond	400.000	5,13 %	26.03.2019	414.198	0,02 %
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	350.000	4,10 %	01.10.2046	269.077	0,01 %
Delek & Avner Tamar Bond Ltd.	240.000	5,41 %	30.12.2025	241.800	0,01 %
Israel Government International Bond	200.000	4,00 %	30.06.2022	211.670	0,01 %
Israel Chemicals Ltd.	200.000	4,50 %	02.12.2024	203.776	0,01 %
Teva Pharmaceutical Finance Co. BV	202.000	3,65 %	10.11.2021	192.169	0,01 %
Teva Pharmaceutical Finance Co. LLC	175.000	6,15 %	01.02.2036	176.069	0,01 %
Teva Pharmaceutical Finance Co. BV	197.000	2,95 %	18.12.2022	175.495	0,01 %
Israel Government International Bond	150.000	3,15 %	30.06.2023	153.654	0,01 %
Teva Pharmaceutical Finance IV LLC	150.000	2,25 %	18.03.2020	144.811	0,01 %
Teva Pharmaceutical Finance IV BV	125.000	3,65 %	10.11.2021	118.917	0,01 %
				6.268.887	0,31 %
Italien 0,31 % (2016: 0,20 %)					
Republic of Italy Government International Bond	750.000	6,88 %	27.09.2023	882.773	0,04 %
Enel Finance International NV	675.000	2,88 %	25.05.2022	670.860	0,03 %
Enel Finance International NV	550.000	3,63 %	25.05.2027	545.252	0,03 %
Enel Finance International NV	400.000	6,00 %	07.10.2039	494.604	0,03 %
Republic of Italy Government International Bond	380.000	5,38 %	15.06.2033	446.819	0,02 %
Enel Finance International NV	350.000	4,75 %	25.05.2047	379.587	0,02 %
Eni SpA	325.000	4,15 %	01.10.2020	336.423	0,02 %
Intesa Sanpaolo SpA	300.000	6,50 %	24.02.2021	330.441	0,02 %
UniCredit SpA	300.000	3,75 %	12.04.2022	304.915	0,02 %
Enel Finance International NV	300.000	2,75 %	06.04.2023	295.583	0,02 %
Enel Finance International NV	300.000	3,50 %	06.04.2028	293.538	0,01 %
Enel Finance International NV	220.000	6,80 %	15.09.2037	293.139	0,01 %
Intesa Sanpaolo SpA	250.000	3,88 %	15.01.2019	253.783	0,01 %
Intesa Sanpaolo SpA	200.000	5,25 %	12.01.2024	218.131	0,01 %
Intesa Sanpaolo SpA	200.000	3,88 %	14.07.2027	199.849	0,01 %
Intesa Sanpaolo SpA	200.000	3,13 %	14.07.2022	198.581	0,01 %
ENI USA, Inc.	75.000	7,30 %	15.11.2027	93.449	0,00 %
				6.237.727	0,31 %
Japan 2,24 % (2016: 2,29 %)					
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	1.050.000	2,95 %	01.03.2021	1.059.321	0,05 %
Mizuho Bank Ltd.	1.000.000	2,45 %	16.04.2019	1.000.196	0,05 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	1.025.000	2,76 %	13.09.2026	978.373	0,05 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	950.000	2,75 %	16.11.2027	944.739	0,05 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	900.000	1,75 %	29.05.2019	893.395	0,04 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	800.000	2,85 %	11.01.2022	800.338	0,04 %
Mizuho Financial Group, Inc.	800.000	2,63 %	12.04.2021	796.184	0,04 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	800.000	2,13 %	01.06.2020	795.074	0,04 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.	775.000	2,30 %	05.03.2020	772.235	0,04 %
Mizuho Financial Group, Inc.	700.000	3,48 %	12.04.2026	705.120	0,04 %
Dai-ichi Life Insurance Co., Ltd.^	700.000	4,00 %	24.01.2166	679.875	0,03 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	650.000	3,85 %	01.03.2026	672.338	0,03 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	650.000	3,00 %	29.05.2024	661.003	0,03 %
Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.	650.000	2,65 %	19.10.2020	650.876	0,03 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	650.000	1,50 %	21.07.2021	627.302	0,03 %
Nippon Life Insurance Co.^	500.000	4,70 %	20.01.2046	515.380	0,03 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	500.000	3,68 %	22.02.2027	511.793	0,03 %
Nippon Life Insurance Co.^	475.000	5,10 %	16.10.2044	501.719	0,03 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	500.000	2,45 %	10.01.2019	501.087	0,03 %
Mizuho Financial Group, Inc.	500.000	2,95 %	28.02.2022	500.150	0,03 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	500.000	2,25 %	11.07.2019	499.456	0,03 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	500.000	2,05 %	18.01.2019	498.857	0,03 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	500.000	2,55 %	08.03.2021	498.593	0,02 %
Central Nippon Expressway Co., Ltd.	500.000	2,17 %	05.08.2019	496.860	0,02 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	500.000	2,44 %	19.10.2021	493.861	0,02 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	500.000	2,25 %	04.11.2026	478.427	0,02 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	500.000	2,63 %	14.07.2026	473.035	0,02 %
Nomura Holdings, Inc.	450.000	2,75 %	19.03.2019	452.058	0,02 %
American Honda Finance Corp. ¹	450.000	2,25 %	15.08.2019	450.538	0,02 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	425.000	4,44 %	02.04.2024	446.533	0,02 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	425.000	2,50 %	01.06.2022	422.977	0,02 %
Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.	400.000	4,60 %	27.03.2024	420.210	0,02 %
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.	400.000	3,75 %	10.03.2024	416.708	0,02 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	400.000	3,78 %	09.03.2026	412.192	0,02 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	410.000	2,13 %	16.11.2020	406.674	0,02 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	400.000	2,93 %	09.03.2021	403.136	0,02 %
American Honda Finance Corp.	400.000	2,45 %	24.09.2020	400.949	0,02 %
Toyota Motor Credit Corp.	400.000	2,15 %	12.03.2020	399.238	0,02 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	400.000	2,25 %	24.02.2020	399.007	0,02 %
Toyota Motor Credit Corp.	400.000	1,95 %	17.04.2020	397.342	0,02 %
American Honda Finance Corp.	400.000	1,20 %	12.07.2019	394.248	0,02 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	400.000	2,19 %	13.09.2021	392.110	0,02 %
Sumitomo Life Insurance Co.^	400.000	4,00 %	14.09.2077	391.000	0,02 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	390.000	2,13 %	21.07.2020	387.084	0,02 %
Japan Finance Organization for Municipalities	400.000	2,38 %	13.02.2025	386.726	0,02 %
Tokyo Metropolitan Government	390.000	2,50 %	08.06.2022	386.201	0,02 %
Mitsui Sumitomo Insurance Co., Ltd.^	340.000	7,00 %	15.03.2072	386.184	0,02 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	350.000	4,85 %	01.03.2022	371.462	0,02 %
Development Bank of Japan, Inc.	400.000	1,88 %	01.09.2026	370.703	0,02 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	360.000	2,45 %	16.01.2020	360.000	0,02 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	350.000	2,78 %	12.07.2022	347.485	0,02 %
Development Bank of Japan, Inc.	350.000	1,63 %	01.09.2021	336.079	0,02 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	325.000	2,45 %	20.10.2020	323.783	0,02 %
Japan Finance Organization for Municipalities	320.000	2,63 %	20.04.2022	318.579	0,02 %
Mizuho Financial Group Cayman 2 Ltd.	300.000	4,20 %	18.07.2022	307.842	0,02 %
Mizuho Bank Ltd.	300.000	3,50 %	21.03.2023	306.824	0,02 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	310.000	2,38 %	21.07.2022	306.174	0,02 %
Daiwa Securities Group, Inc.	300.000	3,13 %	19.04.2022	301.243	0,02 %
Toyota Motor Credit Corp.	300.000	2,60 %	11.01.2022	301.001	0,02 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	300.000	2,09 %	18.10.2019	298.577	0,01 %
Nomura Holdings, Inc.	275.000	6,70 %	04.03.2020	298.081	0,01 %
ORIX Corp.	300.000	2,65 %	13.04.2021	297.747	0,01 %
American Honda Finance Corp.	300.000	1,95 %	20.07.2020	297.349	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	300.000	1,55 %	18.10.2019	297.144	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	300.000	1,40 %	20.05.2019	297.060	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	300.000	1,90 %	08.04.2021	295.108	0,01 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	300.000	2,53 %	13.09.2023	291.470	0,01 %
Central Japan Railway Co.	250.000	4,25 %	24.11.2045	278.268	0,01 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	250.000	3,40 %	11.07.2024	256.115	0,01 %
Sumitomo Life Insurance Co.^	225.000	6,50 %	20.09.2073	253.216	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	250.000	2,88 %	01.06.2027	251.240	0,01 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	250.000	2,65 %	23.07.2020	251.236	0,01 %
Development Bank of Japan, Inc.	250.000	2,88 %	19.09.2024	250.600	0,01 %
ORIX Corp.	250.000	3,70 %	18.07.2027	250.108	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Toyota Motor Credit Corp.	250.000	2,13 %	18.07.2019	250.080	0,01 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	250.000	1,97 %	11.01.2019	249.429	0,01 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	250.000	3,01 %	19.10.2026	242.738	0,01 %
Meiji Yasuda Life Insurance Co.^	225.000	5,20 %	20.10.2045	240.827	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	225.000	3,38 %	31.07.2023	232.790	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	225.000	1,70 %	19.02.2019	224.190	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	225.000	2,00 %	04.11.2021	220.302	0,01 %
American Honda Finance Corp.	225.000	1,70 %	09.09.2021	218.607	0,01 %
Sompo Japan Nipponkoa Insurance, Inc.^	200.000	5,33 %	28.03.2073	213.660	0,01 %
Nippon Life Insurance Co.^	200.000	5,00 %	18.10.2042	211.090	0,01 %
Dai-ichi Life Insurance Co., Ltd.^	200.000	5,10 %	28.04.2166	211.000	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	200.000	4,50 %	17.06.2020	210.499	0,01 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	200.000	3,95 %	12.01.2022	208.273	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	200.000	3,40 %	15.09.2021	206.733	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	200.000	2,90 %	17.04.2024	201.900	0,01 %
Mizuho Bank Ltd.	200.000	2,65 %	25.09.2019	200.794	0,01 %
Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.	200.000	2,45 %	16.10.2019	200.299	0,01 %
American Honda Finance Corp.	200.000	2,90 %	16.02.2024	200.285	0,01 %
Suntory Holdings Ltd.	200.000	2,55 %	29.09.2019	200.223	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	200.000	2,75 %	21.01.2026	199.791	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	200.000	1,70 %	09.01.2019	199.212	0,01 %
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	200.000	3,36 %	12.07.2027	199.184	0,01 %
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	200.000	2,45 %	18.01.2022	198.029	0,01 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	200.000	2,67 %	25.07.2022	197.543	0,01 %
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	200.000	3,29 %	25.07.2027	197.450	0,01 %
Development Bank of Japan, Inc.	200.000	1,63 %	25.09.2019	197.280	0,01 %
Japan International Cooperation Agency	200.000	2,75 %	27.04.2027	197.168	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	200.000	1,75 %	28.05.2020	196.756	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	200.000	2,15 %	08.09.2022	196.556	0,01 %
Nippon Life Insurance Co.^	200.000	4,00 %	19.09.2047	196.500	0,01 %
Development Bank of Japan, Inc.	200.000	2,00 %	19.10.2021	195.254	0,01 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	200.000	1,90 %	14.09.2021	194.457	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	200.000	2,38 %	20.04.2026	193.100	0,01 %
Mizuho Financial Group, Inc.	200.000	2,84 %	13.09.2026	192.129	0,01 %
Japanische Bank für Internationale Zusammenarbeit	200.000	2,13 %	10.02.2025	191.927	0,01 %
Japan Finance Organization for Municipalities	175.000	4,00 %	13.01.2021	181.598	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	175.000	3,30 %	12.01.2022	180.178	0,01 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	180.000	1,55 %	13.09.2019	177.609	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	175.000	2,10 %	17.01.2019	175.118	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	150.000	4,25 %	11.01.2021	158.033	0,01 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	150.000	3,95 %	19.07.2023	156.878	0,01 %
Mizuho Bank Ltd.	150.000	3,60 %	25.09.2024	154.109	0,01 %
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	150.000	3,20 %	18.07.2022	151.552	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	150.000	2,80 %	13.07.2022	151.515	0,01 %
American Honda Finance Corp.	150.000	2,60 %	16.11.2022	150.119	0,01 %
American Honda Finance Corp.	150.000	1,65 %	12.07.2021	146.208	0,01 %
American Honda Finance Corp.	125.000	3,80 %	20.09.2021	130.445	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	125.000	3,20 %	11.01.2027	126.721	0,01 %
ORIX Corp.	125.000	3,25 %	04.12.2024	124.219	0,01 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	125.000	2,65 %	13.07.2022	124.038	0,01 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	125.000	2,15 %	28.09.2020	123.917	0,01 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	125.000	2,60 %	28.09.2022	123.501	0,01 %
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.	100.000	4,10 %	09.09.2023	105.412	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	100.000	2,75 %	17.05.2021	101.086	0,01 %
Toyota Motor Credit Corp.	100.000	2,63 %	10.01.2023	99.966	0,01 %
ORIX Corp.	100.000	2,90 %	18.07.2022	99.390	0,00 %
Toyota Motor Credit Corp.	100.000	2,25 %	18.10.2023	97.642	0,00 %
American Honda Finance Corp.	75.000	2,30 %	09.09.2026	70.711	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	50.000	2,25 %	13.01.2020	49.902	0,00 %
Nissan Motor Acceptance Corp.	25.000	2,15 %	13.07.2020	24.806	0,00 %
				44.741.924	2,24 %
Jersey 0,05 % (2016: 0,04 %)					
UBS Group Funding Switzerland AG	500.000	2,65 %	01.02.2022	494.561	0,02 %
Aptiv plc	200.000	3,15 %	19.11.2020	202.866	0,01 %
HSBC Bank Middle East Ltd.	200.000	2,75 %	01.10.2019	200.248	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Aptiv plc	100.000	4,40 %	01.10.2046	101.251	0,01 %
				998.926	0,05 %
Kasachstan 0,25 % (2016: 0,24 %)					
Kazakhstan Government International Bond	900.000	5,13 %	21.07.2025	1.002.375	0,05 %
KazMunayGas National Co. JSC	600.000	4,40 %	30.04.2023	621.300	0,03 %
Development Bank of Kazakhstan JSC	600.000	4,13 %	10.12.2022	617.250	0,03 %
Kazakhstan Government International Bond	400.000	6,50 %	21.07.2045	513.000	0,03 %
KazMunayGas National Co. JSC	400.000	6,38 %	09.04.2021	436.000	0,02 %
KazMunayGas National Co. JSC	400.000	5,75 %	19.04.2047	425.500	0,02 %
KazMunayGas National Co. JSC	350.000	7,00 %	05.05.2020	378.875	0,02 %
Kazakhstan Government International Bond	350.000	3,88 %	14.10.2024	363.563	0,02 %
Kazakhstan Temir Zholy Finance BV	250.000	6,95 %	10.07.2042	291.562	0,01 %
KazMunayGas National Co. JSC	200.000	4,75 %	19.04.2027	210.750	0,01 %
Kazakhstan Government International Bond	150.000	4,88 %	14.10.2044	161.250	0,01 %
				5.021.425	0,25 %
Kuwait 0,16 % (2016: 0,02 %)					
Kuwait International Government Bond	1.200.000	2,75 %	20.03.2022	1.197.072	0,06 %
Kuwait International Government Bond	900.000	3,50 %	20.03.2027	915.285	0,05 %
Equate Petrochemical BV	500.000	4,25 %	03.11.2026	507.635	0,02 %
Kuwait Projects Co. SPC Ltd.	300.000	5,00 %	15.03.2023	312.867	0,02 %
Kuwait International Government Bond	200.000	3,50 %	20.03.2027	203.276	0,01 %
				3.136.135	0,16 %
Litauen 0,07 % (2016: 0,07 %)					
Lithuania Government International Bond	510.000	6,63 %	01.02.2022	591.021	0,03 %
Lithuania Government International Bond	375.000	7,38 %	11.02.2020	414.368	0,02 %
Lithuania Government International Bond	300.000	6,13 %	09.03.2021	333.345	0,02 %
				1.338.734	0,07 %
Luxemburg 0,01 % (2016: 0,03 %)					
SES Global Americas Holdings GP	150.000	2,50 %	25.03.2019	149.649	0,01 %
SES Global Americas Holdings GP	125.000	5,30 %	25.03.2044	115.140	0,00 %
				264.789	0,01 %
Malaysia 0,22 % (2016: 0,28 %)					
Petronas Capital Ltd.	875.000	5,25 %	12.08.2019	912.270	0,05 %
Petronas Capital Ltd.	700.000	4,50 %	18.03.2045	789.930	0,04 %
Malaysia Sovereign Sukuk Bhd	600.000	3,04 %	22.04.2025	602.370	0,03 %
Malaysia Sukuk Global Bhd	500.000	3,18 %	27.04.2026	503.700	0,03 %
Petronas Capital Ltd.	330.000	5,25 %	12.08.2019	344.028	0,02 %
Petronas Capital Ltd.	250.000	7,88 %	22.05.2022	301.043	0,01 %
Petronas Global Sukuk Ltd.	250.000	2,71 %	18.03.2020	250.293	0,01 %
Axiata SPV1 Labuan Ltd.	200.000	5,38 %	28.04.2020	210.736	0,01 %
Axiata SPV2 Bhd	200.000	4,36 %	24.03.2026	210.364	0,01 %
Petronas Capital Ltd.	200.000	3,50 %	18.03.2025	204.838	0,01 %
Tenaga Nasional Bhd	50.000	7,50 %	01.11.2025	63.217	0,00 %
				4.392.789	0,22 %
Mexiko 1,88 % (2016: 1,79 %)					
Mexico Government International Bond	1.385.000	6,05 %	11.01.2040	1.649.509	0,08 %
Mexico Government International Bond	1.300.000	4,00 %	02.10.2023	1.361.499	0,07 %
Petroleos Mexicanos	1.146.000	6,75 %	21.09.2047	1.199.865	0,06 %
Mexico Government International Bond	1.004.000	3,63 %	15.03.2022	1.041.232	0,05 %
Mexico Government International Bond	1.000.000	3,60 %	30.01.2025	1.012.184	0,05 %
Mexico Government International Bond	999.000	4,75 %	08.03.2044	1.008.862	0,05 %
Petroleos Mexicanos	900.000	8,00 %	03.05.2019	962.510	0,05 %
Petroleos Mexicanos	925.000	6,50 %	02.06.2041	956.216	0,05 %
Mexico Government International Bond	900.000	4,15 %	28.03.2027	934.654	0,05 %
Mexico Government International Bond	700.000	8,00 %	24.09.2022	878.094	0,04 %
Petroleos Mexicanos	750.000	6,88 %	04.08.2026	849.703	0,04 %
Petroleos Mexicanos	750.000	6,50 %	13.03.2027	819.644	0,04 %
Petroleos Mexicanos	750.000	5,50 %	21.01.2021	799.404	0,04 %
Mexico City Airport Trust	800.000	5,50 %	31.07.2047	791.482	0,04 %
Petroleos Mexicanos	700.000	6,75 %	21.09.2047	732.902	0,04 %
Mexico Government International Bond	642.000	5,75 %	12.10.2110	677.808	0,03 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Petroleos Mexicanos	600.000	6,50 %	13.03.2027	655.715	0,03 %
Alfa SAB de CV	600.000	5,25 %	25.03.2024	635.250	0,03 %
Petroleos Mexicanos	625.000	6,38 %	23.01.2045	628.286	0,03 %
Mexico Government International Bond	552.000	5,55 %	21.01.2045	623.975	0,03 %
Petroleos Mexicanos	650.000	5,63 %	23.01.2046	600.257	0,03 %
Mexico Government International Bond	600.000	4,60 %	23.01.2046	593.107	0,03 %
America Movil SAB de CV	450.000	6,38 %	01.03.2035	570.487	0,03 %
Petroleos Mexicanos	500.000	6,63 %	15.06.2035	535.535	0,03 %
Petroleos Mexicanos	500.000	5,50 %	04.02.2019	515.968	0,03 %
Mexico City Airport Trust	500.000	4,25 %	31.10.2026	514.277	0,03 %
Petroleos Mexicanos	550.000	5,50 %	27.06.2044	508.011	0,03 %
Petroleos Mexicanos	500.000	4,50 %	23.01.2026	501.852	0,02 %
America Movil SAB de CV	475.000	3,13 %	16.07.2022	480.019	0,02 %
America Movil SAB de CV	425.000	5,00 %	30.03.2020	446.916	0,02 %
Mexico Government International Bond	332.000	6,75 %	27.09.2034	431.407	0,02 %
Mexico Government International Bond	450.000	4,35 %	15.01.2047	431.111	0,02 %
Petroleos Mexicanos	425.000	3,50 %	30.01.2023	417.142	0,02 %
America Movil SAB de CV	325.000	6,13 %	30.03.2040	413.526	0,02 %
Southern Copper Corp.	300.000	6,75 %	16.04.2040	390.112	0,02 %
BBVA Bancomer SA	350.000	4,38 %	10.04.2024	364.997	0,02 %
Coca-Cola Femsa SAB de CV	350.000	3,88 %	26.11.2023	363.358	0,02 %
Petroleos Mexicanos	300.000	5,38 %	13.03.2022	318.925	0,02 %
Comision Federal de Electricidad	300.000	4,88 %	26.05.2021	317.250	0,02 %
Alpek SAB de CV	300.000	5,38 %	08.08.2023	316.612	0,02 %
Petroleos Mexicanos	300.000	4,88 %	18.01.2024	312.253	0,02 %
Grupo Bimbo SAB de CV	300.000	3,88 %	27.06.2024	307.665	0,02 %
Petroleos Mexicanos	300.000	3,50 %	23.07.2020	304.661	0,01 %
Becle SAB de CV	300.000	3,75 %	13.05.2025	300.717	0,01 %
Mexichem SAB de CV	300.000	5,50 %	15.01.2048	293.795	0,01 %
BBVA Bancomer SA	250.000	6,75 %	30.09.2022	281.926	0,01 %
America Movil SAB de CV	250.000	4,38 %	16.07.2042	264.010	0,01 %
Fomento Economico Mexicano SAB de CV	250.000	4,38 %	10.05.2043	261.825	0,01 %
Grupo Televisa SAB	250.000	5,00 %	13.05.2045	253.210	0,01 %
Petroleos Mexicanos	225.000	6,00 %	05.03.2020	239.254	0,01 %
Petroleos Mexicanos	231.000	4,63 %	21.09.2023	237.293	0,01 %
Grupo Televisa SAB	200.000	6,13 %	31.01.2046	235.956	0,01 %
Mexichem SAB de CV	200.000	6,75 %	19.09.2042	232.000	0,01 %
Grupo Bimbo SAB de CV	225.000	4,70 %	10.11.2047	227.021	0,01 %
Comision Federal de Electricidad	200.000	6,13 %	16.06.2045	221.500	0,01 %
Petroleos Mexicanos	200.000	6,38 %	04.02.2021	217.808	0,01 %
Comision Federal de Electricidad	200.000	4,88 %	15.01.2024	213.500	0,01 %
Comision Federal de Electricidad	200.000	4,88 %	15.01.2024	213.000	0,01 %
Trust F/1401	200.000	5,25 %	15.12.2024	212.000	0,01 %
Grupo Televisa SAB	200.000	4,63 %	30.01.2026	211.883	0,01 %
Comision Federal de Electricidad	200.000	5,75 %	14.02.2042	211.230	0,01 %
Comision Federal de Electricidad	200.000	4,75 %	23.02.2027	209.436	0,01 %
America Movil SAB de CV	200.000	5,00 %	16.10.2019	209.343	0,01 %
Petroleos Mexicanos	200.000	4,88 %	24.01.2022	208.587	0,01 %
Petroleos Mexicanos	200.000	6,63 %	15.06.2038	207.787	0,01 %
Banco Nacional de Comercio Exterior SNC	200.000	4,38 %	14.10.2025	207.100	0,01 %
Grupo Bimbo SAB de CV	200.000	4,88 %	27.06.2044	206.695	0,01 %
Mexichem SAB de CV	200.000	5,88 %	17.09.2044	206.000	0,01 %
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	200.000	4,13 %	09.11.2022	205.752	0,01 %
Sigma Alimentos SA de CV	200.000	4,13 %	02.05.2026	201.718	0,01 %
Banco Inbursa SA Institucion de Banca Multiple	200.000	4,13 %	06.06.2024	201.123	0,01 %
Fermaca Enterprises S de RL de CV	185.600	6,38 %	30.03.2038	199.520	0,01 %
Infraestructura Energética Nova SAB de CV	200.000	3,75 %	14.01.2028	197.773	0,01 %
Mexico City Airport Trust	200.000	5,50 %	31.10.2046	197.616	0,01 %
El Puerto de Liverpool SAB de CV	200.000	3,88 %	06.10.2026	195.094	0,01 %
Infraestructura Energética Nova SAB de CV	200.000	4,88 %	14.01.2048	192.398	0,01 %
Mexico Generadora de Energia S de rl	179.744	5,50 %	06.12.2032	189.488	0,01 %
America Movil SAB de CV	150.000	6,13 %	15.11.2037	188.080	0,01 %
Grupo Televisa SAB	150.000	6,63 %	15.01.2040	184.309	0,01 %
Mexico Government International Bond	125.000	7,50 %	08.04.2033	170.313	0,01 %
Fresnillo plc	150.000	5,50 %	13.11.2023	164.309	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	150.000	4,13 %	09.11.2022	154.339	0,01 %
Southern Copper Corp.	150.000	3,50 %	08.11.2022	154.007	0,01 %
Grupo Televisa SAB	100.000	8,50 %	11.03.2032	132.763	0,01 %
Telefonos de Mexico SAB de CV	125.000	5,50 %	15.11.2019	132.032	0,01 %
Coca-Cola Femsa SAB de CV	100.000	5,25 %	26.11.2043	117.995	0,01 %
Mexichem SAB de CV	100.000	4,88 %	19.09.2022	106.500	0,01 %
Southern Copper Corp.	100.000	5,38 %	16.04.2020	106.394	0,01 %
Grupo Bimbo SAB de CV	100.000	4,50 %	25.01.2022	105.454	0,01 %
				37.454.095	1,88 %
Marokko 0,07 % (2016: 0,06 %)					
OCP SA	400.000	4,50 %	22.10.2025	400.000	0,02 %
OCP SA	350.000	5,63 %	25.04.2024	374.500	0,02 %
Internationale Staatsanleihe von Marokko	200.000	5,50 %	11.12.2042	226.750	0,01 %
OCP SA	200.000	5,63 %	25.04.2024	214.000	0,01 %
Internationale Staatsanleihe von Marokko	200.000	4,25 %	11.12.2022	211.000	0,01 %
				1.426.250	0,07 %
Niederlande 1,64 % (2016: 1,79 %)					
Bank Nederlandse Gemeenten NV	1.350.000	1,50 %	15.02.2019	1.342.233	0,07 %
Cooperatieve Rabobank UA	1.175.000	2,50 %	19.01.2021	1.178.262	0,06 %
Shell International Finance BV	650.000	6,38 %	15.12.2038	908.547	0,05 %
Shell International Finance BV	750.000	4,38 %	11.05.2045	843.034	0,04 %
Cooperatieve Rabobank UA	800.000	3,75 %	21.07.2026	808.490	0,04 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	800.000	1,50 %	23.01.2019	796.072	0,04 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	800.000	1,75 %	30.10.2019	795.104	0,04 %
ING Bank NV	678.000	5,80 %	25.09.2023	760.328	0,04 %
Cooperatieve Rabobank UA	750.000	2,75 %	10.01.2022	755.845	0,04 %
Shell International Finance BV	725.000	4,30 %	22.09.2019	751.491	0,04 %
Cooperatieve Rabobank UA	725.000	3,38 %	21.05.2025	743.622	0,04 %
Shell International Finance BV	700.000	3,25 %	11.05.2025	719.174	0,04 %
Shell International Finance BV	700.000	2,88 %	10.05.2026	696.615	0,03 %
Cooperatieve Rabobank UA^	595.000	11,00 %	31.12.2166	664.913	0,03 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	650.000	2,38 %	01.02.2022	649.249	0,03 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	600.000	1,75 %	24.03.2020	594.820	0,03 %
Shell International Finance BV	600.000	1,88 %	10.05.2021	590.495	0,03 %
Shell International Finance BV	550.000	4,00 %	10.05.2046	583.429	0,03 %
Shell International Finance BV	550.000	1,38 %	10.05.2019	544.683	0,03 %
Shell International Finance BV	475.000	4,13 %	11.05.2035	519.604	0,03 %
ABN AMRO Bank NV	475.000	4,75 %	28.07.2025	503.966	0,03 %
ABN AMRO Bank NV	500.000	2,10 %	18.01.2019	499.470	0,03 %
Cooperatieve Rabobank UA	475.000	3,88 %	08.02.2022	498.863	0,03 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	500.000	1,63 %	04.03.2020	493.216	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	375.000	5,25 %	24.05.2041	474.070	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	425.000	4,63 %	01.12.2023	454.425	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	430.000	4,75 %	15.01.2020	450.467	0,02 %
MDC-GMTN BV	400.000	5,50 %	20.04.2021	434.108	0,02 %
ABN AMRO Bank NV	400.000	4,80 %	18.04.2026	427.190	0,02 %
Shell International Finance BV	400.000	3,75 %	12.09.2046	408.227	0,02 %
ING Bank NV	400.000	2,70 %	17.08.2020	402.023	0,02 %
ING Bank NV	400.000	2,75 %	22.03.2021	402.022	0,02 %
ING Bank NV	400.000	2,30 %	22.03.2019	400.075	0,02 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	400.000	1,75 %	05.09.2019	397.557	0,02 %
ABN AMRO Bank NV	400.000	1,80 %	20.09.2019	396.484	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	400.000	1,75 %	05.10.2020	395.008	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	375.000	2,25 %	14.01.2020	374.563	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	275.000	5,75 %	01.12.2043	349.901	0,02 %
Koninklijke KPN NV	250.000	8,38 %	01.10.2030	340.986	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	300.000	4,38 %	04.08.2025	316.439	0,02 %
ING Groep NV	300.000	3,15 %	29.03.2022	302.668	0,02 %
Cooperatieve Rabobank UA	250.000	5,25 %	04.08.2045	302.212	0,02 %
ABN AMRO Bank NV	300.000	2,45 %	04.06.2020	300.004	0,02 %
Shell International Finance BV	300.000	2,25 %	10.11.2020	299.758	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	300.000	2,50 %	23.01.2023	299.365	0,02 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	300.000	2,13 %	14.12.2020	298.943	0,01 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	300.000	1,88 %	14.04.2022	293.688	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	300.000	2,38 %	16.03.2026	292.767	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Shell International Finance BV	250.000	4,55 %	12.08.2043	285.695	0,01 %
Heineken NV	275.000	2,75 %	01.04.2023	275.126	0,01 %
ING Groep NV	250.000	3,95 %	29.03.2027	260.522	0,01 %
Cooperatieve Rabobank UA	250.000	3,95 %	09.11.2022	260.355	0,01 %
Koninklijke Philips NV	250.000	3,75 %	15.03.2022	259.999	0,01 %
Unilever Capital Corp.	200.000	5,90 %	15.11.2032	258.951	0,01 %
Shell International Finance BV	200.000	5,50 %	25.03.2040	254.435	0,01 %
Unilever Capital Corp.	250.000	3,10 %	30.07.2025	252.789	0,01 %
ING Bank NV	250.000	2,63 %	05.12.2022	250.460	0,01 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	250.000	1,25 %	09.09.2019	246.286	0,01 %
ING Bank NV	225.000	2,50 %	01.10.2019	225.328	0,01 %
Shell International Finance BV	225.000	2,38 %	21.08.2022	222.852	0,01 %
Shell International Finance BV	225.000	2,25 %	06.01.2023	220.964	0,01 %
Shell International Finance BV	200.000	4,38 %	25.03.2020	209.317	0,01 %
Shell International Finance BV	200.000	3,40 %	12.08.2023	207.342	0,01 %
ABN AMRO Bank NV^	200.000	4,40 %	27.03.2028	206.008	0,01 %
Heineken NV	200.000	3,50 %	29.01.2028	202.638	0,01 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	200.000	2,63 %	28.04.2021	202.033	0,01 %
Shell International Finance BV	200.000	2,13 %	11.05.2020	199.569	0,01 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	200.000	1,88 %	13.03.2019	199.556	0,01 %
Nederlandse Waterschapsbank NV	200.000	2,13 %	15.11.2021	198.309	0,01 %
Unilever Capital Corp.	200.000	1,38 %	28.07.2021	192.862	0,01 %
Unilever Capital Corp.	200.000	2,00 %	28.07.2026	184.489	0,01 %
Heineken NV	175.000	3,40 %	01.04.2022	180.056	0,01 %
Heineken NV	175.000	4,00 %	01.10.2042	176.262	0,01 %
Unilever Capital Corp.	175.000	2,20 %	06.03.2019	175.234	0,01 %
Heineken NV	150.000	4,35 %	29.03.2047	163.816	0,01 %
AEGON Funding Co. LLC	125.000	5,75 %	15.12.2020	135.669	0,01 %
Unilever Capital Corp.	125.000	2,60 %	05.05.2024	123.339	0,01 %
Shell International Finance BV	105.000	2,50 %	12.09.2026	101.678	0,01 %
Unilever Capital Corp.	100.000	2,10 %	30.07.2020	99.654	0,00 %
Shell International Finance BV	75.000	3,63 %	21.08.2042	75.013	0,00 %
Waha Aerospace BV	60.000	3,93 %	28.07.2020	60.900	0,00 %
Waha Aerospace BV	60.000	3,93 %	28.07.2020	60.900	0,00 %
Bank Nederlandse Gemeenten NV	50.000	1,88 %	11.06.2019	49.881	0,00 %
				32.732.762	1,64 %
Neuseeland 0,13 % (2016: 0,11 %)					
BNZ International Funding Ltd.	500.000	2,10 %	14.09.2021	486.326	0,03 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	400.000	2,13 %	28.07.2021	391.090	0,02 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	250.000	2,60 %	23.09.2019	251.284	0,01 %
BNZ International Funding Ltd.	250.000	2,35 %	04.03.2019	250.114	0,01 %
BNZ International Funding Ltd.	250.000	2,65 %	03.11.2022	246.587	0,01 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	200.000	3,45 %	17.07.2027	201.384	0,01 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	200.000	2,75 %	03.02.2021	200.559	0,01 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	200.000	2,88 %	25.01.2022	200.076	0,01 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	200.000	2,20 %	17.07.2020	198.537	0,01 %
ANZ New Zealand Int'l Ltd.	150.000	2,85 %	06.08.2020	151.349	0,01 %
				2.577.306	0,13 %
Nigeria 0,01 % (2016: 0,00 %)					
Africa Finance Corp.	300.000	3,88 %	13.04.2024	301.989	0,01 %
				301.989	0,01 %
Norwegen 0,39 % (2016: 0,48 %)					
DNB Boligkreditt A.S.	900.000	2,50 %	28.03.2022	894.439	0,04 %
Statoil A.S.A	625.000	5,10 %	17.08.2040	756.788	0,04 %
Statoil A.S.A	625.000	3,15 %	23.01.2022	640.213	0,03 %
Kommunalbanken A.S.	500.000	2,13 %	15.03.2019	500.713	0,03 %
Statoil A.S.A	500.000	2,65 %	15.01.2024	497.388	0,03 %
Kommunalbanken A.S.	350.000	2,25 %	25.01.2022	348.318	0,02 %
Statoil A.S.A	250.000	7,25 %	23.09.2027	330.452	0,02 %
Kommunalbanken A.S.	320.000	1,63 %	15.01.2020	316.807	0,02 %
Kommunalbanken A.S.	300.000	1,75 %	28.05.2019	298.912	0,02 %
DNB Bank A.S.A	300.000	2,38 %	02.06.2021	297.857	0,01 %
SpareBank 1 Boligkreditt A.S.	300.000	1,75 %	15.11.2019	296.766	0,01 %
Kommunalbanken A.S.	300.000	1,50 %	31.08.2021	291.406	0,01 %
Kommunalbanken A.S.	300.000	2,13 %	23.04.2025	288.928	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Yara International A.S.A	250.000	7,88 %	11.06.2019	266.618	0,01 %
Statoil A.S.A	225.000	4,80 %	08.11.2043	264.132	0,01 %
Kommunalbanken A.S.	250.000	1,50 %	09.09.2019	247.558	0,01 %
Statoil A.S.A	200.000	2,75 %	10.11.2021	202.106	0,01 %
DNB Bank A.S.A	200.000	2,13 %	02.10.2020	198.286	0,01 %
DNB Boligkreditt A.S.	200.000	2,00 %	28.05.2020	198.285	0,01 %
Statoil A.S.A	150.000	2,25 %	08.11.2019	150.043	0,01 %
Statoil A.S.A	150.000	2,45 %	17.01.2023	148.770	0,01 %
Statoil A.S.A	125.000	4,25 %	23.11.2041	134.724	0,01 %
Statoil A.S.A	100.000	3,25 %	10.11.2024	102.632	0,01 %
Kommunalbanken A.S.	50.000	2,13 %	11.02.2025	48.421	0,00 %
				7.720.562	0,39 %
Oman 0,08 % (2016: 0,04 %)					
Oman Government International Bond	700.000	4,75 %	15.06.2026	679.875	0,03 %
Oman Government International Bond	500.000	5,38 %	08.03.2027	504.390	0,03 %
Oman Government International Bond	500.000	6,50 %	08.03.2047	501.045	0,02 %
				1.685.310	0,08 %
Panama 0,25 % (2016: 0,21 %)					
Panama Government International Bond	450.000	7,13 %	29.01.2026	573.300	0,03 %
Panama Government International Bond	427.000	6,70 %	26.01.2036	570.881	0,03 %
Global Bank Corp.	500.000	4,50 %	20.10.2021	510.031	0,02 %
Panama Government International Bond	300.000	8,88 %	30.09.2027	435.300	0,02 %
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	400.000	5,63 %	18.05.2036	431.108	0,02 %
Panama Government International Bond	400.000	4,50 %	15.05.2047	430.600	0,02 %
Panama Government International Bond	400.000	3,88 %	17.03.2028	418.333	0,02 %
Panama Government International Bond	250.000	9,38 %	01.04.2029	378.500	0,02 %
Panama Government International Bond	300.000	5,20 %	30.01.2020	316.125	0,02 %
Panama Government International Bond	300.000	3,88 %	17.03.2028	313.655	0,02 %
Panama Government International Bond	200.000	4,30 %	29.04.2053	208.320	0,01 %
Panama Government International Bond	200.000	3,75 %	16.03.2025	207.720	0,01 %
Global Bank Corp.	200.000	5,13 %	30.10.2019	207.500	0,01 %
				5.001.373	0,25 %
Peru 0,25 % (2016: 0,29 %)					
Peruanischen Regierung International Bond	600.000	5,63 %	18.11.2050	774.293	0,04 %
Peruanischen Regierung International Bond	463.000	8,75 %	21.11.2033	731.881	0,04 %
Peruanischen Regierung International Bond	450.000	7,35 %	21.07.2025	585.451	0,03 %
Petroleos del Peru SA	500.000	5,63 %	19.06.2047	525.332	0,03 %
Peruanischen Regierung International Bond	375.000	6,55 %	14.03.2037	508.666	0,02 %
Fondo MIVIVIENDA SA	250.000	3,38 %	02.04.2019	251.250	0,01 %
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	225.000	5,88 %	05.07.2034	243.113	0,01 %
Banco de Credito del Peru^	200.000	6,88 %	16.09.2026	223.753	0,01 %
Abengoa Transmision Sur SA	198.740	6,88 %	30.04.2043	219.359	0,01 %
Banco de Credito del Peru^	200.000	6,13 %	24.04.2027	219.352	0,01 %
Corp. Financiera de Desarrollo SA	200.000	3,25 %	15.07.2019	201.000	0,01 %
Banco Internacional del Peru SAA	175.000	5,75 %	07.10.2020	188.139	0,01 %
BBVA Banco Continental SA	150.000	5,00 %	26.08.2022	161.670	0,01 %
Corp. Financiera de Desarrollo SA	125.000	4,75 %	08.02.2022	131.641	0,01 %
Banco de Credito del Peru	98.000	4,25 %	01.04.2023	102.567	0,00 %
				5.067.467	0,25 %
Philippinen 0,36 % (2016: 0,34 %)					
Philippine Government International Bond	900.000	3,95 %	20.01.2040	928.125	0,05 %
Power Sector Assets & Liabilities Management Corp.	600.000	7,39 %	02.12.2024	765.000	0,04 %
Philippine Government International Bond	650.000	8,38 %	17.06.2019	710.125	0,04 %
Philippine Government International Bond	400.000	9,50 %	02.02.2030	632.000	0,03 %
Philippine Government International Bond	575.000	6,50 %	20.01.2020	626.031	0,03 %
Philippine Government International Bond	325.000	7,75 %	14.01.2031	463.125	0,02 %
Philippine Government International Bond	300.000	10,63 %	16.03.2025	453.375	0,02 %
Philippine Government International Bond	437.000	3,70 %	01.03.2041	434.269	0,02 %
Philippine Government International Bond	350.000	4,00 %	15.01.2021	367.136	0,02 %
Philippine Government International Bond	250.000	6,38 %	23.10.2034	334.062	0,02 %
Power Sector Assets & Liabilities Management Corp.	300.000	7,25 %	27.05.2019	319.875	0,02 %
Philippine Government International Bond	250.000	5,50 %	30.03.2026	295.313	0,01 %
Philippine Government International Bond	200.000	5,00 %	13.01.2037	236.000	0,01 %
Philippine Government International Bond	200.000	4,20 %	21.01.2024	217.250	0,01 %
Philippine Government International Bond	200.000	3,70 %	02.02.2042	199.244	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Philippine Government International Bond	80.000	9,50 %	21.10.2024	114.300	0,01 %
				7.095.230	0,36 %
Polen 0,19 % (2016: 0,22 %)					
Republic of Poland Government International Bond	950.000	5,00 %	23.03.2022	1.040.250	0,05 %
Republic of Poland Government International Bond	600.000	6,38 %	15.07.2019	636.126	0,03 %
Republic of Poland Government International Bond	500.000	5,13 %	21.04.2021	541.250	0,03 %
Republic of Poland Government International Bond	488.000	3,00 %	17.03.2023	495.930	0,03 %
Republic of Poland Government International Bond	450.000	3,25 %	06.04.2026	459.562	0,02 %
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA Via PKO Finance AB	300.000	4,63 %	26.09.2022	318.000	0,02 %
Republic of Poland Government International Bond	200.000	4,00 %	22.01.2024	213.250	0,01 %
				3.704.368	0,19 %
Portugal 0,05 % (2016: 0,00 %)					
EDP Finance BV	1.025.000	3,63 %	15.07.2024	1.033.341	0,05 %
				1.033.341	0,05 %
Katar 0,46 % (2016: 0,62 %)					
Qatar Government International Bond	800.000	5,25 %	20.01.2020	840.008	0,04 %
Qatar Government International Bond	575.000	4,63 %	02.06.2046	596.511	0,03 %
Qatar Government International Bond	600.000	2,38 %	02.06.2021	588.654	0,03 %
Qatar Government International Bond	600.000	3,25 %	02.06.2026	584.346	0,03 %
Qatar Government International Bond	500.000	6,55 %	09.04.2019	525.650	0,03 %
Qatari Diar Finance Co.	450.000	5,00 %	21.07.2020	471.375	0,02 %
Qatar Government International Bond	350.000	5,75 %	20.01.2042	420.037	0,02 %
Qatar Government International Bond	300.000	4,50 %	20.01.2022	316.152	0,02 %
Ooredoo International Finance Ltd.	300.000	4,75 %	16.02.2021	315.107	0,02 %
Ooredoo Tamweel Ltd.	300.000	3,04 %	03.12.2018	301.470	0,02 %
CBQ Finance Ltd.	300.000	3,25 %	13.06.2021	295.500	0,02 %
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co., Ltd. III	250.000	5,84 %	30.09.2027	281.062	0,02 %
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co., Ltd. III	250.000	6,75 %	30.09.2019	267.217	0,01 %
CBQ Finance Ltd.	250.000	7,50 %	18.11.2019	265.960	0,01 %
Qatar Government International Bond	250.000	5,25 %	20.01.2020	262.535	0,01 %
Ooredoo International Finance Ltd.	250.000	3,88 %	31.01.2028	248.329	0,01 %
Ooredoo International Finance Ltd.	250.000	3,75 %	22.06.2026	247.948	0,01 %
Ooredoo International Finance Ltd.	250.000	3,25 %	21.02.2023	247.260	0,01 %
Qatar Government International Bond	200.000	5,75 %	20.01.2042	239.711	0,01 %
Qatar Government International Bond	150.000	9,75 %	15.06.2030	233.076	0,01 %
Nakilat, Inc.	200.000	6,07 %	31.12.2033	232.322	0,01 %
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co., Ltd. III	200.000	6,33 %	30.09.2027	229.370	0,01 %
Ooredoo International Finance Ltd.	200.000	5,00 %	19.10.2025	215.846	0,01 %
AKCB Finance Ltd.	200.000	3,25 %	22.10.2018	199.504	0,01 %
SoQ Sukuk A QSC	200.000	3,24 %	18.01.2023	198.500	0,01 %
QNB Finance Ltd.	200.000	2,88 %	29.04.2020	198.002	0,01 %
Qatar Government International Bond	100.000	6,40 %	20.01.2040	128.310	0,01 %
Qatar Government International Bond	50.000	9,75 %	15.06.2030	77.632	0,01 %
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co., Ltd. II	48.855	5,30 %	30.09.2020	50.389	0,00 %
				9.077.783	0,46 %
Rumänien 0,08 % (2016: 0,08 %)					
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	350.000	6,75 %	07.02.2022	401.188	0,02 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	250.000	6,75 %	07.02.2022	286.562	0,02 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	200.000	6,13 %	22.01.2044	258.000	0,01 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	200.000	6,13 %	22.01.2044	257.750	0,01 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	200.000	4,38 %	22.08.2023	214.200	0,01 %
Internationale Staatsanleihe von Rumänien	150.000	4,88 %	22.01.2024	165.000	0,01 %
				1.582.700	0,08 %
Russische Föderation 0,09 % (2016: 0,12 %)					
MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC	400.000	4,10 %	11.04.2023	402.500	0,02 %
Lukoil International Finance BV	300.000	6,66 %	07.06.2022	338.250	0,02 %
Severstal OAO Via Steel Capital SA	300.000	5,90 %	17.10.2022	332.295	0,02 %
Lukoil International Finance BV	300.000	6,13 %	09.11.2020	323.625	0,02 %
MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC	275.000	6,63 %	14.10.2022	309.719	0,01 %
Lukoil International Finance BV	100.000	7,25 %	05.11.2019	107.750	0,00 %
				1.814.139	0,09 %
Saudi-Arabien 0,52 % (2016: 0,34 %)					

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Saudi Government International Bond	2.000.000	3,25 %	26.10.2026	1.961.632	0,10 %
Saudi Government International Bond	1.700.000	4,63 %	04.10.2047	1.739.338	0,09 %
Saudi Government International Bond	1.300.000	2,38 %	26.10.2021	1.267.931	0,06 %
KSA Sukuk Ltd.	1.000.000	3,63 %	20.04.2027	1.009.880	0,05 %
Saudi Government International Bond	1.000.000	4,50 %	26.10.2046	999.450	0,05 %
Saudi Government International Bond	800.000	3,63 %	04.03.2028	793.464	0,04 %
KSA Sukuk Ltd.	700.000	2,89 %	20.04.2022	695.763	0,03 %
Saudi Electricity Global Sukuk Co. 3	500.000	4,00 %	08.04.2024	515.010	0,03 %
Saudi Electricity Global Sukuk Co. 2	400.000	5,06 %	08.04.2043	406.680	0,02 %
KSA Sukuk Ltd.	400.000	2,89 %	20.04.2022	397.476	0,02 %
Saudi Electricity Global Sukuk Co.	300.000	4,21 %	03.04.2022	312.774	0,02 %
Saudi Electricity Global Sukuk Co. 2	200.000	3,47 %	08.04.2023	202.019	0,01 %
SABIC Capital II BV	100.000	2,63 %	03.10.2018	100.073	0,00 %
				10.401.490	0,52 %
Singapur 0,20 % (2016: 0,27 %)					
Temasek Financial I Ltd.	800.000	2,38 %	23.01.2023	790.393	0,04 %
SingTel Group Treasury Pte Ltd.	550.000	4,50 %	08.09.2021	583.654	0,03 %
Global Logistic Properties Ltd.	500.000	3,88 %	04.06.2025	480.625	0,02 %
DBS Group Holdings Ltd.	350.000	2,25 %	16.07.2019	348.756	0,02 %
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	300.000	4,25 %	19.06.2024	311.421	0,02 %
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.^	300.000	3,15 %	11.03.2023	300.375	0,02 %
PSA International Pte Ltd.	250.000	3,88 %	11.02.2021	259.352	0,01 %
Temasek Financial I Ltd.	250.000	4,30 %	25.10.2019	258.799	0,01 %
SP PowerAssets Ltd.	200.000	3,25 %	24.11.2025	203.565	0,01 %
United Overseas Bank Ltd.^	200.000	3,75 %	19.09.2024	202.494	0,01 %
DBS Group Holdings Ltd.^	200.000	3,60 %	07.03.2166	200.000	0,01 %
				3.939.434	0,20 %
Slowakei 0,02 % (2016: 0,02 %)					
Slovakia Government International Bond	300.000	4,38 %	21.05.2022	323.625	0,02 %
				323.625	0,02 %
Slowenien 0,06 % (2016: 0,15 %)					
Slovenia Government International Bond	400.000	5,85 %	10.05.2023	462.173	0,03 %
Slovenia Government International Bond	400.000	5,50 %	26.10.2022	451.677	0,02 %
Slovenia Government International Bond	200.000	5,25 %	18.02.2024	228.607	0,01 %
				1.142.457	0,06 %
Südafrika 0,03 % (2016: 0,26 %)					
Myriad International Holdings BV	400.000	5,50 %	21.07.2025	435.980	0,02 %
Africa Finance Corp.	200.000	4,38 %	29.04.2020	205.250	0,01 %
				641.230	0,03 %
Südkorea 0,90 % (2016: 0,95 %)					
Export-Import Bank von Korea	700.000	1,75 %	26.05.2019	692.231	0,03 %
Koreanische Entwicklungsbank	700.000	2,63 %	27.02.2022	689.688	0,03 %
Export-Import Bank von Korea	600.000	4,00 %	29.01.2021	618.102	0,03 %
Woori Bank	600.000	2,63 %	20.07.2021	591.066	0,03 %
Korea Gas Corp.	400.000	6,25 %	20.01.2042	578.351	0,03 %
Korea National Oil Corp.	500.000	2,88 %	27.03.2022	494.485	0,03 %
Woori Bank	500.000	2,63 %	22.07.2020	494.400	0,02 %
Koreanische Entwicklungsbank	500.000	2,50 %	13.01.2021	493.887	0,02 %
Korea East-West Power Co., Ltd.	500.000	2,63 %	19.06.2022	488.851	0,02 %
Korea International Bond	500.000	2,75 %	19.01.2027	488.432	0,02 %
NongHyup Bank	500.000	1,88 %	12.09.2021	479.547	0,02 %
Koreanische Entwicklungsbank	400.000	3,00 %	14.09.2022	398.692	0,02 %
Export-Import Bank von Korea	400.000	3,00 %	01.11.2022	398.126	0,02 %
Korea Housing Finance Corp.	400.000	2,50 %	15.11.2020	393.952	0,02 %
Korea Gas Corp.	400.000	1,88 %	18.07.2021	385.184	0,02 %
Korea National Oil Corp.	400.000	2,00 %	24.10.2021	384.236	0,02 %
Korea International Bond	350.000	7,13 %	16.04.2019	370.604	0,02 %
KT Corp.	350.000	2,50 %	18.07.2026	326.705	0,02 %
Export-Import Bank von Korea	300.000	5,00 %	11.04.2022	322.945	0,02 %
Export-Import Bank von Korea	300.000	5,13 %	29.06.2020	316.145	0,02 %
SK Telecom Co., Ltd.	250.000	6,63 %	20.07.2027	311.278	0,02 %
Korea Hydro & Nuclear Power Co., Ltd.	300.000	3,00 %	19.09.2022	298.628	0,02 %
Export-Import Bank von Korea	300.000	2,88 %	21.01.2025	292.692	0,01 %
Korea National Oil Corp.	300.000	2,13 %	14.04.2021	291.259	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Export-Import Bank von Korea	300.000	1,88 %	21.10.2021	287.701	0,01 %
Export-Import Bank von Korea	275.000	1,50 %	21.10.2019	269.223	0,01 %
POSCO	250.000	5,25 %	14.04.2021	266.352	0,01 %
NongHyup Bank	250.000	2,75 %	29.09.2019	249.678	0,01 %
KEB Hana Bank	250.000	2,50 %	12.06.2019	249.110	0,01 %
Korea Housing Finance Corp.	250.000	1,63 %	15.09.2018	248.222	0,01 %
Korea International Bond	200.000	4,13 %	10.06.2044	229.574	0,01 %
Korea International Bond	200.000	3,88 %	11.09.2023	209.181	0,01 %
KEB Hana Bank	200.000	4,38 %	30.09.2024	207.322	0,01 %
Korea Gas Corp.	200.000	3,50 %	21.07.2025	201.925	0,01 %
Korea National Oil Corp.	200.000	3,25 %	10.07.2024	200.057	0,01 %
Minera y Metalurgica del Boleo SA de CV	200.000	2,88 %	07.05.2019	200.038	0,01 %
GS Caltex Corp.	200.000	3,00 %	18.06.2019	200.030	0,01 %
Korea National Oil Corp.	200.000	2,75 %	23.01.2019	199.889	0,01 %
Export-Import Bank von Korea	200.000	2,38 %	12.08.2019	199.034	0,01 %
Korea Hydro & Nuclear Power Co., Ltd.	200.000	2,38 %	28.10.2019	198.257	0,01 %
Korea Resources Corp.	200.000	3,00 %	24.04.2022	197.803	0,01 %
Korea East-West Power Co., Ltd.	200.000	2,50 %	02.06.2020	197.496	0,01 %
Hyundai Capital Services, Inc.	200.000	3,00 %	06.03.2022	197.329	0,01 %
Korea Gas Corp.	200.000	2,75 %	20.07.2022	197.095	0,01 %
Shinhan Bank Co., Ltd.	200.000	2,25 %	15.04.2020	196.757	0,01 %
Koreanische Entwicklungsbank	200.000	2,75 %	19.03.2023	196.322	0,01 %
Korea Gas Corp.	200.000	3,13 %	20.07.2027	196.115	0,01 %
Kia Motors Corp.	200.000	3,25 %	21.04.2026	195.650	0,01 %
Doosan Heavy Industries & Construction Co., Ltd.	200.000	2,13 %	27.04.2020	195.506	0,01 %
Export-Import Bank von Korea	200.000	2,13 %	11.02.2021	195.050	0,01 %
Export-Import Bank von Korea	200.000	2,63 %	26.05.2026	190.386	0,01 %
Export-Import Bank von Korea	200.000	2,38 %	21.04.2027	184.608	0,01 %
Export-Import Bank von Korea	175.000	3,25 %	12.08.2026	174.417	0,01 %
Koreanische Entwicklungsbank	150.000	4,63 %	16.11.2021	158.868	0,01 %
Export-Import Bank von Korea	150.000	4,00 %	14.01.2024	157.251	0,01 %
Koreanische Entwicklungsbank	150.000	3,75 %	22.01.2024	155.304	0,01 %
Hyundai Capital America	150.000	3,00 %	18.03.2021	149.577	0,01 %
Hyundai Capital America	150.000	2,45 %	15.06.2021	146.773	0,01 %
Woori Bank	100.000	4,75 %	30.04.2024	104.693	0,01 %
Hyundai Capital Services, Inc.	100.000	2,88 %	16.03.2021	99.189	0,01 %
Export-Import Bank von Korea	100.000	2,63 %	30.12.2020	99.022	0,01 %
Hyundai Capital America	100.000	2,00 %	01.07.2019	98.789	0,01 %
POSCO	50.000	4,25 %	28.10.2020	51.519	0,00 %
Hyundai Capital America	25.000	3,10 %	05.04.2022	24.928	0,00 %
				17.975.526	0,90 %
Spanien 0,25 % (2016: 0,24 %)					
Telefonica Emisiones SAU	600.000	5,21 %	08.03.2047	679.289	0,03 %
Telefonica Emisiones SAU	475.000	7,05 %	20.06.2036	635.319	0,03 %
Banco Santander SA	400.000	3,50 %	11.04.2022	407.553	0,02 %
Telefonica Emisiones SAU	350.000	5,13 %	27.04.2020	370.459	0,02 %
Telefonica Emisiones SAU	350.000	4,10 %	08.03.2027	360.757	0,02 %
Telefonica Emisiones SAU	325.000	5,46 %	16.02.2021	351.523	0,02 %
Telefonica Europe BV	250.000	8,25 %	15.09.2030	351.472	0,02 %
Santander Issuances SAU	300.000	5,18 %	19.11.2025	322.962	0,02 %
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	275.000	3,00 %	20.10.2020	277.432	0,01 %
Telefonica Emisiones SAU	250.000	5,88 %	15.07.2019	262.779	0,01 %
Telefonica Emisiones SAU	200.000	4,57 %	27.04.2023	215.168	0,01 %
Iberdrola Finance Ireland DAC	200.000	5,00 %	11.09.2019	208.027	0,01 %
Banco Santander SA	200.000	4,25 %	11.04.2027	207.214	0,01 %
Banco Santander SA	200.000	3,80 %	23.02.2028	199.925	0,01 %
Iberdrola International BV	150.000	6,75 %	15.07.2036	196.529	0,01 %
				5.046.408	0,25 %
Supranational 3,93 % (2016: 4,19 %)					
Europäische Investitionsbank	2.850.000	2,00 %	15.03.2021	2.832.535	0,14 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	2.000.000	1,63 %	09.03.2021	1.965.542	0,10 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	1.890.000	2,50 %	25.11.2024	1.892.349	0,09 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	1.850.000	1,38 %	24.05.2021	1.799.308	0,09 %
Europäische Investitionsbank	1.790.000	1,75 %	17.06.2019	1.783.783	0,09 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Europäische Investitionsbank	1.730.000	2,00 %	15.12.2022	1.697.106	0,09 %
International Finance Corp.	1.450.000	1,75 %	16.09.2019	1.443.392	0,07 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	1.350.000	1,63 %	10.02.2022	1.316.909	0,07 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	1.300.000	1,88 %	15.03.2019	1.298.436	0,07 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	1.300.000	1,88 %	07.10.2019	1.297.119	0,07 %
Europäische Investitionsbank	1.275.000	1,38 %	15.06.2020	1.252.765	0,06 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	1.200.000	1,88 %	21.04.2020	1.196.041	0,06 %
IDB Trust Services Ltd.	1.200.000	2,11 %	25.09.2019	1.195.464	0,06 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	1.200.000	1,25 %	26.07.2019	1.186.882	0,06 %
Inter-American Development Bank	1.150.000	3,00 %	04.10.2023	1.184.339	0,06 %
Europäische Investitionsbank	1.150.000	2,50 %	15.04.2021	1.158.706	0,06 %
Inter-American Development Bank	1.150.000	2,13 %	18.01.2022	1.143.384	0,06 %
Europäische Investitionsbank	1.150.000	2,13 %	15.10.2021	1.143.363	0,06 %
Europäische Investitionsbank	1.140.000	1,63 %	14.08.2020	1.126.033	0,06 %
Europäische Investitionsbank	1.000.000	1,88 %	15.03.2019	998.786	0,05 %
Asian Development Bank	1.000.000	1,38 %	15.01.2019	994.377	0,05 %
Asian Development Bank	1.000.000	1,75 %	10.01.2020	994.035	0,05 %
Asian Development Bank	1.000.000	2,50 %	02.11.2027	990.117	0,05 %
Europäische Investitionsbank	1.000.000	1,13 %	15.08.2019	986.567	0,05 %
Europäische Investitionsbank	1.000.000	1,25 %	16.12.2019	985.270	0,05 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	1.000.000	1,88 %	07.10.2022	980.318	0,05 %
Corp.Andina de Fomento	900.000	8,13 %	04.06.2019	970.757	0,05 %
Europäische Investitionsbank	1.000.000	2,13 %	13.04.2026	967.396	0,05 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	975.000	1,13 %	27.11.2019	958.238	0,05 %
Asian Development Bank	950.000	1,75 %	21.03.2019	947.637	0,05 %
Inter-American Development Bank	890.000	3,88 %	17.09.2019	918.082	0,05 %
Europäische Investitionsbank	900.000	1,38 %	15.09.2021	871.102	0,04 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	860.000	1,63 %	04.09.2020	849.264	0,04 %
Inter-American Development Bank	660.000	7,00 %	15.06.2025	833.050	0,04 %
African Development Bank	830.000	2,13 %	16.11.2022	817.879	0,04 %
Europäische Investitionsbank	775.000	4,00 %	16.02.2021	816.845	0,04 %
Inter-American Development Bank	825.000	1,75 %	14.04.2022	806.768	0,04 %
Inter-American Development Bank	800.000	1,88 %	16.06.2020	796.115	0,04 %
Asian Development Bank	790.000	1,75 %	08.06.2021	777.309	0,04 %
Nordic Investment Bank	750.000	1,88 %	14.06.2019	749.273	0,04 %
Inter-American Development Bank	750.000	1,75 %	15.10.2019	746.423	0,04 %
Asian Development Bank	750.000	2,00 %	16.02.2022	741.935	0,04 %
Europäische Investitionsbank	725.000	2,88 %	15.09.2020	738.724	0,04 %
European Stability Mechanism	730.000	2,13 %	03.11.2022	721.383	0,04 %
Inter-American Development Bank	730.000	1,00 %	13.05.2019	720.987	0,04 %
Europäische Investitionsbank	700.000	2,38 %	15.06.2022	700.299	0,04 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	700.000	1,75 %	26.11.2019	695.810	0,03 %
Europäische Investitionsbank	700.000	1,63 %	16.03.2020	693.274	0,03 %
Asian Development Bank	700.000	1,63 %	05.05.2020	693.092	0,03 %
Inter-American Development Bank	700.000	1,88 %	15.03.2021	693.022	0,03 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	700.000	1,38 %	30.03.2020	689.799	0,03 %
Council Of Europe Development Bank	650.000	1,50 %	17.05.2019	646.115	0,03 %
Asian Development Bank	600.000	2,13 %	24.11.2021	594.015	0,03 %
African Development Bank	595.000	1,88 %	16.03.2020	592.978	0,03 %
Asian Development Bank	600.000	1,63 %	16.03.2021	589.583	0,03 %
Europäische Investitionsbank	600.000	1,88 %	10.02.2025	574.210	0,03 %
Asian Development Bank	550.000	2,63 %	12.01.2027	552.224	0,03 %
Asian Development Bank	550.000	2,00 %	22.01.2025	532.661	0,03 %
Inter-American Development Bank	500.000	3,88 %	14.02.2020	518.322	0,03 %
Asian Development Bank	525.000	2,13 %	19.03.2025	511.732	0,03 %
Inter-American Development Bank	520.000	2,38 %	07.07.2027	510.867	0,03 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	500.000	2,25 %	24.06.2021	500.682	0,03 %
Inter-American Development Bank	500.000	2,13 %	09.11.2020	500.078	0,03 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	500.000	2,50 %	29.07.2025	498.623	0,02 %
IDB Trust Services Ltd.	500.000	1,81 %	06.03.2019	498.315	0,02 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	500.000	2,13 %	07.03.2022	495.843	0,02 %
Europäische Investitionsbank	500.000	1,25 %	15.05.2019	495.113	0,02 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	500.000	1,50 %	16.03.2020	493.963	0,02 %
International Finance Corp.	500.000	1,63 %	16.07.2020	493.944	0,02 %
African Development Bank	500.000	1,00 %	15.05.2019	493.203	0,02 %
Europäische Investitionsbank	350.000	4,88 %	15.02.2036	458.273	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	440.000	2,13 %	13.12.2021	438.033	0,02 %
Banque Ouest Africaine de Developpement	400.000	5,00 %	27.07.2027	416.519	0,02 %
Europäische Investitionsbank	400.000	2,13 %	15.03.2019	399.844	0,02 %
Europäische Investitionsbank	400.000	1,88 %	15.10.2019	399.016	0,02 %
Europäische Investitionsbank	400.000	2,25 %	15.08.2022	398.174	0,02 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	400.000	2,00 %	01.02.2021	397.524	0,02 %
Nordic Investment Bank	400.000	2,13 %	01.02.2022	397.215	0,02 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	400.000	2,50 %	22.11.2027	397.064	0,02 %
Asian Development Bank	400.000	1,50 %	22.01.2020	395.654	0,02 %
Inter-American Development Bank	400.000	1,25 %	15.10.2019	394.608	0,02 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	400.000	1,88 %	23.02.2022	393.715	0,02 %
Corp.Andina de Fomento	365.000	2,20 %	18.07.2020	362.327	0,02 %
Inter-American Development Bank	350.000	1,63 %	12.05.2020	346.518	0,02 %
African Development Bank	350.000	1,38 %	12.02.2020	345.276	0,02 %
Nordic Investment Bank	350.000	1,63 %	20.11.2020	344.798	0,02 %
Inter-American Development Bank	300.000	3,88 %	28.10.2041	343.125	0,02 %
African Development Bank	350.000	1,25 %	26.07.2021	337.855	0,02 %
Eurasian Development Bank	300.000	5,00 %	26.09.2020	315.375	0,02 %
Corp.Andina de Fomento	284.000	4,38 %	15.06.2022	301.920	0,02 %
Europäische Investitionsbank	300.000	1,75 %	15.05.2020	297.799	0,01 %
Europäische Investitionsbank	300.000	1,63 %	15.12.2020	295.529	0,01 %
Asian Development Bank	300.000	1,88 %	18.02.2022	293.850	0,01 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	300.000	0,88 %	22.07.2019	293.815	0,01 %
Asian Development Bank	300.000	2,00 %	24.04.2026	288.051	0,01 %
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung	275.000	1,75 %	14.06.2019	274.050	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	200.000	4,75 %	15.02.2035	257.049	0,01 %
Europäische Investitionsbank	250.000	2,50 %	15.10.2024	250.616	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	200.000	7,63 %	19.01.2023	249.316	0,01 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	250.000	1,38 %	22.04.2019	247.851	0,01 %
Asian Development Bank	250.000	2,38 %	10.08.2027	245.569	0,01 %
Europäische Investitionsbank	250.000	2,38 %	24.05.2027	245.040	0,01 %
Corp.Andina de Fomento	245.000	2,00 %	10.05.2019	243.852	0,01 %
Banque Ouest Africaine de Developpement	200.000	5,50 %	06.05.2021	212.536	0,01 %
African Export-Import Bank	200.000	4,13 %	20.06.2024	201.918	0,01 %
Corp.Andina de Fomento	200.000	2,75 %	06.01.2023	198.199	0,01 %
Entwicklungsbank des Europarates	200.000	1,63 %	16.03.2021	196.284	0,01 %
Nordic Investment Bank	200.000	1,25 %	02.08.2021	193.297	0,01 %
Europäische Investitionsbank	170.000	3,25 %	29.01.2024	177.334	0,01 %
International Finance Corp.	175.000	2,13 %	07.04.2026	169.317	0,01 %
Nordic Investment Bank	160.000	1,50 %	09.08.2019	158.838	0,01 %
Inter-American Development Bank	150.000	3,00 %	21.02.2024	154.237	0,01 %
Entwicklungsbank des Europarates	150.000	1,63 %	10.03.2020	148.538	0,01 %
African Development Bank	150.000	1,13 %	04.03.2019	148.495	0,01 %
Inter-American Development Bank	150.000	1,13 %	12.09.2019	147.795	0,01 %
International Finance Corp.	125.000	1,75 %	30.03.2020	124.254	0,01 %
Council Of Europe Development Bank	100.000	1,75 %	14.11.2019	99.411	0,00 %
Internationale Bank für Wiederaufbau & Entwicklung	75.000	2,13 %	01.11.2020	75.011	0,00 %
Inter-American Development Bank	50.000	3,20 %	07.08.2042	50.996	0,00 %
				78.371.540	3,93 %
Schweden 0,75 % (2016: 0,89 %)					
Kommuninvest I Sverige AB	1.220.000	2,00 %	12.11.2019	1.216.915	0,06 %
Sweden Government International Bond	850.000	1,63 %	24.03.2020	842.554	0,04 %
Sweden Government International Bond	800.000	1,63 %	06.04.2020	793.069	0,04 %
Svensk Exportkredit AB	765.000	1,75 %	18.05.2020	757.438	0,04 %
Nordea Bank AB	700.000	2,50 %	17.09.2020	700.006	0,04 %
Sweden Government International Bond	650.000	1,50 %	25.07.2019	645.195	0,03 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	600.000	2,63 %	15.03.2021	602.379	0,03 %
Svensk Exportkredit AB	550.000	1,25 %	12.04.2019	544.602	0,03 %
Svenska Handelsbanken AB	500.000	2,45 %	30.03.2021	499.453	0,03 %
Stadshypotek AB	500.000	1,88 %	02.10.2019	496.434	0,03 %
Sweden Government International Bond	500.000	1,13 %	15.03.2019	495.016	0,03 %
Nordea Bank AB	500.000	1,63 %	30.09.2019	494.492	0,02 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	500.000	1,88 %	13.09.2021	487.566	0,02 %
Svenska Handelsbanken AB	475.000	1,50 %	06.09.2019	469.148	0,02 %
Svenska Handelsbanken AB	475.000	1,88 %	07.09.2021	463.893	0,02 %
Stadshypotek AB	450.000	1,75 %	09.04.2020	443.843	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Nordea Bank AB	350.000	4,88 %	27.01.2020	367.511	0,02 %
Svensk Exportkredit AB	350.000	1,88 %	17.06.2019	349.209	0,02 %
Svenska Handelsbanken AB	325.000	2,25 %	17.06.2019	325.448	0,02 %
Nordea Bank AB	300.000	4,88 %	13.05.2021	318.393	0,02 %
Kommuninvest I Sverige AB	300.000	1,13 %	17.09.2019	295.128	0,02 %
Nordea Bank AB	275.000	4,88 %	14.01.2021	293.243	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	250.000	2,80 %	11.03.2022	252.218	0,01 %
Swedbank AB	250.000	2,80 %	14.03.2022	251.033	0,01 %
Swedbank AB	250.000	2,65 %	10.03.2021	250.644	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	250.000	2,30 %	11.03.2020	249.419	0,01 %
Kommuninvest I Sverige AB	250.000	1,63 %	01.09.2020	246.564	0,01 %
Svensk Exportkredit AB	250.000	1,75 %	10.03.2021	245.988	0,01 %
Svensk Exportkredit AB	250.000	2,00 %	30.08.2022	245.028	0,01 %
Svenska Handelsbanken AB	225.000	2,50 %	25.01.2019	225.884	0,01 %
Svenska Handelsbanken AB	200.000	5,13 %	30.03.2020	212.003	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	200.000	2,63 %	17.11.2020	200.802	0,01 %
Swedbank AB	200.000	2,38 %	27.02.2019	200.295	0,01 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	200.000	2,45 %	27.05.2020	200.281	0,01 %
Svensk Exportkredit AB	200.000	1,75 %	28.08.2020	197.515	0,01 %
Svensk Exportkredit AB	150.000	1,13 %	28.08.2019	147.580	0,01 %
				15.026.189	0,75 %
Schweiz 1,21 % (2016: 1,17 %)					
Credit Suisse AG	1.318.000	2,30 %	28.05.2019	1.320.276	0,07 %
UBS Group Funding Switzerland AG	1.100.000	3,00 %	15.04.2021	1.107.010	0,06 %
Glencore Finance Canada Ltd.	825.000	4,95 %	15.11.2021	878.625	0,04 %
Credit Suisse Group AG	750.000	4,28 %	09.01.2028	779.596	0,04 %
Credit Suisse AG	760.000	3,00 %	29.10.2021	768.150	0,04 %
Credit Suisse Group AG	750.000	3,57 %	09.01.2023	761.347	0,04 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	700.000	3,80 %	09.06.2023	719.562	0,04 %
UBS AG	688.000	2,38 %	14.08.2019	688.332	0,03 %
Novartis Securities Investment Ltd.	625.000	5,13 %	10.02.2019	645.053	0,03 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	555.000	4,88 %	15.05.2045	638.981	0,03 %
UBS Group Funding Switzerland AG	600.000	4,25 %	23.03.2028	630.377	0,03 %
Glencore Finance Canada Ltd.	600.000	4,25 %	25.10.2022	627.750	0,03 %
Novartis Capital Corp.	625.000	2,40 %	21.09.2022	620.718	0,03 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	550.000	3,75 %	26.03.2025	559.947	0,03 %
Credit Suisse AG	500.000	3,63 %	09.09.2024	516.195	0,03 %
UBS Group Funding Switzerland AG	500.000	3,49 %	23.05.2023	507.766	0,03 %
Roche Holdings, Inc.	525.000	1,75 %	28.01.2022	504.822	0,03 %
Roche Holdings, Inc.	500.000	3,00 %	10.11.2025	500.878	0,02 %
Credit Suisse Group AG^	500.000	3,00 %	14.12.2023	493.925	0,02 %
UBS Group Funding Switzerland AG^	500.000	2,86 %	15.08.2023	493.922	0,02 %
Novartis Capital Corp.	400.000	4,40 %	06.05.2044	459.108	0,02 %
Roche Holdings, Inc.	400.000	4,00 %	28.11.2044	430.746	0,02 %
Credit Suisse AG	400.000	5,40 %	14.01.2020	421.693	0,02 %
Roche Holdings, Inc.	400.000	3,35 %	30.09.2024	412.563	0,02 %
LafargeHolcim Finance US LLC	400.000	3,50 %	22.09.2026	395.500	0,02 %
Novartis Capital Corp.	375.000	1,80 %	14.02.2020	371.387	0,02 %
Glencore Funding LLC	350.000	4,13 %	30.05.2023	361.813	0,02 %
UBS AG	350.000	2,20 %	08.06.2020	347.872	0,02 %
Glencore Funding LLC	325.000	4,63 %	29.04.2024	342.469	0,02 %
Novartis Capital Corp.	300.000	4,00 %	20.11.2045	325.817	0,02 %
UBS Group Funding Switzerland AG	300.000	4,13 %	24.09.2025	314.147	0,02 %
Credit Suisse AG	300.000	5,30 %	13.08.2019	314.032	0,02 %
Novartis Capital Corp.	300.000	3,40 %	06.05.2024	311.900	0,02 %
Roche Holdings, Inc.	300.000	2,88 %	29.09.2021	304.257	0,02 %
Glencore Funding LLC	300.000	4,00 %	16.04.2025	303.750	0,02 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	300.000	2,75 %	26.03.2020	300.775	0,01 %
Roche Holdings, Inc.	300.000	2,63 %	15.05.2026	291.845	0,01 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	250.000	4,55 %	17.04.2026	266.796	0,01 %
Novartis Capital Corp.	250.000	4,40 %	24.04.2020	262.254	0,01 %
UBS Group Funding Switzerland AG	250.000	4,13 %	15.04.2026	261.792	0,01 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	250.000	3,45 %	16.04.2021	255.024	0,01 %
ABB Finance USA, Inc.	250.000	2,88 %	08.05.2022	254.200	0,01 %
Novartis Capital Corp.	250.000	3,10 %	17.05.2027	253.981	0,01 %
UBS AG	225.000	2,35 %	26.03.2020	225.001	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
UBS Group Funding Switzerland AG	215.000	2,95 %	24.09.2020	216.912	0,01 %
ABB Finance USA, Inc.	200.000	4,38 %	08.05.2042	214.406	0,01 %
LafargeHolcim Finance US LLC	200.000	4,75 %	22.09.2046	212.226	0,01 %
Novartis Capital Corp.	200.000	3,00 %	20.11.2025	201.615	0,01 %
UBS AG	200.000	2,45 %	01.12.2020	199.279	0,01 %
Holcim US Finance Sarl & Cie SCS	175.000	5,15 %	12.09.2023	190.969	0,01 %
Glencore Finance Canada Ltd.	150.000	5,55 %	25.10.2042	165.938	0,01 %
UBS AG	150.000	4,88 %	04.08.2020	158.830	0,01 %
ABB Treasury Center USA, Inc.	150.000	4,00 %	15.06.2021	157.165	0,01 %
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	150.000	3,80 %	15.09.2022	154.523	0,01 %
Novartis Capital Corp.	150.000	2,40 %	17.05.2022	149.351	0,01 %
Roche Holdings, Inc.	150.000	2,38 %	28.01.2027	141.978	0,01 %
Novartis Capital Corp.	125.000	3,70 %	21.09.2042	128.205	0,01 %
Roche Holdings, Inc.	100.000	2,25 %	30.09.2019	100.129	0,00 %
Glencore Funding LLC	100.000	3,00 %	27.10.2022	98.803	0,00 %
Syngenta Finance NV	100.000	3,13 %	28.03.2022	96.903	0,00 %
Glencore Funding LLC	50.000	4,00 %	27.03.2027	49.942	0,00 %
				24.189.128	1,21 %
Taiwan 0,01 % (2016: 0,04 %)					
Formosa Group Cayman Ltd.	200.000	3,38 %	22.04.2025	199.500	0,01 %
				199.500	0,01 %
Thailand 0,08 % (2016: 0,13 %)					
Thai Oil PCL	250.000	4,88 %	23.01.2043	272.188	0,02 %
PTTEP Canada International Finance Ltd.	200.000	6,35 %	12.06.2042	259.750	0,01 %
PTT Global Chemical PCL	225.000	4,25 %	19.09.2022	235.437	0,01 %
Bangkok Bank PCL	225.000	3,88 %	27.09.2022	233.206	0,01 %
PTT PCL	200.000	4,50 %	25.10.2042	206.892	0,01 %
Siam Commercial Bank PCL	200.000	3,50 %	07.04.2019	202.057	0,01 %
Bangkok Bank PCL	125.000	9,03 %	15.03.2029	175.891	0,01 %
				1.585.421	0,08 %
Trinidad & Tobago 0,01 % (2016: 0,02 %)					
Trinidad Generation UnLtd	200.000	5,25 %	04.11.2027	204.500	0,01 %
				204.500	0,01 %
Türkei 0,05 % (2016: 0,05 %)					
Türk Telekomunikasyon A.S.	200.000	4,88 %	19.06.2024	203.500	0,01 %
Türkiye Garanti Bankasi A.S.	200.000	4,75 %	17.10.2019	203.304	0,01 %
KOC Holding A.S.	200.000	3,50 %	24.04.2020	200.281	0,01 %
KOC Holding A.S.	200.000	3,50 %	24.04.2020	200.253	0,01 %
Coca-Cola Icecek A.S.	125.000	4,22 %	19.09.2024	126.162	0,01 %
Türk Telekomunikasyon A.S.	100.000	3,75 %	19.06.2019	100.625	0,00 %
				1.034.125	0,05 %
VAE 0,45 % (2016: 0,40 %)					
Abu Dhabi Government International Bond	1.200.000	3,13 %	11.10.2027	1.175.219	0,06 %
Emaar Sukuk Ltd.	600.000	3,64 %	15.09.2026	585.222	0,03 %
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	500.000	5,88 %	13.12.2021	550.265	0,03 %
Abu Dhabi Government International Bond	550.000	2,13 %	03.05.2021	539.611	0,03 %
Abu Dhabi Government International Bond	500.000	6,75 %	08.04.2019	528.124	0,03 %
DP World Crescent Ltd.	500.000	3,91 %	31.05.2023	510.000	0,03 %
DIB Sukuk Ltd.	500.000	3,66 %	14.02.2022	504.420	0,03 %
Abu Dhabi Government International Bond	500.000	3,13 %	03.05.2026	494.215	0,02 %
Dubai Electricity & Water Authority	400.000	7,38 %	21.10.2020	448.531	0,02 %
DP World Ltd.	350.000	6,85 %	02.07.2037	435.402	0,02 %
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	330.000	6,50 %	27.10.2036	420.810	0,02 %
Dolphin Energy Ltd.	300.000	5,50 %	15.12.2021	325.585	0,02 %
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	300.000	4,38 %	22.06.2026	309.220	0,02 %
First Abu Dhabi Bank PJSC	300.000	2,25 %	11.02.2020	296.982	0,01 %
Ruwais Power Co. PJSC	250.000	6,00 %	31.08.2036	293.437	0,01 %
Abu Dhabi Government International Bond	250.000	6,75 %	08.04.2019	264.045	0,01 %
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	250.000	3,88 %	06.05.2024	253.120	0,01 %
Emirates Telecommunications Group Co. PJSC	200.000	3,50 %	18.06.2024	204.270	0,01 %
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	200.000	3,63 %	12.01.2023	202.389	0,01 %
DP World Ltd.	200.000	3,25 %	18.05.2020	202.136	0,01 %
Emirates NBD PJSC	200.000	3,25 %	19.11.2019	201.758	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Emirates NBD PJSC^	200.000	4,88 %	28.03.2023	200.240	0,01 %
				8.945.001	0,45 %
Vereinigtes Königreich 3,34 % (2016: 3,25 %)					
HSBC Holdings plc	1.100.000	2,65 %	05.01.2022	1.091.946	0,05 %
HSBC Holdings plc	1.000.000	3,90 %	25.05.2026	1.034.413	0,05 %
Bank of England Euro Note	1.000.000	1,25 %	14.03.2019	991.293	0,05 %
GlaxoSmithKline Capital, Inc.	700.000	6,38 %	15.05.2038	987.022	0,05 %
HSBC Holdings plc	961.000	3,40 %	08.03.2021	981.503	0,05 %
HSBC Holdings plc	750.000	6,50 %	02.05.2036	979.900	0,05 %
British Telecommunications plc	650.000	9,13 %	15.12.2030	966.861	0,05 %
HSBC Holdings plc	800.000	5,25 %	14.03.2044	940.590	0,05 %
BP Capital Markets plc	900.000	2,24 %	10.05.2019	901.350	0,05 %
AstraZeneca plc	650.000	6,45 %	15.09.2037	878.138	0,04 %
Barclays plc	800.000	5,20 %	12.05.2026	853.510	0,04 %
HSBC Holdings plc	775.000	5,10 %	05.04.2021	832.197	0,04 %
BAT Capital Corp.	825.000	3,56 %	15.08.2027	825.820	0,04 %
Sky plc	750.000	3,75 %	16.09.2024	779.530	0,04 %
BG Energy Capital plc	700.000	4,00 %	15.10.2021	733.663	0,04 %
Barclays plc	700.000	3,68 %	10.01.2023	709.917	0,04 %
HSBC Holdings plc	650.000	4,30 %	08.03.2026	690.279	0,03 %
HSBC Holdings plc	625.000	4,25 %	14.03.2024	651.081	0,03 %
Anglo American Capital plc	600.000	4,88 %	14.05.2025	633.750	0,03 %
BAT Capital Corp.	600.000	4,54 %	15.08.2047	631.596	0,03 %
Standard Chartered plc	525.000	5,70 %	26.03.2044	630.199	0,03 %
BAT Capital Corp.	600.000	4,39 %	15.08.2037	628.500	0,03 %
HSBC Holdings plc^	600.000	4,04 %	13.03.2028	624.553	0,03 %
Barclays plc	600.000	4,38 %	12.01.2026	624.321	0,03 %
AstraZeneca plc	625.000	3,13 %	12.06.2027	618.461	0,03 %
BAT Capital Corp.	600.000	2,76 %	15.08.2022	596.624	0,03 %
BAT Capital Corp.	600.000	2,30 %	14.08.2020	596.494	0,03 %
Reckitt Benckiser Treasury Services plc	600.000	3,00 %	26.06.2027	584.755	0,03 %
BP Capital Markets plc	550.000	4,50 %	01.10.2020	581.099	0,03 %
Reckitt Benckiser Treasury Services plc	575.000	2,38 %	24.06.2022	560.906	0,03 %
Reckitt Benckiser Treasury Services plc	575.000	2,75 %	26.06.2024	559.537	0,03 %
Barclays plc	500.000	4,95 %	10.01.2047	556.813	0,03 %
Barclays plc	550.000	3,65 %	16.03.2025	549.825	0,03 %
Royal Bank of Scotland Group plc	500.000	6,40 %	21.10.2019	532.603	0,03 %
Diageo Investment Corp.	525.000	2,88 %	11.05.2022	531.014	0,03 %
Barclays plc	500.000	4,34 %	10.01.2028	516.111	0,03 %
HSBC Holdings plc	500.000	3,60 %	25.05.2023	514.459	0,03 %
Anglo American Capital plc	500.000	4,13 %	15.04.2021	514.375	0,03 %
Lloyds Banking Group plc	500.000	3,75 %	11.01.2027	506.715	0,03 %
Lloyds Banking Group plc	500.000	3,10 %	06.07.2021	505.067	0,03 %
Standard Chartered plc	500.000	3,05 %	15.01.2021	504.411	0,03 %
BP Capital Markets plc	500.000	2,52 %	15.01.2020	503.282	0,03 %
BP Capital Markets plc	500.000	2,32 %	13.02.2020	501.391	0,03 %
Santander UK plc	500.000	2,50 %	14.03.2019	501.384	0,03 %
Nationwide Building Society^	500.000	4,13 %	18.10.2032	500.293	0,02 %
BAT Capital Corp.	500.000	3,22 %	15.08.2024	500.045	0,02 %
Santander UK Group Holdings plc^	500.000	3,82 %	03.11.2028	499.921	0,02 %
Vodafone Group plc	400.000	6,15 %	27.02.2037	499.856	0,02 %
Santander UK Group Holdings plc	485.000	3,13 %	08.01.2021	489.879	0,02 %
HSBC Holdings plc	475.000	2,95 %	25.05.2021	478.133	0,02 %
Lloyds Banking Group plc	450.000	4,65 %	24.03.2026	473.384	0,02 %
BAT International Finance plc	450.000	3,95 %	15.06.2025	467.230	0,02 %
HSBC Capital Funding Dollar1 LP^	275.000	10,18 %	31.12.2166	446.838	0,02 %
HSBC Holdings plc	425.000	4,00 %	30.03.2022	444.301	0,02 %
Santander UK plc	400.000	5,00 %	07.11.2023	427.635	0,02 %
Lloyds Bank plc	400.000	5,80 %	13.01.2020	426.028	0,02 %
Santander UK plc	425.000	2,38 %	16.03.2020	425.048	0,02 %
BP Capital Markets plc	400.000	3,56 %	01.11.2021	415.173	0,02 %
Rolls-Royce plc	400.000	3,63 %	14.10.2025	412.604	0,02 %
Standard Chartered plc	400.000	4,30 %	19.02.2027	407.721	0,02 %
Royal Bank of Scotland Group plc	400.000	3,88 %	12.09.2023	406.534	0,02 %
GlaxoSmithKline Capital plc	400.000	2,85 %	08.05.2022	404.824	0,02 %
BP Capital Markets plc	400.000	3,12 %	04.05.2026	402.876	0,02 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Vodafone Group plc	400.000	2,95 %	19.02.2023	402.179	0,02 %
Diageo Capital plc	400.000	2,63 %	29.04.2023	399.300	0,02 %
Lloyds Bank plc	400.000	2,05 %	22.01.2019	399.075	0,02 %
BAE Systems Finance, Inc.	300.000	7,50 %	01.07.2027	389.048	0,02 %
Vodafone Group plc	375.000	4,38 %	19.02.2043	384.301	0,02 %
Imperial Brands Finance plc	375.000	2,95 %	21.07.2020	378.317	0,02 %
Barclays plc	375.000	2,75 %	08.11.2019	376.048	0,02 %
HSBC Holdings plc	275.000	6,80 %	01.06.2038	375.413	0,02 %
Santander UK Group Holdings plc	375.000	2,88 %	05.08.2021	374.618	0,02 %
AstraZeneca plc	375.000	2,38 %	16.11.2020	374.172	0,02 %
Lloyds Banking Group plc	356.000	4,58 %	10.12.2025	371.822	0,02 %
Massachusetts Electric Co.	285.000	5,90 %	15.11.2039	369.635	0,02 %
BP Capital Markets plc	350.000	3,81 %	10.02.2024	368.279	0,02 %
Lloyds Banking Group plc	350.000	4,50 %	04.11.2024	366.880	0,02 %
Imperial Brands Finance plc	350.000	4,25 %	21.07.2025	366.463	0,02 %
Standard Chartered plc	350.000	4,05 %	12.04.2026	359.038	0,02 %
BP Capital Markets plc	350.000	3,06 %	17.03.2022	357.170	0,02 %
Barclays plc	350.000	3,20 %	10.08.2021	352.311	0,02 %
BAT International Finance plc	350.000	2,75 %	15.06.2020	351.362	0,02 %
BP Capital Markets plc	350.000	3,02 %	16.01.2027	345.427	0,02 %
BP Capital Markets plc	325.000	3,51 %	17.03.2025	336.334	0,02 %
Royal Bank of Scotland Group plc	300.000	4,80 %	05.04.2026	322.073	0,02 %
BP Capital Markets plc	300.000	4,74 %	11.03.2021	321.105	0,02 %
Nationwide Building Society	300.000	3,90 %	21.07.2025	313.277	0,02 %
Vodafone Group plc	300.000	5,45 %	10.06.2019	313.170	0,02 %
HSBC Holdings plc	300.000	4,38 %	23.11.2026	313.027	0,02 %
HSBC Bank plc	300.000	4,13 %	12.08.2020	312.392	0,02 %
BAT International Finance plc	300.000	3,25 %	07.06.2022	303.523	0,02 %
GlaxoSmithKline Capital, Inc.	300.000	2,80 %	18.03.2023	302.830	0,02 %
Standard Chartered plc	300.000	3,95 %	11.01.2023	302.657	0,02 %
BP Capital Markets plc	300.000	2,75 %	10.05.2023	300.667	0,01 %
RELX Capital, Inc.	300.000	3,13 %	15.10.2022	300.525	0,01 %
Network Rail Infrastructure Finance plc	300.000	1,75 %	24.01.2019	299.301	0,01 %
Standard Chartered plc	300.000	2,40 %	08.09.2019	299.294	0,01 %
CNH Industrial NV	300.000	3,85 %	15.11.2027	299.250	0,01 %
BP Capital Markets plc	300.000	2,50 %	06.11.2022	298.034	0,01 %
HSBC Bank plc	275.000	4,75 %	19.01.2021	292.240	0,01 %
BP AMI Leasing, Inc.	275.000	5,52 %	08.05.2019	286.298	0,01 %
Centrica plc	250.000	5,38 %	16.10.2043	285.544	0,01 %
Barclays Bank plc	270.000	5,14 %	14.10.2020	285.226	0,01 %
Barclays Bank plc	225.000	10,18 %	12.06.2021	273.690	0,01 %
Vodafone Group plc	200.000	7,88 %	15.02.2030	269.810	0,01 %
Standard Chartered plc	250.000	5,20 %	26.01.2024	268.203	0,01 %
BP Capital Markets plc	255.000	3,54 %	04.11.2024	265.058	0,01 %
Imperial Brands Finance plc	250.000	3,75 %	21.07.2022	257.593	0,01 %
WPP Finance 2010	250.000	3,63 %	07.09.2022	257.204	0,01 %
BP Capital Markets plc	250.000	3,25 %	06.05.2022	256.733	0,01 %
Barclays plc	250.000	4,38 %	11.09.2024	256.410	0,01 %
AstraZeneca plc	235.000	4,38 %	16.11.2045	255.383	0,01 %
Lloyds Banking Group plc	250.000	3,00 %	11.01.2022	250.709	0,01 %
Barclays plc	250.000	2,88 %	08.06.2020	250.675	0,01 %
Royal Bank of Scotland Group plc^	250.000	3,50 %	15.05.2023	250.354	0,01 %
Vodafone Group plc	250.000	2,50 %	26.09.2022	247.957	0,01 %
AstraZeneca plc	250.000	2,38 %	12.06.2022	245.438	0,01 %
Santander UK Group Holdings plc	200.000	5,63 %	15.09.2045	240.306	0,01 %
Lloyds Banking Group plc	200.000	5,30 %	01.12.2045	235.083	0,01 %
Barclays plc	200.000	5,25 %	17.08.2045	232.186	0,01 %
HSBC Holdings plc	175.000	6,50 %	15.09.2037	230.420	0,01 %
AstraZeneca plc	225.000	4,00 %	18.09.2042	228.761	0,01 %
Imperial Brands Finance plc	225.000	3,50 %	11.02.2023	228.720	0,01 %
Niagara Mohawk Power Corp.	225.000	2,72 %	28.11.2022	223.121	0,01 %
Unilever Capital Corp.	225.000	2,20 %	05.05.2022	222.652	0,01 %
Nationwide Building Society	200.000	6,25 %	25.02.2020	215.780	0,01 %
Standard Chartered plc	200.000	5,20 %	26.01.2024	214.647	0,01 %
Heathrow Funding Ltd.	200.000	4,88 %	15.07.2021	213.837	0,01 %
WPP Finance 2010	200.000	4,75 %	21.11.2021	213.683	0,01 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Legal & General Group plc^	200.000	5,25 %	21.03.2047	210.860	0,01 %
Santander UK Group Holdings plc	200.000	4,75 %	15.09.2025	209.650	0,01 %
Friends Life Holdings plc^	200.000	7,88 %	08.05.2166	209.250	0,01 %
BP Capital Markets plc	200.000	3,72 %	28.11.2028	208.539	0,01 %
HSBC Holdings plc	150.000	6,10 %	14.01.2042	205.982	0,01 %
BP Capital Markets plc	200.000	3,22 %	28.11.2023	204.224	0,01 %
HSBC Holdings plc^	200.000	3,26 %	13.03.2023	202.545	0,01 %
Santander UK Group Holdings plc	200.000	3,57 %	10.01.2023	202.536	0,01 %
Barclays plc	200.000	3,25 %	12.01.2021	201.812	0,01 %
HSBC Holdings plc^	200.000	3,03 %	22.11.2023	200.342	0,01 %
Santander UK plc	200.000	2,35 %	10.09.2019	200.053	0,01 %
AstraZeneca plc	200.000	1,95 %	18.09.2019	198.655	0,01 %
Rolls-Royce plc	200.000	2,38 %	14.10.2020	198.612	0,01 %
Unilever Capital Corp.	200.000	1,80 %	05.05.2020	198.324	0,01 %
Nationwide Building Society	200.000	2,45 %	27.07.2021	198.277	0,01 %
Lloyds Banking Group plc^	200.000	3,57 %	07.11.2028	198.183	0,01 %
Lloyds Banking Group plc^	200.000	2,91 %	07.11.2023	198.052	0,01 %
Santander UK plc	200.000	2,13 %	03.11.2020	198.018	0,01 %
BP Capital Markets plc	175.000	3,99 %	26.09.2023	185.848	0,01 %
British Telecommunications plc	175.000	2,35 %	14.02.2019	175.203	0,01 %
Nationwide Building Society	175.000	2,35 %	21.01.2020	174.794	0,01 %
BAE Systems plc	150.000	4,75 %	11.10.2021	159.044	0,01 %
BAE Systems Holdings, Inc.	150.000	3,80 %	07.10.2024	155.756	0,01 %
BAE Systems Holdings, Inc.	150.000	3,85 %	15.12.2025	154.804	0,01 %
WPP Finance 2010	150.000	3,75 %	19.09.2024	152.900	0,01 %
BAE Systems Holdings, Inc.	150.000	2,85 %	15.12.2020	150.598	0,01 %
Lloyds Bank plc	150.000	2,40 %	17.03.2020	150.001	0,01 %
Diageo Investment Corp.	100.000	7,45 %	15.04.2035	145.708	0,01 %
WPP Finance 2010	125.000	5,63 %	15.11.2043	145.223	0,01 %
GlaxoSmithKline Capital, Inc.	125.000	4,20 %	18.03.2043	138.384	0,01 %
British Airways 2013-1 Klasse A Pass Through Trust	129.818	4,63 %	20.06.2024	137.164	0,01 %
Diageo Capital plc	100.000	5,88 %	30.09.2036	131.884	0,01 %
Diageo Capital plc	125.000	3,88 %	29.04.2043	130.808	0,01 %
Standard Chartered plc	125.000	2,25 %	17.04.2020	123.925	0,01 %
United Utilities plc	100.000	6,88 %	15.08.2028	121.429	0,01 %
Standard Chartered plc	100.000	5,30 %	09.01.2043	115.002	0,01 %
Lloyds Bank plc	100.000	6,50 %	14.09.2020	109.382	0,01 %
Diageo Investment Corp.	100.000	4,25 %	11.05.2042	108.880	0,01 %
Vodafone Group plc	100.000	4,38 %	16.03.2021	105.655	0,01 %
Trinity Acquisition plc	100.000	4,40 %	15.03.2026	104.372	0,01 %
Citizens Financial Group, Inc.	100.000	4,15 %	28.09.2022	103.507	0,01 %
BP Capital Markets plc	100.000	4,75 %	10.03.2019	103.094	0,01 %
United Utilities plc	100.000	5,38 %	01.02.2019	102.893	0,01 %
New England Power Co.	100.000	3,80 %	05.12.2047	102.278	0,00 %
BP Capital Markets plc	100.000	3,28 %	19.09.2027	100.948	0,00 %
Sky plc	100.000	3,13 %	26.11.2022	100.790	0,00 %
Smiths Group plc	100.000	3,63 %	12.10.2022	100.610	0,00 %
TechnipFMC plc	100.000	3,45 %	01.10.2022	99.500	0,00 %
BAE Systems Holdings, Inc.	50.000	4,75 %	07.10.2044	55.476	0,00 %
BP Capital Markets plc	50.000	2,52 %	19.09.2022	49.790	0,00 %
BP Capital Markets plc	50.000	1,77 %	19.09.2019	49.636	0,00 %
WPP Finance 2010	25.000	5,13 %	07.09.2042	26.489	0,00 %
				66.533.308	3,34 %
Uruguay 0,16 % (2016: 0,15 %)					
Uruguay Government International Bond	900.000	5,10 %	18.06.2050	1.000.125	0,05 %
Uruguay Government International Bond	750.000	4,38 %	27.10.2027	807.187	0,04 %
Uruguay Government International Bond	475.000	7,63 %	21.03.2036	676.875	0,03 %
Uruguay Government International Bond	300.000	4,50 %	14.08.2024	325.231	0,02 %
Uruguay Government International Bond	100.000	7,88 %	15.01.2033	142.875	0,01 %
Uruguay Government International Bond	132.537	4,13 %	20.11.2045	133.034	0,01 %
Uruguay Government International Bond	100.000	8,00 %	18.11.2022	120.750	0,00 %
				3.206.077	0,16 %
Summe Anleihen				1.974.468.592	99,00 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				1.974.468.592	99,00 %

	Anzahl der Kontrakte	Nominalbetrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt-nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente				
Futures (0,00 %) (2016: (0,00 %))				
US 10-Year Note März 2018	(55)	(6.849.797)	27.219	0,00 %
US Lond Bond März 2018	15	2.295.000	—	0,00 %
US 5-Year Note März 2018	41	4.763.367	(641)	(0,00 %)
US Ultra Bond März 2018	(7)	(1.164.062)	(9.531)	(0,00 %)
US 2-Year Note März 2018	76	16.281.938	(9.625)	(0,00 %)
US 10-Year Ultra Futures März 2018	(48)	(6.397.060)	(13.940)	(0,00 %)
			(6.518)	(0,00 %)

Währung	Kaufbetrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt-nettovermögens
Offene Devisenterminkontrakte zu Absicherungszwecken auf Ebene der Anteilsklasse (0,04 %) (2016: (0,27 %))							
EUR	62.742.081	USD	(74.974.904)	BNP Paribas	03.01.2018	365.801	0,02 %
GBP	2.036.073	USD	(2.725.446)	BNP Paribas	03.01.2018	28.851	0,00 %
GBP	371.926.682	USD	(503.634.474)	JP Morgan Chase	02.02.2018	22.746	0,00 %
GBP	2.615.960	USD	(3.517.943)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	20.796	0,00 %
GBP	1.285.073	USD	(1.721.341)	BNP Paribas	03.01.2018	17.041	0,00 %
GBP	1.182.913	USD	(1.589.376)	BNP Paribas	03.01.2018	10.809	0,00 %
GBP	946.168	USD	(1.270.732)	BNP Paribas	03.01.2018	9.197	0,00 %
EUR	46.912.876	USD	(56.432.202)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	8.007	0,00 %
GBP	611.290	USD	(819.293)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	7.629	0,00 %
GBP	396.571	USD	(529.350)	BNP Paribas	03.01.2018	7.112	0,00 %
EUR	507.858	USD	(603.121)	BNP Paribas	03.01.2018	6.715	0,00 %
EUR	987.771	USD	(1.180.344)	BNP Paribas	03.01.2018	5.772	0,00 %
EUR	158.234	USD	(186.007)	BNP Paribas	03.01.2018	4.000	0,00 %
GBP	415.860	USD	(558.860)	BNP Paribas	03.01.2018	3.694	0,00 %
EUR	156.071	USD	(184.409)	BNP Paribas	03.01.2018	3.001	0,00 %
EUR	444.619	USD	(531.200)	BNP Paribas	03.01.2018	2.699	0,00 %
EUR	91.291	USD	(107.712)	BNP Paribas	03.01.2018	1.910	0,00 %
EUR	115.549	USD	(137.006)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	1.745	0,00 %
EUR	80.079	USD	(94.750)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	1.409	0,00 %
EUR	151.548	USD	(180.923)	BNP Paribas	03.01.2018	1.056	0,00 %
EUR	87.843	USD	(104.482)	BNP Paribas	03.01.2018	999	0,00 %
EUR	39.385	USD	(46.384)	BNP Paribas	03.01.2018	910	0,00 %
EUR	64.913	USD	(77.133)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	815	0,00 %
EUR	30.085	USD	(35.454)	BNP Paribas	03.01.2018	672	0,00 %
GBP	126.348	USD	(170.268)	BNP Paribas	03.01.2018	649	0,00 %
EUR	19.951	USD	(23.583)	BNP Paribas	03.01.2018	374	0,00 %
EUR	34.875	USD	(41.514)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	364	0,00 %
EUR	49.683	USD	(59.369)	BNP Paribas	03.01.2018	290	0,00 %
GBP	1.049.264	USD	(1.420.663)	JP Morgan Chase	02.02.2018	234	0,00 %
USD	226.837	GBP	(167.547)	BNP Paribas	03.01.2018	188	0,00 %
EUR	10.974	USD	(13.000)	BNP Paribas	03.01.2018	178	0,00 %
GBP	35.735	USD	(48.227)	BNP Paribas	03.01.2018	114	0,00 %
EUR	8.570	USD	(10.209)	BNP Paribas	03.01.2018	82	0,00 %
USD	503.634.474	GBP	(372.304.176)	JP Morgan Chase	03.01.2018	74	0,00 %
EUR	233.107	USD	(280.405)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	43	0,00 %
GBP	41.671	USD	(56.329)	BNP Paribas	03.01.2018	42	0,00 %
EUR	55.052	USD	(66.198)	UBS	02.02.2018	34	0,00 %
CHF	5.192	USD	(5.303)	BNP Paribas	04.01.2018	25	0,00 %
USD	5.050	GBP	(3.726)	BNP Paribas	03.01.2018	10	0,00 %
EUR	5.032	USD	(6.053)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	1	0,00 %
CHF	49	USD	(50)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	—	0,00 %
CHF	30	USD	(31)	BNP Paribas	04.01.2018	—	0,00 %
USD	10	CHF	(10)	BNP Paribas	04.01.2018	—	0,00 %
CHF	42	USD	(43)	BNP Paribas	04.01.2018	—	0,00 %
USD	1	CHF	(1)	BNP Paribas	04.01.2018	—	0,00 %
USD	25	CHF	(24)	Brown Brothers Harriman & Co.	04.01.2018	—	0,00 %
USD	46.411	EUR	(38.650)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	—	0,00 %
GBP	640.098	USD	(865.892)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	—	0,00 %

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf-) betrag	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
CHF	5.218	USD	(5.366)	UBS	02.02.2018	—	0,00 %
USD	5.366	CHF	(5.229)	UBS	04.01.2018	—	0,00 %
CHF	6	USD	(6)	UBS	02.02.2018	—	0,00 %
USD	19.146	GBP	(14.141)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(3)	(0,00 %)
USD	56.432.202	EUR	(46.995.505)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(10)	(0,00 %)
USD	10.280	GBP	(7.661)	BNP Paribas	03.01.2018	(84)	(0,00 %)
USD	26.855	GBP	(20.006)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(209)	(0,00 %)
USD	39.440	EUR	(33.042)	BNP Paribas	03.01.2018	(236)	(0,00 %)
USD	146.119	GBP	(108.108)	BNP Paribas	02.02.2018	(280)	(0,00 %)
USD	21.109	GBP	(15.822)	BNP Paribas	03.01.2018	(294)	(0,00 %)
USD	43.317	GBP	(32.384)	BNP Paribas	03.01.2018	(490)	(0,00 %)
USD	689.741	GBP	(510.330)	BNP Paribas	03.01.2018	(608)	(0,00 %)
USD	122.411	EUR	(102.659)	BNP Paribas	03.01.2018	(862)	(0,00 %)
USD	102.465	GBP	(76.620)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(1.182)	(0,00 %)
USD	162.865	GBP	(121.673)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(1.728)	(0,00 %)
USD	229.821	GBP	(171.858)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(2.660)	(0,00 %)
GBP	2.111.980	USD	(2.861.500)	BNP Paribas	03.01.2018	(4.520)	(0,00 %)
GBP	4.869.050	USD	(6.599.944)	BNP Paribas	03.01.2018	(13.337)	(0,00 %)
USD	2.693.795	EUR	(2.271.756)	BNP Paribas	03.01.2018	(34.130)	(0,00 %)
USD	3.279.620	EUR	(2.778.844)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(57.217)	(0,00 %)
USD	16.024.036	EUR	(13.560.925)	BNP Paribas	03.01.2018	(259.925)	(0,01 %)
GBP	356.117.013	USD	(482.684.205)	BNP Paribas	03.01.2018	(946.987)	(0,05 %)
						(788.674)	(0,04 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente						(795.192)	(0,04 %)
						Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva						20.800.155	1,04 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)						1.994.473.555	100,00 %
REIT – Real Estate Investment Trust.							
Analyse des Gesamtvermögens						% des Gesamt- US-Dollar (\$)	nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind						1.306.111.450	65,49 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						663.617.745	33,27 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						4.739.397	0,24 %
(d) Derivative Finanzinstrumente						(795.192)	(0,04 %)
(e) Sonstige Aktiva und Passiva						20.800.155	1,04 %
Gesamtvermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)						1.994.473.555	100,00 %

[^] Zinsvariable Anleihe (FRN). Der Effektivzins zum 31. Dezember 2017.

¹ Bezeichnet Wertpapiere, die vollständig oder teilweise als Sicherheiten für offene Derivate verpfändet wurden.

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Kapital US-Dollar (\$)	Kosten US-Dollar (\$)		Kapital US-Dollar (\$)	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
US Treasury Note 1,63 % 15.3.2020	48.690.000	48.829.751	US Treasury Note 1,63 % 15.3.2020	48.690.000	48.883.841
US Treasury Note 2,38 % 15.5.2027	44.737.000	45.178.679	US Treasury Note 2,38 % 15.5.2027	44.737.000	45.155.680
US Treasury Note 2,25 % 15.2.2027	44.936.000	44.360.926	US Treasury Note 2,25 % 15.2.2027	44.936.000	44.425.258
US Treasury Note 2,25 % 15.8.2027	40.366.300	40.209.021	US Treasury Note 2,25 % 15.8.2027	40.366.300	40.208.527
US Treasury Note 1,50 % 15.5.2020	39.447.000	39.488.947	US Treasury Note 1,50 % 15.5.2020	39.447.000	39.495.584
US Treasury Note 1,63 % 15.10.2020	37.474.300	37.371.800	US Treasury Note 1,63 % 15.10.2020	37.474.300	37.367.623
US Treasury Note 1,50 % 15.6.2020	29.340.000	29.288.199	US Treasury Note 2,00 % 31.12.2021	30.011.000	30.182.275
US Treasury Note 2,00 % 15.11.2026	29.703.000	28.690.491	US Treasury Note 1,50 % 15.6.2020	29.340.000	29.319.251
US Treasury Note 1,50 % 15.4.2020	28.245.000	28.267.823	US Treasury Note 2,00 % 15.11.2026	29.753.000	28.700.042
US Treasury Note 1,50 % 15.7.2020	28.245.000	28.233.563	US Treasury Note 1,50 % 15.4.2020	28.245.000	28.265.098
US Treasury Note 2,00 % 31.12.2021	28.011.000	28.181.156	US Treasury Note 1,50 % 15.7.2020	28.245.000	28.246.667
US Treasury Bond 3,00 % 15.2.2047	26.966.000	27.522.385	US Treasury Bond 3,00 % 15.2.2047	26.966.000	27.590.296
US Treasury Note 1,50 % 15.8.2020	25.300.000	25.300.016	US Treasury Note 1,50 % 15.8.2020	25.300.000	25.312.430
US Treasury Bond 3,00 % 15.5.2047	23.232.000	24.011.398	US Treasury Bond 3,00 % 15.5.2047	23.232.000	24.003.253
US Treasury Note 1,75 % 15.11.2020	22.980.000	22.913.748	US Treasury Note 1,75 % 15.11.2020	22.980.000	22.892.588
US Treasury Note 2,00 % 30.4.2024	22.825.000	22.694.987	US Treasury Note 2,00 % 30.4.2024	22.825.000	22.721.982
US Treasury Bond 2,88 % 15.11.2046	22.770.000	22.078.828	US Treasury Bond 2,88 % 15.11.2046	22.770.000	22.177.514
US Treasury Note 1,38 % 15.9.2020	20.447.000	20.314.268	US Treasury Note 1,38 % 15.9.2020	20.447.000	20.287.687
US Treasury Note 1,88 % 30.4.2022	18.621.000	18.664.515	US Treasury Note 1,88 % 30.4.2022	18.621.000	18.657.838
US Treasury Note 1,88 % 30.9.2022	18.110.000	18.041.484	US Treasury Note 1,88 % 30.9.2022	18.110.000	18.035.027
			US Treasury Bond 2,25 % 15.8.2046	21.241.000	18.017.156
			US Treasury Note 1,75 % 30.6.2022	16.815.000	16.725.084
			US Treasury Note 1,25 % 30.6.2019	16.430.000	16.394.120
			US Treasury Note 2,13 % 29.2.2024	15.305.000	15.229.720

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1.974.468.592	1.574.075.488
Derivative Finanzinstrumente	563.307	74.865
Barmittel und liquide Vermögenswerte	48.784	2.849.284
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	18.219.240	15.278.619
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	1.154.588	757.427
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	7.159.658	5.166.986
Bareinschüsse für Futures	—	7.932
Sonstige Forderungen	10	15.248
Summe Umlaufvermögen	2.001.614.179	1.605.045.849
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	1.358.499	4.349.830
Überziehungskredit	1.034.348	—
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	8.792	40.982
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbene Kapitalanlagen	3.060.751	10.775.090
Zahlbare Dividenden	959.245	970.185
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	335.276	388.339
An Broker zu zahlende Bareinschüsse	35.963	—
Zahlbare Verwaltungsgebühren	347.750	327.133
Summe kurzfristige Passiva	7.140.624	16.851.559
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	1.994.473.555	1.588.194.290

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Euro-Anteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	5.040	276.130	4.529
Nettovermögen	4.197	261.797	4.169
Anzahl der umlaufenden Anteile	43	2.485	43
Nettoinventarwert je Anteil	97,60	105,35	97,30
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	740.542.701	1.008.102.760	1.145.130.431
Anzahl der umlaufenden Anteile	3.997.738	5.759.763	6.878.196
Nettoinventarwert je Anteil	185,24	175,03	166,49
EUR-Anlegeranteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	7.909.658	12.615.921	13.815.929
Nettovermögen	6.586.990	11.961.054	12.718.337
Anzahl der umlaufenden Anteile	31.004	52.312	60.196
Nettoinventarwert je Anteil	212,46	228,65	211,28
USD-Anlegeranteile (\$)			
Nettovermögen	28.219.186	16.650.829	8.008.502
Anzahl der umlaufenden Anteile	257.298	160.600	81.166
Nettoinventarwert je Anteil	109,68	103,68	98,67
Institutionelle Plus EUR-Anteile (€)			
Gegenwert in US (\$)	13.139.749	10.638.528	12.099.292
Nettovermögen	10.942.496	10.086.303	11.138.076
Anzahl der umlaufenden Anteile	80.812	69.352	83.006
Nettoinventarwert je Anteil	135,41	145,44	134,18

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Nettoinventarwert je Anteil (Fortsetzung)

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle Plus USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	585.271.596	147.842.006	21.630.811
Anzahl der umlaufenden Anteile	4.910.076	1.314.666	202.424
Nettoinventarwert je Anteil	119,20	112,46	106,86
Institutionelle Plus USD-Ertragsanteile (\$)			
Nettovermögen	58.496.769	52.073.421	87.607.385
Anzahl der umlaufenden Anteile	565.982	517.514	888.164
Nettoinventarwert je Anteil	103,35	100,62	98,64
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in US (\$)	434.296.624	252.519.702	144.131.929
Nettovermögen	321.047.229	204.361.844	97.789.491
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.778.070	1.851.531	927.786
Nettoinventarwert je Anteil	115,56	110,37	105,40
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in CHF (CHF)			
Gegenwert in US (\$)	5.415	5.015	4.947
Nettovermögen	5.277	5.097	4.952
Anzahl der umlaufenden Anteile	50	50	50
Nettoinventarwert je Anteil	105,54	101,94	99,03
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in EUR (€)			
Gegenwert in US (\$)	56.703.763	18.525.009	14.579.885
Nettovermögen	47.221.655	17.563.413	13.421.601
Anzahl der umlaufenden Anteile	440.942	170.645	135.160
Nettoinventarwert je Anteil	107,09	102,92	99,30
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in US (\$)	7.984.323	6.590	—
Nettovermögen	5.902.290	5.333	—
Anzahl der umlaufenden Anteile	58.130	55	—
Nettoinventarwert je Anteil	101,54	96,96	—
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)			
Gegenwert in US (\$)	61.898.731	68.938.379	—
Nettovermögen	45.757.703	55.791.188	—
Anzahl der umlaufenden Anteile	468.947	581.593	—
Nettoinventarwert je Anteil	97,58	95,93	—

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	63.501.667	55.144.806
Verschiedene Erträge	502.799	216.120
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	84.123.011	(28.284.503)
Summe Anlageerträge/(-verluste)	148.127.477	27.076.423
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	4.281.116	4.100.550
Transaktionsgebühren und Provisionen	14.052	10.408
Sonstige Aufwendungen	—	4.360
Summe Aufwendungen	4.295.168	4.115.318
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	8.113	6.971
Ausgezahlte Ausschüttungen	3.821.999	2.298.704
Ertragsausgleich	32.646	213.213
Summe Finanzierungskosten	3.862.758	2.518.888
Nettoanlageerträge/(-verluste)	139.969.551	20.442.217
Ausländische Quellensteuer	(21.466)	—
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	139.948.085	20.442.217

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	139.948.085	20.442.217
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	1.217.163.991	816.983.671
Rücknahmen	(950.833.196)	(696.245.328)
Reinvestitionen	385	90
Summe Kapitalgeschäfte ¹	266.331.180	120.738.433
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	406.279.265	141.180.650
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	1.588.194.290	1.447.013.640
Zum Jahresende	1.994.473.555	1.588.194.290

¹ Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund

Verwaltet durch The Vanguard Group, Inc.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds strebt eine Rendite an, die der Wertentwicklung des Bloomberg Barclays U.S. Government Inflation-Linked Bond 1–10 Year Index entspricht, eines marktgewichteten Index, der die Wertentwicklung von US Treasury Inflation-Protected Securities („TIPS“) mit Laufzeiten zwischen 1 und 10 Jahren messen soll.

Finanzielle Merkmale

	Fonds	Bloomberg Barclays ²
Anzahl der Emissionen	25	25
Rendite auf Endfälligkeit	0,3 % ³	0,3 %
Durchschnittlicher Kupon	0,6 %	0,6 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	5,3 Jahre	5,3 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	Aaa	Aaa
Durchschnittliche Duration	5,1 Jahre	5,1 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten		—
Thesaurierende Anteile	0,09 %	
Ausschüttende Anteile	0,09 %	
Kurzfristige Reserven	2,2 %	—

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

Treasury-Titel	100 %
----------------	-------

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	97,5 %
nicht eingestuft	2,5

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität und die Aufteilung nach Kreditqualität sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

² Bloomberg Barclays U.S. Government Inflation-Linked 1–10 Year Index.

³ Vor Aufwendungen.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

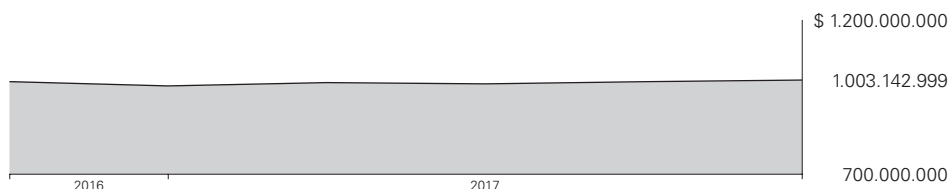
Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen.

U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays U.S. Government Inflation-Linked 1–10 Year Index

In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 24. Oktober 2016–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. \$ 1.000.000.000

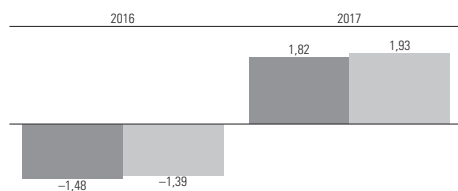


	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von \$ 1.000.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
— Select-Thesaurierungsanteile	1,82 %	0,26 %	\$ 1.003.142.999
— Benchmark	1,93	0,43	1.005.109.933

	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von \$ 1.000.000.000
Select-Ertragsanteile	1,82 %	0,26 %	\$ 1.003.142.999
Benchmark	1,93	0,43	1.005.109.933

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,11 Prozentpunkte für Select-Thesaurierungsanteile und Select-Ertragsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 24. Oktober 2016 – 31. Dezember 2017



■ Select-Thesaurierungsanteile
■ Benchmark

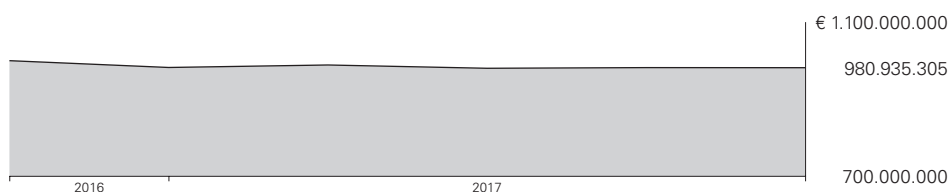
¹ 24. Oktober 2016.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays U.S. Government Inflation-Linked 1–10Year Index Euro-Hedged

Abgesichert in Euro

Kumulative Wertentwicklung: 24. Oktober 2016–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. € 1.000.000.000

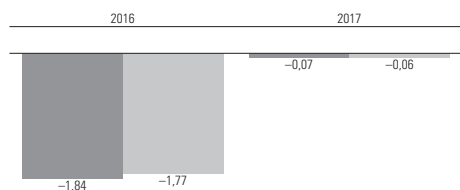


	Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 1.000.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in Euro	-0,07 %	-1,61 %	€ 980.935.305
Benchmark	-0,06	-1,54	981.778.889

	Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von € 1.000.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Select-Ertragsanteile, abgesichert in Euro	-0,07 %	-1,61 %	€ 980.935.305
Benchmark	-0,06	-1,54	981.778.889

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,01 Prozentpunkte für in Euro abgesicherte Select-Thesaurierungsanteile und in Euro abgesicherte Select-Ertragsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 24. Oktober 2016 – 31. Dezember 2017



■ Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in Euro
 ■ Benchmark

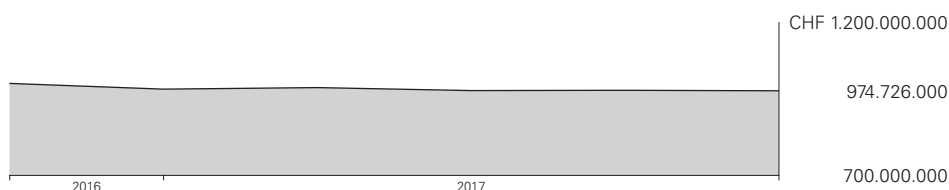
¹ 24. Oktober 2016.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsergebnisse und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund
Benchmark: Bloomberg Barclays U.S. Government Inflation-Linked 1–10Year Index CHF-Hedged

Abgesichert in Schweizer Franken

Kumulative Wertentwicklung: 24. Oktober 2016–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. CHF 1.000.000.000

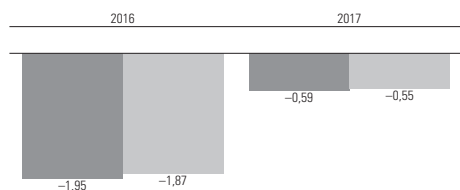


	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von CHF 1.000.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
— Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in CHF	-0,59 %	-2,17 %	CHF 974.726.000
— Benchmark	-0,55	-2,03	975.934.950

	Durchschnittliche jährliche Gesamtrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von CHF 1.000.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
Select-Ertragsanteile, abgesichert in CHF	-0,59 %	-2,14 %	CHF 974.726.000
Benchmark	-0,55	-2,03	975.934.950

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,04 Prozentpunkte für in CHF abgesicherte Select-Thesaurierungsanteile und in CHF abgesicherte Select-Ertragsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 24. Oktober 2016 – 31. Dezember 2017



■	Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in CHF
■	Benchmark

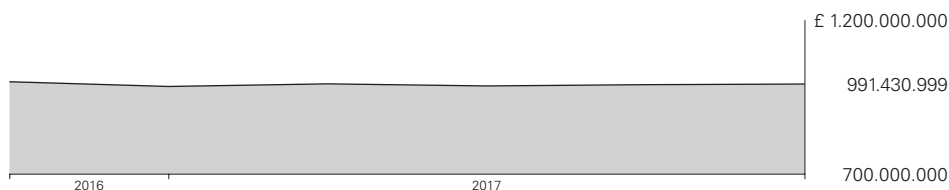
¹ Für in CHF abgesicherte Thesaurierungsanteile, 24. Oktober 2016; für in CHF abgesicherte Ertragsanteile, 25. Oktober 2016.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays U.S. Government Inflation-Linked 1–10Year Index GBP-Hedged

Abgesichert in GBP

Kumulative Wertentwicklung: 24. Oktober 2016–31. Dezember 2017
 Initial Investment of £ 1.000.000.000

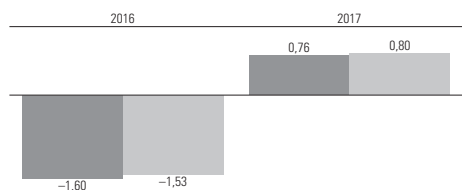


	Durchschnittliche jährliche Gesamterrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von £ 1.000.000.000
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
— Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	0,76 %	-0,78 %	£ 991.430.999
— Benchmark	0,80	-0,63	992.561.743

	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	Endwert einer Anlage von £ 1.000.000.000
Select-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	0,76 %	-0,72 %	£ 991.430.999
Benchmark	0,80	-0,63	992.561.743

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,04 Prozentpunkte für in GBP abgesicherte Select-Thesaurierungsanteile und in GBP abgesicherte Select-Ertragsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 24. Oktober 2016 – 31. Dezember 2017



■ Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP
■ Benchmark

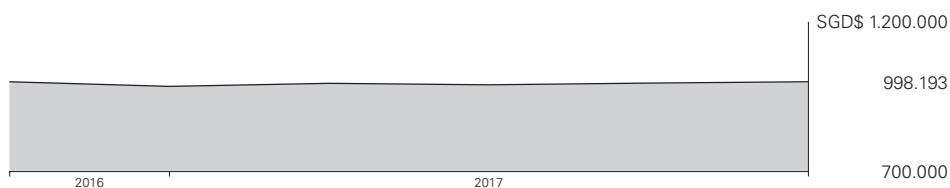
1 Für in GBP abgesicherte Thesaurierungsanteile, 24. Oktober 2016; für in GBP abgesicherte Ertragsanteile, 25. Oktober 2016.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund
 Benchmark: Bloomberg Barclays U.S. Government Inflation-Linked 1–10Year Index SGD-Hedged

Abgesichert in Singapur-Dollar

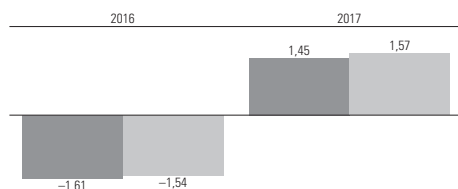
Kumulative Wertentwicklung: 24. Oktober 2016–31. Dezember 2017
 Erstanlage i.H.v. SGD\$ 1.000.000.000



	Durchschnittliche jährliche Gesamtergebnisse Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017		Endwert einer Anlage von SGD\$ 1.000.000.00
	Ein Jahr	Seit Auflegung ¹	
█ Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in SGD	1,45 %	-0,15 %	S\$ 998.193
— Benchmark	1,57	0,01	1.000.061

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,12 Prozentpunkte für in SGD abgesicherte Select-Thesaurierungsanteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 25. Oktober 2016 – 31. Dezember 2017



█	Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in SGD
—	Benchmark

¹ 25. Oktober 2016.

² Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondserrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Anleihen 97,50 % (2016: 99,76 %)					
US-Schatzanweisungen TIPs 97,50 % (2016: 99,76 %)					
US Treasury Inflation Indexed Bonds	138.508.950	0,13 %	15.04.2020	138.224.903	5,95 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	131.965.832	0,13 %	15.04.2021	131.421.989	5,66 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	120.302.532	0,63 %	15.01.2024	122.408.948	5,27 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	115.091.451	0,13 %	15.01.2023	114.197.622	4,92 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	111.075.630	0,63 %	15.01.2026	112.853.513	4,86 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	113.253.338	0,25 %	15.01.2025	112.250.833	4,83 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	110.478.507	0,13 %	15.07.2024	109.180.380	4,70 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	98.852.896	1,25 %	15.07.2020	102.071.777	4,40 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	99.646.398	0,13 %	15.07.2022	99.512.692	4,29 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	98.083.800	0,13 %	15.01.2022	97.688.700	4,21 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	94.492.042	1,13 %	15.01.2021	97.312.043	4,19 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	94.968.832	0,38 %	15.07.2023	95.682.485	4,12 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	82.047.966	2,38 %	15.01.2025	93.498.363	4,03 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	91.273.794	0,63 %	15.07.2021	93.029.486	4,01 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	91.898.964	0,13 %	15.04.2019	91.692.507	3,95 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	89.964.862	0,13 %	15.04.2022	89.331.322	3,85 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	89.348.875	0,38 %	15.01.2027	88.705.057	3,82 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	88.634.844	0,38 %	15.07.2027	88.162.922	3,80 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	84.689.992	0,13 %	15.07.2026	82.749.823	3,56 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	82.379.088	0,38 %	15.07.2025	82.504.983	3,55 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	59.444.604	2,38 %	15.01.2027	69.548.482	3,00 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	57.913.548	2,00 %	15.01.2026	65.141.959	2,81 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	40.493.430	1,38 %	15.01.2020	41.553.635	1,79 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	29.342.842	1,88 %	15.07.2019	30.253.820	1,30 %
US Treasury Inflation Indexed Bonds	14.360.875	2,13 %	15.01.2019	14.656.507	0,63 %
Summe Anleihen				2.263.634.751	97,50 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				2.263.634.751	97,50 %

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf- betrag)	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Derivative Finanzinstrumente							
Offene Devisenterminkontrakte zu Absicherungszwecken auf Ebene der Anteilsklasse 0,26 % (2016: 0,35 %)							
EUR	561.993.162	USD	(671.564.969)	BNP Paribas	03.01.2018	3.276.539	0,14 %
CHF	489.543.250	USD	(500.000.000)	UBS	04.01.2018	2.388.313	0,10 %
CHF	131.949.064	USD	(134.761.537)	BNP Paribas	04.01.2018	649.722	0,03 %
EUR	552.864.787	USD	(664.974.708)	JP Morgan Chase Bank	02.02.2018	168.997	0,01 %
CHF	213.017.796	USD	(219.000.000)	BNP Paribas	02.02.2018	85.365	0,01 %
CHF	411.879.092	USD	(423.526.059)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	84.940	0,00 %
EUR	8.867.903	USD	(10.596.764)	BNP Paribas	03.01.2018	51.815	0,00 %
SGD	8.069.952	USD	(5.992.613)	BNP Paribas	03.01.2018	45.963	0,00 %
EUR	3.973.503	USD	(4.747.263)	BNP Paribas	03.01.2018	24.120	0,00 %
CHF	5.003.437	USD	(5.110.760)	BNP Paribas	04.01.2018	23.961	0,00 %
CHF	3.568.605	USD	(3.644.483)	BNP Paribas	04.01.2018	17.758	0,00 %
GBP	970.636	USD	(1.299.274)	BNP Paribas	03.01.2018	13.754	0,00 %
CHF	732.244	USD	(741.490)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	9.967	0,00 %
EUR	487.261	USD	(575.962)	BNP Paribas	03.01.2018	9.141	0,00 %
CHF	496.259	USD	(502.005)	BNP Paribas	04.01.2018	7.276	0,00 %
EUR	722.882	USD	(860.860)	BNP Paribas	03.01.2018	7.177	0,00 %
GBP	114.967.665	USD	(155.680.359)	JP Morgan Chase Bank	02.02.2018	7.031	0,00 %
EUR	327.386	USD	(386.850)	BNP Paribas	03.01.2018	6.275	0,00 %
EUR	776.980	USD	(927.582)	BNP Paribas	03.01.2018	5.416	0,00 %
CHF	372.739	USD	(377.274)	BNP Paribas	04.01.2018	5.245	0,00 %
EUR	293.448	USD	(347.614)	BNP Paribas	03.01.2018	4.758	0,00 %
EUR	264.388	USD	(313.505)	BNP Paribas	03.01.2018	3.972	0,00 %
GBP	405.299	USD	(544.564)	BNP Paribas	03.01.2018	3.704	0,00 %

Wahrung	Kauf- betrag	Wahrung	(Verkauf- betrag)	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermogens
CHF	611.140	USD	(623.850)	BNP Paribas	04.01.2018	3.325	0,00 %
EUR	211.046	USD	(250.775)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	2.649	0,00 %
CHF	246.787	USD	(250.644)	BNP Paribas	04.01.2018	2.618	0,00 %
EUR	127.025	USD	(149.916)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	2.616	0,00 %
CHF	182.769	USD	(185.182)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	2.383	0,00 %
GBP	202.455	USD	(271.656)	BNP Paribas	03.01.2018	2.214	0,00 %
CHF	3.808.685	USD	(3.915.258)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	1.913	0,00 %
EUR	187.823	USD	(223.738)	BNP Paribas	03.01.2018	1.799	0,00 %
GBP	107.554	USD	(143.835)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	1.659	0,00 %
SGD	239.952	USD	(178.055)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	1.496	0,00 %
GBP	74.941	USD	(99.984)	BNP Paribas	03.01.2018	1.393	0,00 %
GBP	97.825	USD	(131.036)	BNP Paribas	03.01.2018	1.297	0,00 %
EUR	108.549	USD	(129.110)	BNP Paribas	03.01.2018	1.235	0,00 %
GBP	64.030	USD	(85.708)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	909	0,00 %
GBP	105.219	USD	(141.498)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	837	0,00 %
EUR	141.531	USD	(169.124)	BNP Paribas	03.01.2018	827	0,00 %
GBP	38.655	USD	(51.598)	BNP Paribas	03.01.2018	693	0,00 %
GBP	65.770	USD	(88.331)	BNP Paribas	03.01.2018	639	0,00 %
GBP	55.585	USD	(74.614)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	579	0,00 %
EUR	3.102.551	USD	(3.732.058)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	576	0,00 %
SGD	78.819	USD	(58.524)	BNP Paribas	03.01.2018	455	0,00 %
EUR	538.373	USD	(647.321)	BNP Paribas	02.02.2018	388	0,00 %
CHF	22.689	USD	(22.910)	BNP Paribas	04.01.2018	374	0,00 %
CHF	18.288	USD	(18.552)	BNP Paribas	04.01.2018	216	0,00 %
GBP	7.902	USD	(10.591)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	99	0,00 %
SGD	16.463	USD	(12.225)	BNP Paribas	03.01.2018	94	0,00 %
SGD	10.752	USD	(7.980)	BNP Paribas	03.01.2018	66	0,00 %
USD	68.654	GBP	(50.709)	BNP Paribas	03.01.2018	57	0,00 %
GBP	55.938	USD	(75.614)	BNP Paribas	03.01.2018	56	0,00 %
GBP	9.656	USD	(13.032)	BNP Paribas	03.01.2018	31	0,00 %
GBP	130.508	USD	(176.703)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	29	0,00 %
USD	155.680.359	GBP	(115.084.353)	JP Morgan Chase Bank	03.01.2018	23	0,00 %
CHF	1.654	USD	(1.684)	BNP Paribas	04.01.2018	13	0,00 %
USD	18.173	CHF	(17.670)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	—	0,00 %
GBP	205.404	USD	(277.861)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	—	0,00 %
USD	47.474	SGD	(63.444)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	—	0,00 %
USD	6.193.947	SGD	(8.277.591)	UBS	03.01.2018	—	0,00 %
USD	2.939.204	EUR	(2.447.705)	Brown Brothers Harriman & Co.	03.01.2018	(1)	(0,00 %)
USD	1.847	SGD	(2.469)	UBS	02.02.2018	(1)	(0,00 %)
GBP	1.857	USD	(2.517)	BNP Paribas	03.01.2018	(5)	(0,00 %)
USD	34.092	GBP	(25.179)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(6)	(0,00 %)
SGD	83.265	USD	(62.349)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(14)	(0,00 %)
USD	2.506	SGD	(3.381)	BNP Paribas	03.01.2018	(24)	(0,00 %)
USD	7.592	GBP	(5.634)	BNP Paribas	03.01.2018	(29)	(0,00 %)
USD	358.661	EUR	(298.164)	Barclays Bank Plc	02.02.2018	(55)	(0,00 %)
USD	7.219	SGD	(9.725)	BNP Paribas	03.01.2018	(58)	(0,00 %)
USD	7.644	CHF	(7.540)	BNP Paribas	04.01.2018	(94)	(0,00 %)
USD	664.974.708	EUR	(553.776.406)	JP Morgan Chase Bank	03.01.2018	(118)	(0,00 %)
CHF	466.183	USD	(479.587)	BNP Paribas	02.02.2018	(125)	(0,00 %)
USD	15.649	SGD	(21.110)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(147)	(0,00 %)
SGD	8.273.441	USD	(6.193.947)	UBS	02.02.2018	(162)	(0,00 %)
USD	207.763	GBP	(153.721)	BNP Paribas	03.01.2018	(183)	(0,00 %)
USD	3.032.460	CHF	(2.955.132)	Brown Brothers Harriman & Co.	04.01.2018	(212)	(0,00 %)
USD	33.955	CHF	(33.363)	BNP Paribas	04.01.2018	(284)	(0,00 %)
USD	30.076	SGD	(40.689)	BNP Paribas	03.01.2018	(371)	(0,00 %)
USD	49.717	GBP	(37.178)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(575)	(0,00 %)
USD	61.865	EUR	(52.093)	BNP Paribas	03.01.2018	(689)	(0,00 %)
USD	117.988	CHF	(115.658)	BNP Paribas	04.01.2018	(704)	(0,00 %)
USD	56.052	CHF	(55.367)	BNP Paribas	04.01.2018	(767)	(0,00 %)
USD	130.838	GBP	(97.359)	BNP Paribas	03.01.2018	(865)	(0,00 %)
USD	190.004	CHF	(186.008)	BNP Paribas	04.01.2018	(885)	(0,00 %)

Währung	Kauf- betrag	Währung	(Verkauf- betrag)	Kontrahent	Abrechnungs- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
USD	76.091	CHF	(75.135)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	(1.016)	(0,00 %)
USD	68.951	CHF	(68.378)	BNP Paribas	04.01.2018	(1.222)	(0,00 %)
USD	68.055	EUR	(57.786)	BNP Paribas	03.01.2018	(1.335)	(0,00 %)
GBP	656.833	USD	(889.936)	BNP Paribas	03.01.2018	(1.406)	(0,00 %)
USD	114.536	CHF	(113.048)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	(1.478)	(0,00 %)
USD	775.339	GBP	(573.647)	BNP Paribas	02.02.2018	(1.485)	(0,00 %)
USD	206.407	CHF	(202.809)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	(1.724)	(0,00 %)
USD	342.318	EUR	(286.783)	BNP Paribas	03.01.2018	(2.051)	(0,00 %)
USD	495.646	CHF	(485.238)	BNP Paribas	04.01.2018	(2.324)	(0,00 %)
USD	204.472	EUR	(172.448)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(2.604)	(0,00 %)
USD	299.439	GBP	(223.860)	BNP Paribas	03.01.2018	(3.387)	(0,00 %)
GBP	1.514.741	USD	(2.053.215)	BNP Paribas	03.01.2018	(4.149)	(0,00 %)
USD	267.631	EUR	(226.829)	BNP Paribas	03.01.2018	(4.745)	(0,00 %)
USD	1.011.649	CHF	(991.309)	BNP Paribas	04.01.2018	(5.671)	(0,00 %)
USD	394.628	EUR	(333.985)	BNP Paribas	03.01.2018	(6.421)	(0,00 %)
USD	1.056.145	EUR	(885.730)	BNP Paribas	03.01.2018	(7.440)	(0,00 %)
USD	383.326	EUR	(326.091)	BNP Paribas	03.01.2018	(8.244)	(0,00 %)
USD	765.989	CHF	(754.537)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	(8.347)	(0,00 %)
USD	569.400	CHF	(563.755)	BNP Paribas	04.01.2018	(9.148)	(0,00 %)
USD	838.754	EUR	(708.886)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(12.477)	(0,00 %)
USD	1.584.117	EUR	(1.330.799)	Barclays Bank Plc	03.01.2018	(13.907)	(0,00 %)
USD	219.000.000	CHF	(213.415.500)	BNP Paribas	04.01.2018	(15.283)	(0,00 %)
USD	423.526.059	CHF	(412.726.145)	Barclays Bank Plc	04.01.2018	(29.555)	(0,00 %)
GBP	111.012.513	USD	(150.467.359)	BNP Paribas	03.01.2018	(295.204)	(0,01 %)
USD	21.068.013	EUR	(17.877.343)	BNP Paribas	03.01.2018	(399.104)	(0,02 %)
Summe Derivative Finanzinstrumente						6.088.666	0,26 %
						Marktwert	% des
						US-Dollar (\$)	Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva						52.025.013	2,24 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)						2.321.748.430	100,00 %
Analyse des Gesamtvermögens						US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind						1.518.798.316	65,42 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere						744.836.435	32,08 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						—	0,00 %
(d) Derivative Finanzinstrumente						6.088.666	0,26 %
(e) Sonstige Aktiva und Passiva						52.025.013	2,24 %
Gesamtnettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)						2.321.748.430	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Kapital US-Dollar (\$)	Kosten US-Dollar (\$)		Kapital US-Dollar (\$)	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,38 % 15.1.2027	133.013.845	132.682.572	US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.4.2018	118.483.400	118.944.845
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,38 % 15.7.2027	94.687.411	93.597.466	US Treasury Inflation Indexed Bonds 1,38 % 15.7.2018	47.098.237	47.851.076
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.4.2022	89.178.213	89.431.347	US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.4.2019	46.968.750	47.125.678
US Treasury Inflation Indexed Bonds 2,38 % 15.1.2027	69.375.020	82.168.065	US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,38 % 15.1.2027	45.187.800	45.055.764
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.4.2021	68.865.655	69.528.789	US Treasury Inflation Indexed Bonds 1,63 % 15.1.2018	35.717.660	36.718.749
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.4.2020	63.698.760	64.603.230	US Treasury Inflation Indexed Bonds 2,13 % 15.1.2019	30.705.420	31.833.695
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,63 % 15.1.2024	60.557.764	62.089.559	US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,38 % 15.7.2023	29.746.975	30.307.719
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.7.2024	53.573.846	53.067.593	US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.7.2024	25.979.670	25.791.079
US Treasury Inflation Indexed Bonds 1,25 % 15.7.2020	47.438.165	49.750.343	US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,63 % 15.7.2021	21.544.000	22.387.989
US Treasury Inflation Indexed Bonds 2,38 % 15.1.2025	42.312.618	48.584.643	US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.4.2020	21.342.955	21.560.014
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,63 % 15.7.2021	44.608.410	46.233.116	US Treasury Inflation Indexed Bonds 1,38 % 15.1.2020	20.285.100	21.200.807
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,25 % 15.1.2025	45.694.764	45.255.932	US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.4.2021	18.965.520	19.192.367
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.1.2023	43.259.673	43.242.461	US Treasury Inflation Indexed Bonds 2,38 % 15.1.2027	11.099.208	13.155.693
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,38 % 15.7.2023	40.806.493	41.418.069	US Treasury Inflation Indexed Bonds 1,88 % 15.7.2019	12.674.330	13.130.364
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.4.2019	39.660.020	40.202.829	US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,63 % 15.1.2024	12.427.422	12.729.762
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.7.2022	38.037.404	38.352.146	US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,38 % 15.7.2025	10.251.650	10.280.581
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,63 % 15.1.2026	31.693.119	32.231.925	US Treasury Inflation Indexed Bonds 2,38 % 15.1.2025	7.771.480	8.905.513
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.4.2018	29.865.850	30.133.653	US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,63 % 15.1.2026	8.260.600	8.403.444
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.7.2026	24.889.821	24.401.640	US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.1.2023	7.483.140	7.425.555
US Treasury Inflation Indexed Bonds 2,00 % 15.1.2026	20.656.934	23.409.477	US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,38 % 15.7.2027	6.518.170	6.480.261
US Treasury Inflation Indexed Bonds 1,38 % 15.1.2020	21.951.100	22.970.366			
US Treasury Inflation Indexed Bonds 2,13 % 15.1.2019	21.549.920	22.469.941			
US Treasury Inflation Indexed Bonds 1,13 % 15.1.2021	21.305.105	22.116.055			
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,13 % 15.1.2022	19.889.745	20.011.078			
US Treasury Inflation Indexed Bonds 0,38 % 15.7.2025	19.227.100	19.221.975			
US Treasury Inflation Indexed Bonds 1,38 % 15.7.2018	18.026.960	18.614.242			
US Treasury Inflation Indexed Bonds 1,88 % 15.7.2019	14.890.980	15.588.368			

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.263.634.751	1.555.505.820
Derivative Finanzinstrumente	6.934.767	268.261
Barmittel und liquide Vermögenswerte	52.479.460	757.632
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	5.894.047	3.960.811
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	3.784.515	3.784.540
Verkaufte oder fällig gewordene Kapitalanlagen	6.349.607	17.697.831
Bareinschüsse für Futures	578	—
Summe Umlaufvermögen	2.339.077.725	1.581.974.895
Kurzfristige Passiva		
Derivative Finanzinstrumente	846.101	5.699.712
Überziehungskredit	1.659	17.824
Nicht realisierte Wertminderungen aus Devisenkassageschäften	4.951	20.847
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Erworbenene Kapitalanlagen	12.091.696	12.320.078
Zahlbare Dividenden	1.384.205	602.752
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	2.824.474	3.934.829
Zahlbare Verwaltungsgebühren	176.209	117.897
Summe kurzfristige Passiva	17.329.295	22.713.939
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	2.321.748.430	1.559.260.956

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016
Thesaurierende Select USD-Anteile (\$)		
Nettovermögen	819.053.627	450.835.652
Anzahl der umlaufenden Anteile	8.166.099	4.575.722
Nettoinventarwert je Anteil	100,30	98,53
Select USD-Ertragsanteile (\$)		
Nettovermögen	22.416.023	22.786.050
Anzahl der umlaufenden Anteile	228.636	232.080
Nettoinventarwert je Anteil	98,04	98,18
Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in CHF (CHF)		
Gegenwert in US (\$)	631.065.854	438.058.679
Nettovermögen	614.973.675	445.220.938
Anzahl der umlaufenden Anteile	6.310.138	4.540.223
Nettoinventarwert je Anteil	97,46	98,06
Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in EUR (€)		
Gegenwert in US (\$)	659.864.897	470.563.038
Nettovermögen	549.521.071	446.137.044
Anzahl der umlaufenden Anteile	5.602.821	4.544.523
Nettoinventarwert je Anteil	98,08	98,17
Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP (£)		
Gegenwert in US (\$)	45.263.424	27.305.418
Nettovermögen	33.460.303	22.098.021
Anzahl der umlaufenden Anteile	337.546	224.561
Nettoinventarwert je Anteil	99,13	98,41
Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in SGD (S\$)		
Gegenwert in US (\$)	6.267.871	3.362.017
Nettovermögen	8.376.383	4.857.106
Anzahl der umlaufenden Anteile	83.928	49.359
Nettoinventarwert je Anteil	99,80	98,40
Select-Ertragsanteile, abgesichert in CHF (CHF)		
Gegenwert in US (\$)	17.173.027	10.247.458
Nettovermögen	16.735.115	10.415.004
Anzahl der umlaufenden Anteile	176.416	106.630
Nettoinventarwert je Anteil	94,86	97,67
Select-Ertragsanteile, abgesichert in EUR (€)		
Gegenwert in US (\$)	10.539.326	7.730.651
Nettovermögen	8.776.920	7.329.368
Anzahl der umlaufenden Anteile	91.489	74.927
Nettoinventarwert je Anteil	95,93	97,82
Select-Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)		
Gegenwert in US (\$)	110.104.381	128.371.993
Nettovermögen	81.393.003	103.890.259
Anzahl der umlaufenden Anteile	840.007	1.060.200
Nettoinventarwert je Anteil	96,90	97,99

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Berichtszeitraum bis zum 31. Dezember 2016 ¹
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	39.383.538	4.789.276
Verschiedene Erträge	—	8
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	83.791.870	(55.123.194)
Summe Anlageerträge/(-verluste)	123.175.408	(50.333.910)
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	1.866.883	249.458
Transaktionsgebühren und Provisionen	—	27.137
Summe Aufwendungen	1.866.883	276.595
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	209	18
Ausgezahlte Ausschüttungen	3.074.450	602.752
Ertragsausgleich	44.303	(95.541)
Summe Finanzierungskosten	3.118.962	507.229
Nettoanlageerträge/(-verluste)	118.189.563	(51.117.734)
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	118.189.563	(51.117.734)

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Berichtszeitraum bis zum 31. Dezember 2016 ¹
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	118.189.563	(51.117.734)
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	1.298.002.590	1.679.685.244
Rücknahmen	(654.599.649)	(69.306.554)
Reinvestitionen	894.970	—
Summe Kapitalgeschäfte ²	644.297.911	1.610.378.690
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	762.487.474	1.559.260.956
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn	1.559.260.956	—
Zum Jahresende	2.321.748.430	1.559.260.956

1 Der Fonds wurde am 24. Oktober 2016 aufgelegt.

2 Kapitalgeschäfte umfassen Ertragsausgleichsanpassungen wie in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund

Verwaltet durch The Vanguard Group, Inc.

Fondsprofil (ungeprüft)

Zum 31. Dezember 2017

Das Fondsprofil stellt keinen Teil des Abschlusses dar, sofern nicht anders angegeben.¹

Anlageziel

Der Fonds hat sich zum Ziel gesetzt, laufende Renditen bei begrenzter Preisvolatilität zu liefern.

Finanzielle Merkmale

	Fonds
Rendite	
Institutionelle Anteile	0,8 %
Anlegeranteile	0,8 %
Durchschnittliche effektive Fälligkeit ¹	0,4 Jahre
Durchschnittliche Qualität ¹	Aa1
Durchschnittliche Duration	0,4 Jahre
Ausgewiesene laufende Kosten	
Institutionelle Anteile	0,25 %
Anlegeranteile	0,30 %

Aufteilung nach Kreditqualität¹ (% des Portfolios)

Aaa	58,0 %
Aa	28,3
A	13,7

Diversifizierung nach Sektor (% des Portfolios)

Geldmärkte	75,7 %
Treasury/Federal	12,1
Sonstige	10,2
Finanzinstitute	2,0

¹ Die durchschnittliche effektive Fälligkeit, die durchschnittliche Qualität und die Aufteilung nach Kreditqualität sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss angegeben. Weitere Informationen zu diesen Ratings finden Sie im Glossar.

Überblick über die Wertentwicklung (ungeprüft)

Der Überblick über die Wertentwicklung ist nicht Teil des Jahresabschlusses.

Alle Renditen in diesem Bericht stellen die bisherige Wertentwicklung dar und sind keine Garantie für künftige Erträge, die der Fonds unter Umständen erzielen wird. (Für Informationen zur aktuellen Wertentwicklung bis zum letzten Monatsende, die unter Umständen höher oder niedriger ausfällt als die hier aufgeführten Zahlen, besuchen Sie unsere Website unter <http://global.vanguard.com>.) Es wird zudem darauf hingewiesen, dass sowohl die Anlagerenditen als auch der Kapitalwert starken Schwankungen unterliegen können; der Wert der Anteile eines Anlegers kann daher bei ihrem Verkauf unter oder über dem ursprünglichen Anschaffungswert liegen. Der Fonds wird aktiv verwaltet und strebt eine Anlage gemäss der Beschreibung im Prospekt an. Die folgenden Performanceangaben zeigen den Vergleich der Rendite des Fonds mit der Rendite einer Benchmark, deren Anlagemerkmale mit denen des Fonds vergleichbar sind.

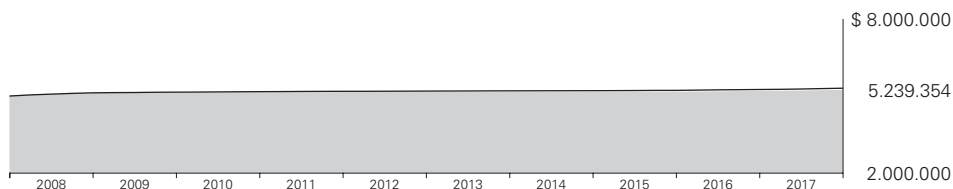
U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund

Benchmark: Bank of America Merrill Lynch 6-Month U.S. Treasury Bill Index

In US-Dollar

Kumulative Wertentwicklung: 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017

Erstanlage i.H.v. \$ 5.000.000

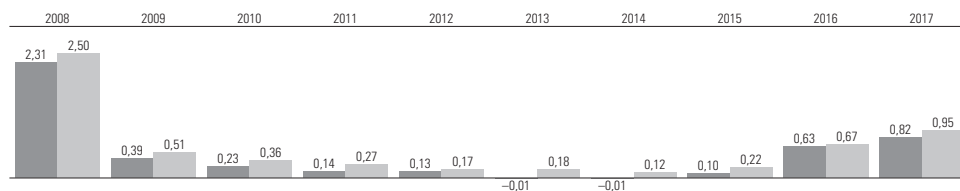


	Durchschnittliche jährliche Gesamrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 5.000.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Institutionelle Anteile	0,82 %	0,30 %	0,47 %	\$ 5.239.354
Benchmark ¹	0,95	0,43	0,59	5.304.576

	Durchschnittliche jährliche Gesamrenditen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017			Endwert einer Anlage von \$ 100.000
	Ein Jahr	Fünf Jahre	Zehn Jahre	
Anlegeranteile	0,76 %	0,27 %	0,42 %	\$ 104.228
Benchmark ¹	0,95	0,43	0,54	105.511

Der Tracking-Unterschied für den jüngsten Zeitraum betrug 0,13 Prozentpunkte für institutionelle Anteile und 0,19 Prozentpunkte für Anlegeranteile.²

Summe Anlagerenditen (%): 31. Dezember 2007–31. Dezember 2017



■ Institutionelle Anteile

■ Benchmark¹

1 Money Market Funds-Durchschnitt für Anlegeranteile und Institutional Money Market Funds-Durchschnitt für institutionelle Anteile bis zum 30. Juni 2009; danach Bank of America Merrill Lynch 6-Month U.S. Treasury Bill Index. Die Wertentwicklung wird aus Daten abgeleitet, die von Lipper, einer Thomson Reuters-Gesellschaft, bereitgestellt wurden.

2 Der Tracking-Unterschied zwischen der Fondsrendite und der Indexrendite über einen festgelegten Zeitraum kann einer Reihe von Faktoren zugeschrieben werden, unter anderem geringen Unterschieden bei den Gewichtungen, der Handelsaktivität, den Transaktionskosten sowie bei der Bewertung und der Quellensteuerbehandlung zwischen dem Fonds und dem Indexanbieter.

Jahresabschluss

Aufstellung der Kapitalanlagen

31. Dezember 2017

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Banken 1,96 % (2016 %) 0,00 %)					
Wells Fargo Bank NA	2.000.000	1,65 %	22.01.2018	1.999.652	1,96 %
				1.999.652	1,96 %
Einlagezertifikate 10,13 % (2016: 13,99 %)					
Citibank NA	2.000.000	1,81 %	22.06.2018	1.999.625	1,95 %
DNB Bank A.S.A	2.000.000	1,68 %	19.10.2018	1.996.748	1,95 %
Royal Bank of Canada	2.000.000	1,70 %	05.10.2018	1.996.604	1,95 %
Toronto-Dominion Bank	1.500.000	1,60 %	24.08.2018	1.496.671	1,46 %
Bank of Montreal	1.000.000	1,57 %	16.08.2018	998.029	0,98 %
Svenska Handelsbanken AB	600.000	1,55 %	08.08.2018	599.186	0,59 %
Wells Fargo Bank NA	550.000	1,60 %	27.07.2018	549.230	0,54 %
Svenska Handelsbanken AB	477.000	1,72 %	26.01.2018	476.510	0,47 %
Westpac Banking Corp.	250.000	1,50 %	18.07.2018	249.510	0,24 %
				10.362.113	10,13 %
Commercial Paper 29,88 % (2016: 28,37 %)					
Toyota Motor Credit Corp.	2.700.000	0,00 %	01.03.2018	2.692.858	2,64 %
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	2.700.000	0,00 %	05.03.2018	2.692.773	2,64 %
GE Capital	2.500.000	0,00 %	11.04.2018	2.488.656	2,44 %
Nordea Bank AB	2.218.000	0,00 %	16.03.2018	2.210.599	2,16 %
National Australia Bank Ltd.	2.175.000	0,00 %	08.02.2018	2.171.096	2,12 %
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust	2.100.000	0,00 %	02.08.2018	2.077.648	2,03 %
Skandinaviska Enskilda Banken AB	2.000.000	0,00 %	08.02.2018	1.996.633	1,95 %
Bank of Nova Scotia	2.000.000	0,00 %	06.07.2018	1.980.407	1,94 %
ING US Funding LLC	1.800.000	0,00 %	17.04.2018	1.791.155	1,75 %
Credit Suisse AG	1.800.000	0,00 %	02.05.2018	1.789.169	1,75 %
Danske Corp.	1.200.000	0,00 %	16.02.2018	1.197.431	1,17 %
Toronto-Dominion Bank	1.200.000	0,00 %	14.03.2018	1.195.750	1,17 %
ABN AMARO Fund	1.060.000	0,00 %	08.03.2018	1.056.731	1,03 %
Swedbank AB	1.055.000	0,00 %	24.04.2018	1.049.870	1,03 %
Commonwealth Bank of Australia	850.000	0,00 %	20.09.2018	838.143	0,82 %
Swedbank AB	735.000	0,00 %	10.05.2018	730.839	0,72 %
ABN AMARO Fund	700.000	0,00 %	09.03.2018	697.808	0,68 %
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust	505.000	0,00 %	30.04.2018	502.207	0,49 %
Westpac Banking Corp.	500.000	0,00 %	10.08.2018	494.198	0,48 %
Westpac Banking Corp.	500.000	0,00 %	21.11.2018	491.048	0,48 %
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust	400.000	0,00 %	03.05.2018	397.729	0,39 %
				30.542.748	29,88 %
US Schatz- und Agency-Obligationen 2,62 % (2016: 1,74 %)					
Federal Home Loan Bank Discount Notes	1.100.000	0,00 %	24.08.2018	1.088.989	1,07 %
Federal Home Loan Bank Discount Notes	600.000	0,00 %	06.09.2018	593.413	0,58 %
Federal Home Loan Bank Discount Notes	400.000	0,00 %	28.06.2018	397.109	0,39 %
Freddie Mac Discount Notes	300.000	0,00 %	14.03.2018	299.201	0,29 %
Federal Home Loan Bank Discount Notes	300.000	0,00 %	27.04.2018	298.668	0,29 %
				2.677.380	2,62 %
US-Schatzanweisungen 55,10 % (2016: 53,08 %)					
US Treasury Bill	11.530.000	0,00 %	16.08.2018	11.415.635	11,17 %
US Treasury Note	5.238.000	0,75 %	15.04.2018	5.228.997	5,11 %
US Treasury Bill	4.830.000	0,00 %	03.05.2018	4.807.313	4,70 %
US Treasury Bill	4.799.000	0,00 %	24.05.2018	4.771.623	4,67 %
US Treasury Bill	4.569.000	0,00 %	19.07.2018	4.530.458	4,43 %
US Treasury Note	3.995.000	2,63 %	30.04.2018	4.009.981	3,92 %
US Treasury Bill	4.000.000	0,00 %	31.05.2018	3.975.953	3,89 %
US Treasury Bill	4.000.000	0,00 %	07.06.2018	3.974.563	3,89 %
US Treasury Bill	3.573.000	0,00 %	13.09.2018	3.531.656	3,45 %
US Treasury Bill	3.510.000	0,00 %	14.06.2018	3.486.797	3,41 %
US Treasury Bill	2.873.000	0,00 %	08.11.2018	2.831.314	2,77 %
US Treasury Note	2.080.000	0,63 %	30.04.2018	2.074.475	2,03 %
US Treasury Note	989.000	1,00 %	15.05.2018	987.610	0,97 %
US Treasury Bill	719.000	0,00 %	11.10.2018	709.623	0,69 %
				56.335.998	55,10 %
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte				101.917.891	99,69 %

	Kapital US-Dollar (\$)	Kupon	Fälligkeits- datum	Marktwert US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
Sonstige Aktiva und Passiva				320.409	0,31 %
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)				102.238.300	100,00 %
Analyse des Gesamtvermögens				US-Dollar (\$)	% des Gesamt- nettovermögens
(a) Übertragbare Wertschriften, die zur amtlichen Kotierung an einer Wertschriftenbörse zugelassen sind				38.040.552	37,21 %
(b) An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere				59.703.288	58,40 %
(c) Andere übertragbare Wertpapiere als jene, die zur amtlichen Notierung zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				4.174.051	4,08 %
(d) Derivative Finanzinstrumente				—	0,00 %
(e) Sonstige Aktiva und Passiva				320.409	0,31 %
Gesamtnettovermögen (zu Finanzberichterstattungs Zwecken)				102.238.300	100,00 %

Wesentliche Portfolioänderungen (ungeprüft)

für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr

	Kapital US-Dollar (\$)	Kosten US-Dollar (\$)		Kapital US-Dollar (\$)	Erlöse US-Dollar (\$)
Käufe			Verkäufe		
US Treasury Bill 0,00 % 16.8.2018	11.530.000	11.395.683	US Treasury Note 1,88 % 31.8.2017	10.868.000	10.900.487
US Treasury Note 0,75 % 28.2.2018	7.318.000	7.297.632	US Treasury Note 1,00 % 15.9.2017	10.479.000	10.478.915
US Treasury Note 2,25 % 30.11.2017	7.108.000	7.155.804	US Treasury Note 0,75 % 28.2.2018	7.318.000	7.308.443
US Treasury Note 0,88 % 15.1.2018	7.000.000	6.990.156	US Treasury Note 2,25 % 30.11.2017	7.108.000	7.126.660
US Treasury Note 1,00 % 15.12.2017	6.731.000	6.728.526	US Treasury Note 0,88 % 15.1.2018	7.000.000	6.996.196
US Treasury Note 1,00 % 15.2.2018	5.244.000	5.241.542	US Treasury Note 1,00 % 15.12.2017	6.731.000	6.730.767
US Treasury Bill 0,00 % 24.11.2017	5.250.000	5.222.282	US Treasury Note 0,88 % 15.10.2017	6.307.000	6.303.791
US Treasury Note 0,75 % 15.4.2018	5.238.000	5.218.562	US Treasury Note 1,00 % 15.2.2018	5.244.000	5.240.928
US Treasury Bill 0,00 % 3.5.2018	4.830.000	4.798.988	US Treasury Bill 0,00 % 24.11.2017	5.250.000	5.226.988
US Treasury Bill 0,00 % 24.5.2018	4.799.000	4.764.553	US Treasury Note 1,00 % 15.3.2018	4.212.000	4.209.038
US Treasury Bill 0,00 % 19.7.2018	4.569.000	4.516.993	US Treasury Bill 0,00 % 9.11.2017	4.060.000	4.047.926
US Treasury Note 1,00 % 15.3.2018	4.212.000	4.206.917	US Treasury Note 0,63 % 31.5.2017	3.762.000	3.762.694
US Treasury Bill 0,00 % 9.11.2017	4.060.000	4.039.604	US Treasury Note 0,75 % 30.6.2017	3.684.000	3.683.710
US Treasury Note 2,63 % 30.4.2018	3.995.000	4.037.447	US Treasury Note 2,75 % 28.2.2018	3.080.000	3.088.039
US Treasury Bill 0,00 % 31.5.2018	4.000.000	3.970.981	Province of British Columbia Canada 0,00 % 3.1.2018	3.000.000	2.996.733
US Treasury Bill 0,00 % 7.6.2018	4.000.000	3.970.577	US Treasury Bill 0,00 % 7.12.2017	2.984.000	2.974.126
US Treasury Bill 0,00 % 13.9.2018	3.573.000	3.527.314	US Treasury Note 1,88 % 30.9.2017	2.811.000	2.817.778
US Treasury Bill 0,00 % 14.6.2018	3.510.000	3.484.111	US Treasury Bill 0,00 % 13.7.2017	2.661.000	2.654.476
US Treasury Note 2,75 % 28.2.2018	3.080.000	3.115.680	CDP Financial, Inc. 0,00 % 26.5.2017	2.500.000	2.499.354
Province of British Columbia Canada 0,00 % 3.1.2018	3.000.000	2.979.467	Ontario Teacher Finance Trust 0,00 % 29.6.2017	2.500.000	2.499.205
US Treasury Bill 0,00 % 7.12.2017	2.984.000	2.967.770	Federal Home Loan Bank Discount Notes 0,00 % 11.10.2017	2.350.000	2.342.872
US Treasury Note 1,88 % 30.9.2017	2.811.000	2.832.874	Svenska Handelsbanken AB 0,00 % 1.11.2017	2.300.000	2.297.971
US Treasury Bill 0,00 % 8.11.2018	2.873.000	2.830.726	US Treasury Note 0,50 % 28.2.2017	2.260.000	2.260.082
Toyota Motor Credit Corp. 0,00 % 1.3.2018	2.700.000	2.682.212	Westpac Banking Corp. 0,00 % 22.9.2017	2.200.000	2.199.368
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0,00 % 5.3.2018	2.700.000	2.678.832	Svenska Handelsbanken AB 0,00 % 4.5.2017	2.200.000	2.196.370
US Treasury Bill 0,00 % 13.7.2017	2.661.000	2.654.207	Chevron Corp. 0,00 % 24.10.2017	2.159.000	2.155.324
US Treasury Note 0,63 % 30.4.2018	2.572.000	2.558.661	Toyota Motor Credit Corp. 0,00 % 20.6.2017	2.100.000	2.099.592
Cooperatieve Rabobank UA 0,00 % 7.12.2017	2.500.000	2.499.919	Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust 0,00 % 3.5.2018	2.100.000	2.087.745
			US Treasury Bill 0,00 % 17.8.2017	2.093.000	2.087.040
			US Treasury Note 0,75 % 31.1.2018	2.060.000	2.057.991
			US Treasury Bill 0,00 % 24.8.2017	2.035.000	2.030.253
			US Treasury Note 0,88 % 15.8.2017	2.026.000	2.026.335
			PSP Capital, Inc. 04.28.17 28.4.2017	2.019.000	2.016.569
			Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 1,25 % 10.1.2017	2.000.000	2.000.152
			Swedbank AB 1,25 % 21.11.2017	2.000.000	2.000.087
			Citibank NA 1,40 % 22.12.2017	2.000.000	1.999.982
			American Honda Finance Corp. 23.10.2017	2.000.000	1.999.568
			Cooperatieve Rabobank UA 0,00 % 1.8.2017	2.000.000	1.998.554
			National Australia Bank Ltd. 0,00 % 13.3.2017	2.000.000	1.998.440

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die 1 % des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die 1 % des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die 20 grössten Käufe und die 20 grössten Verkäufe dargestellt werden. Es müssen alle Verkäufe und Käufe dargestellt werden, wenn weniger als 20 getätigt wurden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

Bilanz

	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2016
Umlaufvermögen		
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	101.917.891	77.032.921
Barmittel und liquide Vermögenswerte	2.353	591
Forderungen:		
Zinsen und Dividenden	88.431	216.463
Verkaufte Kapitalbeteiligungen	303.980	482
Summe Umlaufvermögen	102.312.655	77.250.457
Kurzfristige Passiva		
Verbindlichkeiten und sonstige Passiva:		
Zahlbare Dividenden	51.553	6.584
Zurückgenommene Kapitalbeteiligungen	—	14.648
Zahlbare Verwaltungsgebühren	22.802	17.463
Summe kurzfristige Passiva	74.355	38.695
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken) („Nettovermögen“)	102.238.300	77.211.762

Nettoinventarwert je Anteil

	Zum 31. Dezember 2017 ¹	Zum 31. Dezember 2016	Zum 31. Dezember 2015
Institutionelle USD-Anteile (\$)			
Nettovermögen	74.294.886	50.300.609	60.943.168
Anzahl der umlaufenden Anteile	7.422.424	5.020.521	6.091.117
Nettoinventarwert je Anteil	10,01	10,02	10,01
USD-Anlegeranteile (\$)			
Nettovermögen	27.943.414	26.911.153	31.020.586
Anzahl der umlaufenden Anteile	2.791.698	2.686.018	3.100.445
Nettoinventarwert je Anteil	10,01	10,02	10,01

¹ Der ausgewiesene Nettoinventarwert je Anteil kann vom zu Handelszwecken ausgewiesenen Nettoinventarwert je Anteil zum 31. Dezember 2017 aufgrund von Anpassungen durch Swing Pricing und Bilanzierung zum Handelstag abweichen.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Betriebsergebnisrechnung

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Anlageerträge/(-verluste)		
Zinserträge	1.077.502	630.639
Verschiedene Erträge	42	—
Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten	(97.385)	125.676
Summe Anlageerträge/(-verluste)	980.159	756.315
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	247.392	224.105
Summe Aufwendungen	247.392	224.105
Finanzierungskosten		
Zinsaufwand	—	747
Ausgezählte Ausschüttungen	827.390	404.911
Summe Finanzierungskosten	827.390	405.658
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(94.623)	126.552
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens (zu Finanzberichterstattungszwecken)	(94.623)	126.552

Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens

	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2017	US-Dollar (\$) Zum Jahresende 31. Dezember 2016
Steigerung/(Minderung) des Nettovermögens		
Nettosteigerung/(-minderung) des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens aus laufender Geschäftstätigkeit	(94.623)	126.552
Kapitalgeschäfte		
Zeichnungen	44.386.658	18.460.881
Rücknahmen	(19.654.832)	(33.597.778)
Reinvestitionen	389.335	258.353
Summe Kapitalgeschäfte	25.121.161	(14.878.544)
Gesamtsteigerung/(-minderung) für das Jahr	25.026.538	(14.751.992)
Den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen (zu Finanzberichterstattungszwecken)		
Zu Jahresbeginn ^z	77.211.762	91.963.754
Zum Jahresende	102.238.300	77.211.762

Es werden keine anderen Gewinne oder Verluste während des Jahres verbucht als die oben angeführten. Bei der Berechnung der Ergebnisse für das Jahr beziehen sich alle Beträge auf eine fortgeführte Geschäftstätigkeit.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Abschlusses.

Erläuterungen zum Abschluss

1. Allgemeine Informationen. Vanguard Investment Series plc („die Gesellschaft“), eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital, wurde am 4. März 1998 nach dem Recht der Republik Irland als Aktiengesellschaft gegründet. Die Gesellschaft wurde als Umbrella-Fonds errichtet, bei dem das Anteilskapital (die „Anteile“) der Gesellschaft in verschiedene Anteilsreihen eingeteilt wird, wobei jede Reihe von Anteilen einen getrennten Pool von Vermögenswerten repräsentiert (ein „Portfolio“), der einen gesonderten Teilfonds (jeder ein „Fonds“; gemeinsam die „Fonds“) der Gesellschaft darstellt. Die Anteile aller Fonds sind am Global Exchange Market der Irish Stock Exchange notiert, mit Ausnahme der im Folgenden genannten vier Fonds, die noch nicht gehandelt werden. Die Gesellschaft wurde von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank“) als Organismus für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren gemäss den Verordnungen der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren) von 2011 (die „OGAW-Verordnungen“) (in der jeweils gültigen Fassung) zugelassen. Am 24. Mai 2006 wurde der Beschluss gefasst, dass die Gesellschaft gemäss den Vorschriften des Investment Funds, Companies and Miscellaneous Provisions Act von 2005 in einen Umbrella-Fonds mit Haftungstrennung zwischen den Teilfonds umgewandelt wird.

2. Darstellung des Halbjahresabschlusses. Die Gesellschaft ist als Umbrella-Fonds organisiert und bestand während des Jahres zum 31. Dezember 2017 aus 36 Teilfonds:

	Aufnahme der Geschäftstätigkeit
Vanguard Emerging Markets Stock Index Fund (der „Emerging Markets Stock Index Fund“)	7. Juni 2006
Vanguard European Stock Index Fund (der „European Stock Index Fund“)	14. September 1998
Vanguard Eurozone Stock Index Fund (der „Eurozone Stock Index Fund“)	25. Oktober 2001
Vanguard Global Enhanced Equity Fund (der „Global Enhanced Equity Fund“)	18. April 2007
Vanguard Global Small-Cap Index Fund (der „Global Small-Cap Index Fund“)	10. Dezember 2009
Vanguard Global Stock Index Fund (der „Global Stock Index Fund“)	4. August 1998
Vanguard Japan Stock Index Fund (der „Japan Stock Index Fund“)	22. Oktober 2003
Vanguard Pacific ex-Japan Stock Index Fund (der „Pacific ex-Japan Stock Index Fund“)	22. Juli 2005
Vanguard SRI European Stock Fund (der „SRI European Stock Fund“)	29. Juni 2010
Vanguard SRI Global Stock Fund (der „SRI Global Stock Fund“)	7. Februar 2011
Vanguard U.S. 500 Stock Index Fund (der „U.S. 500 Stock Index Fund“)	4. November 1998
Vanguard U.S. Discoveries Fund (der „U.S. Discoveries Fund“)	1. Juli 2004
Vanguard U.S. Fundamental Value Fund (der „U.S. Fundamental Value Fund“)	3. Mai 2005
Vanguard U.S. Opportunities Fund (der „U.S. Opportunities Fund“)	8. April 2002
Vanguard 20+ Year Euro Treasury Index Fund (der „20+ Year Euro Treasury Index Fund“)	29. August 2007
Vanguard Euro Government Bond Index Fund (der „Euro Government Bond Index Fund“)	29. September 2000
Vanguard Euro Investment Grade Bond Index Fund (der „Euro Investment Grade Bond Index Fund“)	29. September 2000
Vanguard Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund (der „Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund“)	31. Mai 2005
Vanguard Global Bond Index Fund (der „Global Bond Index Fund“)	31. März 2008
Vanguard Global Corporate Bond Index Fund (der „Global Corporate Bond Index Fund“)	2. November 2017
Vanguard Global Credit Bond Fund (der „Global Credit Bond Fund“)	14. September 2017
Vanguard Global Short-Term Bond Index Fund (der „Global Short-Term Bond Index Fund“)	31. Januar 2014
Vanguard Global Short-Term Corporate Bond Index Fund (der „Global Short-Term Corporate Bond index Fund“)	2. November 2017
Vanguard Japan Government Bond Index Fund (der „Japan Government Bond Index Fund“)	1. April 2004
Vanguard SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund (der „SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund“)	18. Juli 2017
Vanguard U.K. Government Bond Index Fund (der „U.K. Government Bond Index Fund“)	23. Juni 2009
Vanguard U.K. Investment Grade Bond Index Fund (der „U.K. Investment Grade Bond Index Fund“)	20. März 2007
Vanguard U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund (der „U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund“)	22. Mai 2013
Vanguard U.S. Government Bond Index Fund (der „U.S. Government Bond Index Fund“)	31. Januar 2002
Vanguard U.S. Investment Grade Credit Index Fund (der „U.S. Investment Grade Credit Index Fund“)	16. Dezember 2004
Vanguard U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund (der „U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund“)	24. Oktober 2016
Vanguard U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund (der „U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund“)	6. Mai 1999

Bislang hat keiner der unmittelbar vorangehend dargelegten vier Fonds den Handel aufgenommen.

Für jeden Fonds wird ein Portfolio geführt, das jeweils im Einklang mit den Anlagezielen des Fonds investiert wird, zu dem das Portfolio gehört. Der U.S. Discoveries Fund wurde am 23. Mai 2017 liquidiert und ist nicht mehr zur Zeichnung verfügbar.

3. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze. Der Rechnungsabschluss wurde für das zum 31. Dezember 2017 beendete Geschäftsjahr aufgestellt. Der Abschluss wurde nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt, ausser beim U.S. Discoveries Fund (bei dem er auf der Grundlage der Liquidation erstellt wurde).

Das Format und bestimmte Formulierungen in den Jahresabschlüssen wurden aus den im Companies Act 2014 enthaltenen Formaten und Formulierungen so angepasst, dass das Geschäft der Gesellschaft als Investmentfonds nach Ansicht des Verwaltungsrats besser zum Ausdruck kommt. Die Gewinn- und Verlustrechnung wird als Betriebsergebnisrechnung und die Bilanz als Vermögensaufstellung bezeichnet. Die Summe der realisierten Gewinne und Verluste wird in der Betriebsergebnisrechnung aufgeführt.

Die Gesellschaft hat von der Befreiung Gebrauch gemacht, die im Financial Reporting Standard („FRS“) 102, Abschnitt 7.1A, Kapitalflussrechnung, enthalten ist, und eine Aufstellung der Änderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens anstelle einer Kapitalflussrechnung erstellt. Nach Ansicht des Verwaltungsrats erfüllen diese Informationen auch die Anforderungen von FRS 102, Abschnitt 10.4, Ausweisung der Finanzergebnisse bezüglich einer Überleitung der Entwicklung des Eigenkapitals.

Der Abschluss wurde im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen erstellt, einschliesslich des FRS 102, FRS 104 und der irischen Rechtsvorschriften, bestehend aus den Companies Act von 2014, den OGAW-Richtlinien, dem Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48 (1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2015 (die „CBI-OGAW-Verordnungen“) und den Notierungsrichtlinien am Global Exchange Market der Irish Stock Exchange. Die in Irland allgemein anerkannten Grundsätze ordnungsgemässer Rechnungslegung zur Erstellung von Jahresabschlüssen, die ein wahrheitsgemäßes und angemessenes Bild der Situation der Gesellschaft vermitteln, werden vom Institute of Chartered Accountants in Irland veröffentlicht und vom Financial Reporting Council („FRC“) herausgegeben.

Die Angaben, die gemäss FRS 102 in der Gesamtergebnisrechnung enthalten sein müssen, sind in der Betriebsergebnisrechnung für die jeweiligen Fonds und die Gesellschaft enthalten.

Die Abschlüsse wurden nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt und durch die Neubewertung der erfolgswirksam zu ihrem beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten modifiziert. Der Bewertungszeitpunkt ist der Handelsschluss des jeweiligen Handelstags des entsprechenden Markts basierend auf dem Handelsort des jeweiligen Wertpapiers. Der Abschluss der Gesellschaft basiert auf den Bewertungen der Fonds zum Ende des Geschäftsjahres, die am 29. Dezember 2017, dem letzten Geschäftstag des Berichtszeitraums, erstellt wurden.

(a) Bewertung der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten. Gemäss FRS 102 muss eine Einrichtung bei der Rechnungslegung für ihre gesamten Finanzinstrumente eines der Folgenden anwenden: (a) die vollständigen Anforderungen von Abschnitt 11 „Basic Financial Instruments“ und Abschnitt 12 „Other Financial Instruments Issues“ von FRS 102; (b) die Bestimmungen zu Ansatz und Bewertung von International Accounting Standards 39 „Financial Instruments: Recognition and Measurement“ („IAS 39“) entsprechend der Anwendung in der Europäischen Union und die Offenlegungspflichten der Abschnitte 11 und 12; oder (c) die Bestimmungen zu Ansatz und Bewertung von International Financial Reporting Standards („IFRS“) 9 „Financial Instruments“ („IFRS 9“) und die Offenlegungspflichten der Abschnitte 11 und 12. Die Gesellschaft hat sich dafür entschieden, die Bestimmungen zu Ansatz und Bewertung von IAS 39 und die Offenlegungspflichten der Abschnitte 11 und 12 anzuwenden.

Gemäss IAS 39 hat die Gesellschaft ihre Anlagen erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert als finanzielle Vermögenswerte oder finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert. Diese finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden für den Besitz zu Handelszwecken klassifiziert oder durch den Verwaltungsrat erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen. Alle Anlagen in Derivate werden für Handelszwecke gehalten. Kapitalanlagen werden ursprünglich zum beizulegenden Zeitwert der erbrachten Gegenleistung mit Transaktionskosten verbucht. Die Transaktionskosten für solche Instrumente werden dabei direkt in der Betriebsergebnisrechnung auf Basis des Handelsdatums ausgewiesen. Die finanziellen Vermögenswerte werden ausgebucht, wenn der Anspruch auf Cashflow aus den Anlagen beendet ist oder die Gesellschaft im Wesentlichen alle mit dem Eigentum verbundenen Risiken und Vorteile übertragen hat.

In Einklang mit dem Prospekt und IAS 39 werden Kapitalanlagen zum letzten Handelspreis auf dem entsprechenden regulierten Markt zum Bewertungszeitpunkt für die Berechnung des Nettoinventarwerts für Zeichnungen und Rücknahmen und für verschiedene Gebührenberechnungen bewertet.

Der Wert von Anlagen, die an einem anerkannten Markt oder gemäss dessen Vorschriften notiert oder normal gehandelt werden, wird unter Bezugnahme auf den letzten verfügbaren Handelspreis auf dem entsprechenden anerkannten Markt zum Bewertungszeitpunkt berechnet. Ist eine Anlage an mehr als einer Börse oder einem Markt notiert, übernimmt der Verwaltungsrat oder dessen Vertreter den Kurs oder, je nach Sachlage, dem letzten Handelspreis der Marktnotierung am anerkannten Markt, der nach seiner Ansicht den Hauptmarkt für diese Anlagen darstellt.

Die Bewertung einer Anlage, die normalerweise nicht an einem geregelten Markt oder nach den Regeln eines geregelten Marktes notiert, gelistet oder gehandelt wird, erfolgt anhand ihres wahrscheinlichen Veräusserungswerts, der mit der gebotenen Sorgfalt und nach Treu und Glauben vom Verwaltungsrat in Absprache mit The Vanguard Group, Inc. (der „Investment-Manager“) und Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited (die „Verwaltungsstelle“) oder von einer sachverständigen Person, Firma oder Gesellschaft, die zu diesem Zweck vom Verwaltungsrat in Absprache mit dem Investment-Manager ernannt und von Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited (die „Depotbank“) genehmigt wurde, geschätzt wird.

Funktional- und Darstellungswährung. Die Posten im Jahresabschluss der Gesellschaft werden in der Währung des primären Wirtschaftsraums, in dem die Gesellschaft tätig ist, geführt („Funktionalwährung“).

In der folgenden Tabelle wird die Funktionalwährung der folgenden Fonds angezeigt:

Fonds	Funktionalwährung	Fonds	Funktionalwährung
Emerging Markets Stock Index Fund	US-Dollar (US\$)	U.S. Investment Grade Credit Index Fund	US-Dollar (US\$)
European Stock Index Fund	US-Dollar (US\$)	U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund	US-Dollar (US\$)
Global Enhanced Equity Fund	US-Dollar (US\$)	U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund	US-Dollar (US\$)
Global Small-Cap Index Fund	US-Dollar (US\$)	Eurozone Stock Index Fund	Euro (€)
Global Stock Index Fund	US-Dollar (US\$)	Japan Stock Index Fund	Euro (€)
SRI Global Stock Fund	US-Dollar (US\$)	Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Euro (€)
U.S. 500 Stock Index Fund	US-Dollar (US\$)	SRI European Stock Fund	Euro (€)
U.S. Discoveries Fund	US-Dollar (US\$)	20+ Year Euro Treasury Index Fund	Euro (€)
U.S. Fundamental Value Fund	US-Dollar (US\$)	Euro Government Bond Index Fund	Euro (€)
U.S. Opportunities Fund	US-Dollar (US\$)	Euro Investment Grade Bond Index Fund	Euro (€)
Global Bond Index Fund	US-Dollar (US\$)	Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund	Euro (€)
Global Corporate Bond Index Fund	US-Dollar (US\$)	SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund	Euro (€)
Global Credit Bond Fund	US-Dollar (US\$)	U.K. Government Bond Index Fund	Britisches Pfund (£)
Global Short-Term Bond Index Fund	US-Dollar (US\$)	U.K. Investment Grade Bond Index Fund -	Britisches Pfund (£)
Global Short-Term Corporate Bond Index Fund	US-Dollar (US\$)	U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund	Britisches Pfund (£)
U.S. Government Bond Index Fund	US-Dollar (US\$)	Japan Government Bond Index Fund -	Japanischer Yen (¥)

Für Konsolidierungszwecke werden alle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aller Anteilsklassen zum am Jahresende gültigen Wechselkurs in US-Dollar umgerechnet, bei dem es sich um die Darstellungswährung der Gesellschaft handelt. Alle Einnahmen und Aufwendungen werden zum Durchschnittssatz in US-Dollar umgerechnet.

Aktiefonds. Jedes Wertpapier wird am Jahresende zum letzten verfügbaren Handelskurs bewertet. Auf einem anerkannten Markt gehandelte Wertpapiere werden auf Basis von Bewertungen bewertet, die von einem führenden Market Maker oder einem Kalkulationsservice festgelegt werden. Nicht notierte und ausgesetzte Wertpapiere werden gegebenenfalls auf Basis ihres realisierbaren Nettowerts nach der Einschätzung des Investment-Managers bewertet oder zum letzten Handelskurs, der von Makler-Händlern zu ausserbörslichen Handelszwecken gezahlt wurde.

Rentenfonds. Auf einem anerkannten Markt gehandelte Schuldtitel werden auf der Basis von Bewertungen bewertet, die von einem führenden Market Maker oder einem Kalkulationsservice festgelegt werden, die beide in der Regel elektronische Datenverarbeitungsmethoden verwenden, um die Bewertungen für den üblichen institutionellen Handel mit Schuldtiteln ohne ausschliesslichen Verlass auf notierte Kurse festzulegen.

Termingeschäfte. Bei einem Devisentermingeschäft („Termingeschäft“) handelt es sich um die Zusage, eine Devisen an einem späteren Datum zu einem ausgehandelten Preis zu kaufen oder zu verkaufen. Die Fonds können drei Arten von Termingeschäften eingehen: Absicherung auf Ebene der Anteilsklasse, Wechselkursabsicherung und Absicherung von Wertpapiertransaktionen.

Die folgenden Fonds gehen Termingeschäfte ein, um dasselbe Währungsengagement wie ihre jeweiligen Indizes beizubehalten. Ausserdem schliessen diese Fonds normalerweise Termingeschäfte zur Absicherung eines Kaufs oder Verkaufs eines in Fremdwährung notierten Wertpapiers ab.

Fonds	Fonds
European Stock Index Fund	Global Corporate Bond Index Fund
Global Enhanced Equity Fund	Global Credit Bond Fund
Global Stock Index Fund	Global Short-Term Bond Index Fund
Japan Stock Index Fund	Global Short-Term Corporate Bond Index Fund
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Japan Government Bond Index Fund -
U.S. 500 Stock Index Fund	U.S. Government Bond Index Fund
Euro Government Bond Index Fund	U.S. Investment Grade Credit Index Fund
Euro Investment Grade Bond Index Fund	U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund
Global Bond Index Fund	

Termingeschäfte werden täglich zum Schlusskurs der Devisenterminkontraktpreise auf den Londoner Devisenmärkten bewertet, die von einer zuverlässigen Bank oder einem zuverlässigen Händler bereitgestellt werden. Die Fonds werden nach Schluss oder Abrechnung des Termingeschäfts einen Gewinn oder Verlust realisieren. Für die Absicherung von auf ausländische Währungen lautenden Wertpapieren und von Wertpapiertransaktionen werden auf Fondsebene realisierte und nicht realisierte Gewinne und Verluste zugewiesen. Für Absicherungen auf Klassenebene werden die realisierten und nicht realisierten Gewinne oder Verluste ausschliesslich der relevanten Anteilsklasse zugewiesen.

Ausstehende Sicherheiten für Termingeschäfte sind, sofern zutreffend, in der Aufstellung der Kapitalanlagen angegeben. Eine nicht realisierte Wertsteigerung oder Wertminderung aus Termingeschäften wird in der Bilanz ausgewiesen.

Realisierte Gewinne und Verluste werden mit allen anderen Fremdwährungsgewinnen und -verlusten in der Betriebsergebnisrechnung der Gesellschaft und des Fonds ausgewiesen.

Termingeschäfte beinhalten unter anderem das Risiko, dass der Kontrahent die Bedingungen des Termingeschäfts eventuell nicht erfüllen kann oder dass der Wert einer Währung gegenüber der Funktionalwährung eines Fonds, der Termingeschäfte eingeht, unerwartet schwankt.

Futures. Fonds können in begrenztem Umfang Index-Futures einsetzen, um ein volles Engagement im Aktienmarkt zu erreichen, liquide zu bleiben und Transaktionskosten zu minimieren. Fonds können Futures erwerben, um eingehende Barmittel sofort in den Markt zu investieren, oder sie in Reaktion auf Bargeldabflüsse verkaufen und hierdurch eine vollständig investierte Position im zugrunde liegenden Index simulieren, während gleichzeitig ein Kassenbestand für Liquiditätszwecke erhalten bleibt.

Die Fonds müssen nach Abschluss eines Futures entweder Bargeld oder Wertpapiere (Originaleinschuss) in einer Höhe hinterlegen, die einem bestimmten Prozentsatz des Kontraktwerts bei einer Clearingstelle entspricht. Die Fonds leisten bzw. erhalten jeden Tag nachfolgende Zahlungen oder Eingänge (Nachschuss).

Die Nachschusszahlungen oder -einträge entsprechen den täglichen Veränderungen des Kontraktwerts und werden als nicht realisierte Gewinne und Verluste in der Betriebsergebnisrechnung verbucht. Die Fonds weisen bei Glattstellung oder Fälligkeit des Kontrakts einen Gewinn oder Verlust aus.

Optionen. Optionen sind Kontrakte, bei denen der „Stillhalter“ (Verkäufer) dem Käufer des Kontrakts zusichert, dass er das Recht, jedoch nicht die Verpflichtung hat, einen bestimmten Index bzw. eine bestimmte Aktie, Anleihe oder Währung zu einem bestimmten Preis (dem „Ausübungspreis“) an oder vor einem bestimmten Verfallsdatum bzw. Ausübungsdatum zu kaufen oder zu verkaufen. Eine Option, die dem Käufer das Recht gibt, zu einem bestimmten Preis zu kaufen, nennt sich Call-Option, während eine Option, die diesem das Recht zum Verkauf verleiht, als Put-Option bezeichnet wird. Call- und Put-Optionen können auf Wertpapiere, Wertpapierindizes und Währungen gekauft bzw. gezeichnet werden, und Optionen können für Futures-Kontrakte und Swapvereinbarungen und/oder zur Absicherung gegen Änderungen von Zinssätzen, Wechselkursen oder Wertpapierkursen verwendet werden.

Wenn der Fonds eine Option schreibt, wird ein Betrag in Höhe der vom Fonds vereinnahmten Prämie als Verbindlichkeit verbucht und der aktuelle beizulegende Zeitwert der geschriebenen Option wird anschliessend um diesen Betrag angepasst. Die Prämie auf ausgeübte geschriebene Kaufoptionen wird zur Feststellung des realisierten Gewinns bzw. Verlusts zum Erlös aus dem Verkauf der zugrunde liegenden Wertpapiere bzw. Währungen hinzuaddiert. Die Prämie auf ausgeübte geschriebene Verkaufsoptionen wird von den Kosten der gekauften Wertpapiere oder Devisen abgezogen. Erhaltene Prämien aus geschriebenen Optionen, die verfallen, werden als realisierte Gewinne behandelt. Die Prämie auf ausgeübte gekaufte Verkaufsoptionen wird bei der Bestimmung des realisierten Gewinns oder Verlusts vom Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers bzw. der zugrunde liegenden Devisen abgezogen. Die gezahlte Prämie für ausgeübte gekaufte Kaufoptionen wird zu den Kosten der gekauften Wertpapiere bzw. Währungen hinzuaddiert. Prämien, die für den Kauf von Optionen gezahlt wurden, die unausgeübt verfallen, werden als realisierte Verluste behandelt. Börsengehandelte Optionen werden zu dem Glattstellungskurs bewertet, der von der jeweiligen Börse festgelegt wird.

Der Global Credit Bond Fund ist Optionskontrakte eingegangen.

Swap-Kontrakte. Ein Swap-Kontrakt ist eine privat ausgehandelte Vereinbarung zwischen einem Fonds und einem Kontrahenten, um die von einem Instrument erzielte Rendite gegen die von einem anderen Instrument erzielte Rendite zu tauschen. Einige Swap-Kontrakte werden netto abgerechnet. Beim Eingehen eines ausserbörslichen („OTC“) Swap-Kontrakts und während der Laufzeit der Transaktion können der Fonds und/oder der Swap-Kontrahent Barmittel oder Wertpapiere als Sicherheit gemäss den Bedingungen des jeweiligen Swap-Kontrakts hinterlegen oder erhalten, um für den Fall der Zahlungsunfähigkeit oder des Konkurses bzw. der Insolvenz Vermögenswerte und Regressmittel bereitzustellen.

Ein Credit Default Swap wird verwendet, um das Ausfallrisiko eines festverzinslichen Basistitels vom Halter des festverzinslichen Wertpapiers an den Verkäufer des Swaps zu übertragen. Die Vorauszahlung, die ein Fonds als Sicherungsgeber erhält, wird in den Geschäftsbüchern des Fonds als Verbindlichkeit verbucht. Eine Vorauszahlung, die ein Fonds als Sicherungsnehmer leistet, wird in den Geschäftsbüchern des Fonds als Vermögenswert verbucht. Von einem Fonds erhaltene oder geleistete Zahlungen werden als realisierte Gewinne oder Verluste verbucht. Credit Default Swaps werden unter Verwendung eines Kursdienstleisters bewertet. Wenn kein Kursdienstleister verfügbar ist, kann der Marktwert der Kontrakte täglich auf der Grundlage der von Kursdienstleistern erhaltenen Notierungen oder auf der Grundlage von Berechnungen mittels Bewertungsmodellen bewertet werden und die ggf. vorhandene Änderung wird als nicht realisierter Gewinn oder Verlust in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen. Zahlungen, die aufgrund eines Kreditereignisses oder der Beendigung des Kontrakts erhalten oder geleistet werden, werden nach Abzug von einem anteiligen Betrage der Vorauszahlung als realisierte Gewinne oder Verluste über den Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Der Global Credit Bond Fund ist Credit Default Swaps eingegangen.

(b) Barmittel und Überziehungskredite. Barmittel und Überziehungskredite werden zum beizulegenden Zeitwert zuzüglich eventuell aufgelaufener Zinsen zum Bewertungszeitpunkt am jeweiligen Handelstag bewertet, sofern nicht nach Ansicht des Verwaltungsrats (in Absprache mit Vanguard Group (Ireland) Limited (der „Manager“), dem Investment-Manager und der Verwahrstelle) eine Anpassung erforderlich ist, um den tatsächlichen Wert abzubilden. In der Vermögensaufstellung werden Barmittel als Umlaufvermögen und Überziehungskredite bei Banken als aktuelle Verbindlichkeiten ausgewiesen.

(c) Dividenden. Dividenden auf Wertpapiere werden in der Betriebsergebnisrechnung auf „Ex-Tag“-Basis erfasst. Die nicht anrechenbare Quellensteuer auf Dividendenerträge ist in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen. Dividendenerträge werden ohne Bereinigung um die nicht anrechenbare Quellensteuer ausgewiesen.

(d) Zinserträge. Zinserträge werden für alle Schuldtitel nach der Effektivzinsmethode verbucht. Die Effektivzinsmethode ist ein Verfahren zur Berechnung des Restbuchwerts eines Finanzinstruments, bei dem die Zinserträge oder -aufwendungen auf das betreffende Jahr verteilt werden. Der Effektivzins ist der Satz, der zukünftige Barzahlungen oder -einträge während der erwarteten Laufzeit des Finanzinstruments oder einer kürzeren Periode, sofern geeignet, auf den Nettobuchwert des Finanzinstruments abzinst. Bei der Berechnung des Effektivzinses schätzt der Fonds unter Berücksichtigung aller Vertragsbedingungen des Finanzinstruments den Cashflow, wobei jedoch zukünftige Kreditverluste nicht in Betracht gezogen werden.

Die Berechnung schliesst alle Gebühren und Posten, die von den Vertragsparteien gezahlt oder vereinnahmt werden und ein wesentlicher Bestandteil des Effektivzinses sind, sowie die Transaktionskosten und alle anderen Zu- oder Abschläge ein. Sobald ein finanzieller Vermögenswert oder eine Gruppe von ähnlichen finanziellen Vermögenswerten infolge einer Wertminderung abgeschrieben worden ist, wird der Zinsertrag unter Verwendung desjenigen Zinssatzes verbucht, der bei der Bewertung der Wertminderung zur Abzinsung des zukünftigen Cashflows verwendet wurde.

(e) Zuteilung von Erträgen und Aufwendungen. Erträge, Aufwendungen (mit Ausnahme der klassenspezifischen Aufwendungen) und realisierte/nicht realisierte Gewinne bzw. Verluste, die einen bestimmen Fonds betreffen, werden in jeder Anteilsklasse relativ zum relativen Nettoinventarwert der umlaufenden Anteile jeder Klasse am Beginn des Tages (nach Berichtigung um die aktuellen Aktivitäten der Kapitalanteile der jeweiligen Klassen) zugeteilt. Klassenspezifische Aufwendungen werden den entsprechenden Anteilsklassen direkt belastet. Aufwendungen werden nach Fälligkeit in der Betriebsergebnisrechnung verbucht.

(f) Realisierte und nicht realisierte Gewinne und Verluste. Alle realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste, darunter Devisengewinne oder -verluste über den Nettogewinn/(-verlust) aus Finanzinstrumenten, werden in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

(g) Zinsaufwand. Der Zinsaufwand wird bei Überziehungskrediten und Kassenbeständen und Schuldtiteln vorbehaltlich eines negativen Zinssatzes verbucht. Der Zinsaufwand wird in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

(h) Zurücknehmbare gewinnberechtigte Anteile. Zurücknehmbare gewinnberechtigte Anteile statten Anteilinhaber mit dem Recht aus, ihre Anteile gegen Barmittel im Wert ihres proportionalen Anteils am Nettoinventarwert des Fonds zurückzugeben und werden dementsprechend als Verbindlichkeiten verbucht. Diese Verbindlichkeit gegenüber Anteilhabern wird in der Vermögensaufstellung als „den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen“ ausgewiesen und basiert auf dem restlichen Vermögen des Fonds nach Abzug aller sonstigen Verbindlichkeiten.

(i) Wertpapierleihgeschäfte. Die Gesellschaft darf ihre Wertpapiere an Makler, Händler und andere Finanzorganisationen verleihen. Alle Gewinne oder Verluste in Bezug auf den Marktkurs der verliehenen Wertpapiere, die während des Verleihgeschäfts eventuell verzeichnet werden, gehen in der Betriebsergebnisrechnung auf Rechnung des betreffenden Fonds

(j) Berichterstattung zum Handelstag. Kapitalanlagertransaktionen werden zu Zwecken des Abschlusses zum 29. Dezember 2017 verbucht, der der letzte Handelstag des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2017 ist. Dies unterscheidet sich von der Basis für den Nettoinventarwert des täglichen Handels, der zum Handelstag plus einem Geschäftstag ausgewiesen wird.

(k) Verrechnung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten. Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden verrechnet und der Nettobetrag wird in der Vermögensaufstellung ausgewiesen, wenn das gesetzlich einklagbare Recht besteht, die verbuchten Beträge zu verrechnen und die Absicht besteht, auf Nettobasis abzurechnen oder gleichzeitig die Vermögenswerte zu aktivieren und Verbindlichkeiten zu begleichen.

(l) Ertragsausgleich. Für die ausschüttenden Anteilsklassen schliesst die Gesellschaft Ertragsausgleichsvereinbarungen ab und leistet für jeden dieser Anteile Ertragsausgleichszahlungen, die den anteiligen Dividendenzahlungen auf der Grundlage des Halbezeitraums des Anteils durch den Anleger entsprechen. Erwirbt ein Anteilinhaber zu einem Zeitpunkt Anteile, zu dem der Fonds über aufgelaufene Erträge verfügt, die noch nicht als Dividenden erklärt wurden, kann der Verwaltungsrat ggf. dem Ertragsausgleichskonto einen Teil des Zeichnungspreises gutschreiben, der den aufgelaufenen Erträgen entspricht, die diesen Anteilen zuzuordnen wären.

Bei der Dividendenausschüttung erhält der Anteilinhaber denselben Barbetrag wie die bestehenden Anteilinhaber. Allerdings wird der Betrag, der den Erträgen entspricht, die vor dem Zeitpunkt des Erwerbs seiner Anteile aufgelaufen waren, nicht als Dividende gezahlt, sondern als Kapital aus dem Ertragsausgleichskonto. Dadurch erhält der Anleger einen Teil des Zeichnungspreises zurück. Der Ausgleich wird in der Betriebsergebnisrechnung als Finanzierungskosten verbucht.

(m) Swing Pricing. Vor dem 2. Oktober 2017 erhob der Manager eine Verwässerungsabgabe auf jeden Kauf, Verkauf oder Umtausch von Anteilen, bei dem er dies zum Schutz der Interessen der Anteilinhaber für gerechtfertigt hielt. Wenn sie erhoben wurde, wurde die Abgabe in das Vermögen des Fonds eingezahlt und wurde Teil davon. Ab dem 2. Oktober 2017 wird keine Verwässerungsabgabe mehr erhoben. Stattdessen wurde eine Verwässerungsanpassung auf den Preis der Anteile (auch bekannt als „Swing Pricing“) vorgenommen.

An jedem Handelstag, an dem Nettozeichnungen in einen Fonds oder Nettorücknahmen aus einem Fonds erfolgen, kann der Manager in seinem Ermessen beschliessen, den Nettoinventarwert anzupassen bzw. zu „swingen“, um den möglichen negativen Auswirkungen einer Verwässerung entgegenzuwirken und nicht handelnde Anteilinhaber vor den Auswirkungen von Handelskosten und Handelsspreads, die sich aus Zeichnungs- und Rücknahmeaktivitäten ergeben, zu schützen. Eine solche Anpassung kann von Fonds zu Fonds variieren. Die Verwässerungsanpassung hat bei allen Fonds bislang 2 % des ursprünglichen Nettoinventarwerts je Anteil nicht überschritten. Die Richtung des „Swing“ hängt davon ab, ob es Nettozeichnungen oder -rücknahmen im entsprechenden Fonds am entsprechenden Handelstag gibt, während der Umfang des „Swing“ auf vorab festgelegten Schätzwerten der durchschnittlichen Handelskosten in den entsprechenden Anlageklassen, in denen der Fonds investiert ist, basieren.

Die Entscheidung, den Nettoinventarwert in Bezug auf einen Fonds zu „swingen“, erfolgt nach einer Betrachtung der Handelsaktivität (d. h. des Umfangs an Zeichnungen und Rücknahmen) im entsprechenden Fonds an einem Handelstag gemäss den vom Manager jeweils festgelegten Kriterien. Zu diesen Kriterien gehört, ob die Kosten der Investition oder Desinvestition der Nettozuflüsse in oder Nettoabflüsse aus einem Fonds an einem Handelstag nach Auffassung des Managers einen wesentlichen verwässernden Effekt haben. Eine Verwässerungsanpassung wird nur zum Zwecke der Verringerung der Verwässerung im Interesse der Anteilinhaber eines Fonds insgesamt durchgeführt und wird konsequent in Bezug auf einen Fonds und in Bezug auf das gesamte Nettovermögen dieses Fonds angewendet.

Die folgende Tabelle zeigt die Swing Pricing-Anpassung des jeweiligen Nettovermögens jedes Fonds zum 31. Dezember 2017 zu Handelszwecken.

Die Swing Pricing-Anpassung zum 31. Dezember 2017 sind nachfolgend dargestellt:

Fonds	Swing-Pricing-Anpassung
Emerging Markets Stock Index Fund	\$ 13.900.917
Global Enhanced Equity Fund	\$ 167.725
Global Small-Cap Index Fund	\$ 718.955
Global Stock Index Fund	\$(1.091.641)
Japan Stock Index Fund	€ 679.539
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	€ 1.669.783
SRI Global Stock Fund	\$ (65.476)
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund	\$ 696.272

Es gab keine Swing Pricing-Anpassungen zum 31. Dezember 2016, da im vorherigen Geschäftsjahr noch kein Swing Pricing durchgeführt wurde.

(n) **Transaktionskosten.** Transaktionskosten bezeichnen die durch den Erwerb, die Emission oder die Veräußerung von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten entstandenen Kosten. Zu den Transaktionskosten zählen Gebühren und Provisionen an Broker, Makler und Händler, Gebühren von Aufsichtsbehörden und Wertpapierbörsen sowie Transfersteuern und -abgaben. Transaktionskosten enthalten keine Agios oder Disagios von Schuldpapieren, Finanzierungskosten oder internen Verwaltungs- oder Bestandskosten. Diese Kosten werden bei ihrer Entstehung und zu Finanzberichterstattungs Zwecken als Ausgabe in der Betriebsergebnisrechnung verbucht.

4. Finanzrisikomanagement

Marktpreisrisiko. Das Marktrisiko entsteht in erster Linie durch die Unsicherheit in Bezug auf die zukünftigen Preise der gehaltenen Finanzinstrumente.

Es stellt den potenziellen Verlust dar, den die Gesellschaft durch das Halten von Marktpositionen bei Kursschwankungen erleiden kann. Um ihre Zielindizes so genau wie möglich nachzubilden, werden die folgenden Fonds versuchen, vollständig in die in der folgenden Tabelle aufgeführten Finanzinstrumente investiert zu bleiben, indem sie so viele der relevanten Finanzinstrumente wie möglich besitzen, die im jeweiligen Index enthalten sind.

Fonds	Finanzinstrumente	Fonds	Finanzinstrumente
Emerging Markets Stock Index Fund	Aktien	Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund	Anleihen
European Stock Index Fund	Aktien	Global Bond Index Fund	Anleihen
Eurozone Stock Index Fund	Aktien	Global Corporate Bond Index Fund	Anleihen
Global Small-Cap Index Fund	Aktien	Global Short-Term Bond Index Fund	Anleihen
Global Stock Index Fund	Aktien	Global Short-Term Corporate Bond Index Fund	Anleihen
Japan Stock Index Fund	Aktien	Japan Government Bond Index Fund -	Anleihen
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Aktien	SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund	Anleihen
SRI European Stock Fund	Aktien	U.K. Government Bond Index Fund	Anleihen
SRI Global Stock Fund	Aktien	U.K. Investment Grade Bond Index Fund -	Anleihen
U.S. 500 Stock Index Fund	Aktien	U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund	Anleihen
20+ Year Euro Treasury Index Fund	Anleihen	U.S. Government Bond Index Fund	Anleihen
Euro Government Bond Index Fund	Anleihen	U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Anleihen
Euro Investment Grade Bond Index Fund	Anleihen	U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund	Anleihen

Die folgenden Fonds, die aktiv verwaltet werden, investieren in Wertpapiere, die an anerkannten Börsen oder Märkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden.

Fonds	Fonds
Global Enhanced Equity Fund	U.S. Opportunities Fund
U.S. Discoveries Fund (während des Geschäftsjahres liquidiert)	Global Credit Bond Fund
U.S. Fundamental Value Fund	U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund

Die Fonds unterliegen daher dem Marktrisiko. Aktien- und Rentenmärkte neigen zu zyklischen Bewegungen mit Perioden steigender und Perioden sinkender Kurse. Die Kursvolatilität bedeutet, dass der Wert der Positionen eines Anlegers sowohl steigen als auch fallen kann, und es besteht die Möglichkeit, dass ein Anleger den investierten Betrag nicht zurückerhält. Das gesamte Marktrisiko jedes Fonds zum 30. Juni 2017 und zum 31. Dezember 2016 finden Sie in der Aufstellung der Kapitalanlagen.

Der Verwaltungsrat verwaltet die mit den Investmentportfolios verbundenen Marktpreisrisiken, indem er den vollen und zeitnahen Zugriff auf relevante Informationen des Investment-Managers sicherstellt. Der Verwaltungsrat hält regelmässig Versammlungen ab. Er prüft bei jeder Versammlung die Wertentwicklung der Kapitalanlagen und die allgemeinen Marktpositionen. Er überwacht die Einhaltung der Anlageziele der einzelnen Fonds durch den Investment-Manager.

Fremdwährungsrisiko. Teile der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der folgenden Fonds lauten auf andere Währungen als ihre Funktionalwährungen, was bewirkt, dass die Bilanz und die Gesamtrendite durch Wechselkursschwankungen beeinflusst werden können.

Fonds	Funktionalwährung	Fonds	Funktionalwährung
Emerging Markets Stock Index Fund	US-Dollar (US\$)	Global Short-Term Corporate Bond Index Fund	US-Dollar (US\$)
European Stock Index Fund	US-Dollar (US\$)	U.S. Government Bond Index Fund	US-Dollar (US\$)
Global Enhanced Equity Fund	US-Dollar (US\$)	U.S. Investment Grade Credit Index Fund	US-Dollar (US\$)
Global Small-Cap Index Fund	US-Dollar (US\$)	U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund	US-Dollar (US\$)
Global Stock Index Fund	US-Dollar (US\$)	Japan Stock Index Fund	Euro (€)
SRI Global Stock Fund	US-Dollar (US\$)	Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Euro (€)
U.S. 500 Stock Index Fund	US-Dollar (US\$)	SRI European Stock Fund	Euro (€)
U.S. Opportunities Fund	US-Dollar (US\$)	Eurozone Stock Index Fund	Euro (€)
Global Bond Index Fund	US-Dollar (US\$)	Japan Government Bond Index Fund -	Japanischer Yen (¥)
Global Corporate Bond Index Fund	US-Dollar (US\$)	Euro Investment Grade Bond Index Fund	Euro (€)
Global Credit Bond Fund	US-Dollar (US\$)	Euro Government Bond Index Fund	Euro (€)
Global Short-Term Bond Index Fund	US-Dollar (US\$)		

Die übrigen Wertpapiere der Fonds lauten auf die Währungen, die in Erläuterung 3(a), Funktional- und Darstellungswährung, angegeben sind.

Die Renditen des Anlegers können geschmälert werden, soweit das Britische Pfund, der Japanische Yen bzw. der Euro im Wert gegenüber der Basiswährung eines Anlegers sinkt. Der Anleger kann daher einem Fremdwährungsrisiko unterliegen. Die jeweiligen Fremdwährungsrisiken der Fonds zum 31. Dezember 2017 und 31. Dezember 2016 finden Sie in der Aufstellung der Kapitalanlagen für jeden Fonds. Die in der Aufstellung der Kapitalanlagen für jeden Fonds angegebene geografische Analyse repräsentiert weitgehend dessen Währungsengagement zum Jahresende.

Alle Anleger können einem Fremdwährungsrisiko unterliegen, da die Möglichkeit besteht, dass sich Wechselkursänderungen bezogen auf die Basiswährungen der Anleger nachteilig auf den Wert der von den Fonds gehaltenen Anlagen auswirken.

Alle währungsabgesicherten Anteilsklassen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017 sind in der folgenden Tabelle aufgeführt:

Fonds	Währung	Fonds	Währung
Global Stock Index Fund		Anlegeranteile, abgesichert in CHF	CHF
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	EUR	Anlegeranteile, abgesichert in EUR	EUR
U.S. 500 Stock Index Fund		Anlegeranteile, abgesichert in USD	USD
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	EUR	Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP	GBP
Euro Government Bond Index Fund		Ertragsanteile, abgesichert in GBP	GBP
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP	GBP	Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in CHF	CHF
Euro Investment Grade Bond Index Fund		Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in EUR	EUR
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP	GBP	Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in USD	USD
Global Bond Index Fund		Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	GBP
Institutionelle Anteile, abgesichert in CHF	CHF	Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	GBP
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	EUR	Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in JPY	JPY
Institutionelle Anteile, abgesichert in USD	USD	Global Short-Term Corporate Bond Index Fund	
Anlegeranteile, abgesichert in CHF	CHF	Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	GBP
Anlegeranteile, abgesichert in EUR	EUR	Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in GBP	GBP
Anlegeranteile, abgesichert in USD	USD	Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in JPY	JPY
Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP	GBP	Japan Government Bond Index Fund -	
Ertragsanteile, abgesichert in GBP	GBP	Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP	GBP
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in CHF	CHF	Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in JPY	JPY
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in EUR	EUR	U.S. Government Bond Index Fund	
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in USD	USD	Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	EUR
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	GBP	Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP	GBP
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	GBP	Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in EUR	EUR
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in JPY	JPY	U.S. Investment Grade Credit Index Fund	
Global Corporate Bond Index Fund		Thesaurierende Anteile, abgesichert in GBP	GBP
Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in USD	USD	Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in CHF	CHF
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	GBP	Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in EUR	EUR
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in GBP	GBP	Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	GBP
Global Credit Bond Fund		Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	GBP
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in USD	USD	U.S. Treasury Inflation-Protect Securities Index Fund	
Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in USD	USD	Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in CHF	CHF
Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in EUR	EUR	Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in EUR	EUR
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in GBP	GBP	Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	GBP
Global Short-Term Bond Index Fund		Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert in SGD	SGD
Institutionelle Anteile, abgesichert in CHF	CHF	Select-Ertragsanteile, abgesichert in CHF	CHF
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	EUR	Select-Ertragsanteile, abgesichert in EUR	EUR
Institutionelle Anteile, abgesichert in USD	USD	Select-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	GBP

Jede abgesicherte Anteilsklasse beinhaltet eine Währungsabsicherung, die für Anleger, deren Basiswährung die für die abgesicherte Anteilsklasse spezifische Währung ist, als Puffer gegen die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen dient.

Die Anlage in internationale Wertpapiere und insbesondere in Wertpapiere, die von unterentwickelten Ländern emittiert werden, bringt in der Regel besondere Risiken mit sich. Der Wert von Anlagen in bestimmten Ländern kann durch eine Reihe von Faktoren nachteilig beeinflusst werden. Dazu zählen u. a. die Möglichkeit einer Enteignung oder einer konfiskatorischen Besteuerung, nachteilige Änderungen von Anlage- oder Devisenkontrollvorschriften, Schwierigkeiten beim Erhalt eines Urteils von einem ausländischen Gericht, politische Instabilität, die sich nachteilig auf Investitionen im betreffenden Land auswirken kann, die Enteignung oder Verstaatlichung der Vermögenswerte eines Unternehmens, Verzögerungen bei der Abwicklung von Transaktionen, Änderungen der Wirtschafts- oder Geldpolitik eines Landes oder sonstige politische und wirtschaftliche Faktoren.

Unter Einhaltung der Gesellschaftsrichtlinien überwacht der Investment-Manager regelmässig das Währungsrisiko der Fonds. Der Verwaltungsrat verlässt sich darauf, dass der Investment-Manager ihn über wesentliche Ereignisse informiert.

Zinsrisiko. Die festverzinslichen Wertpapiere, in die die folgenden Fonds investieren können, sind zinsabhängig und können aufgrund von Faktoren wie z. B. Zinsänderungen, die Marktwahrnehmung der Bonität des Emittenten und die allgemeine Marktliquidität etc. Kursschwankungen unterliegen.

Fonds
European Stock Index Fund ¹
Global Stock Index Fund ¹
Japan Stock Index Fund ¹
Pacific ex-Japan Stock Index Fund ¹
SRI Global Stock Fund ¹
U.S. 500 Stock Index Fund ¹
20+ Year Euro Treasury Index Fund
Euro Government Bond Index Fund
Euro Investment Grade Bond Index Fund
Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund
Global Bond Index Fund
Global Corporate Bond Index Fund

Fonds
Global Credit Bond Fund
Global Short-Term Bond Index Fund
Global Short-Term Corporate Bond Index Fund
Japan Government Bond Index Fund -
SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund
U.K. Government Bond Index Fund
U.K. Investment Grade Bond Index Fund -
U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund
U.S. Government Bond Index Fund
U.S. Investment Grade Credit Index Fund
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund
U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund

¹ Fonds können in begrenztem Umfang in festverzinsliche Wertpapiere investieren. Der Investment-Manager sieht kein wesentliches Zinsrisiko für diese Fonds.

Das Ausmass dieser Schwankungen ist in der Regel grösser, wenn die Laufzeit der ausstehenden Wertpapiere länger ist. Als Ausgleich für diese stärkeren Schwankungen bieten länger laufende Anleihen den Anlegern in der Regel höhere Renditen als Papiere mit kürzerer Laufzeit, wenn die übrigen Faktoren, wie z. B. die Bonität, gleich sind. Nach einem Anstieg der Marktzinssätze sinkt gewöhnlich der Wert von festverzinslichen Wertpapieren, während der Wert von festverzinslichen Wertpapieren nach einem Rückgang der Marktzinssätze gewöhnlich steigt.

Die Performance eines Fonds, der in festverzinsliche Wertpapiere investiert, hängt daher teilweise von der Fähigkeit des Investment-Managers ab, solche Schwankungen der Marktzinssätze vorauszusehen und darauf zu reagieren sowie angemessene Strategien anzuwenden, um die Renditen zu maximieren, während er gleichzeitig versucht, die damit verbundenen Risiken für das Anlagekapital zu minimieren.

Die Zinssätze der finanziellen Vermögenswerte der folgenden Fonds zum 31. Dezember 2017 sind in der Aufstellung der Kapitalanlagen aufgeführt.

Fonds
20+ Year Euro Treasury Index Fund
Euro Government Bond Index Fund
Euro Investment Grade Bond Index Fund
Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund
Global Bond Index Fund
Global Corporate Bond Index Fund
Global Credit Bond Fund
Global Short-Term Bond Index Fund
Global Short-Term Corporate Bond Index Fund

Fonds
Japan Government Bond Index Fund -
SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund
U.K. Government Bond Index Fund
U.K. Investment Grade Bond Index Fund -
U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund
U.S. Government Bond Index Fund
U.S. Investment Grade Credit Index Fund
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund
U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund

Der U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund investiert in kurzfristige Wertpapiere, deren Wertentwicklung stark mit den kurzfristigen Zinssätzen korreliert. Historisch gesehen werden Schwankungen der kurzfristigen Zinssätze von der Geldpolitik der Regierung und der zunehmenden Nachfrage des Marktes beeinflusst. Der U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund unterliegt einem Ertragsrisiko, das in der Möglichkeit besteht, dass Erträge aufgrund sinkender Zinssätze geschmälert werden. Da der Ertrag des U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund auf kurzfristigen Zinssätzen basiert, ist das Ertragsrisiko hoch.

Unter Einhaltung der Gesellschaftsrichtlinie überwacht der Investment-Manager täglich das Zinsprofil der Fonds und erstattet dem Verwaltungsrat vierteljährlich Bericht.

Management des Marktrisikos (einschliesslich des Marktpreis-, Fremdwährungs- und Zinsrisikos). Der Investment-Manager überprüft täglich die Merkmale des Portfolios, wie z. B. die Sektoraufteilung, die Fälligkeit und die Bonität, und nimmt, wenn erforderlich, Anpassungen vor, um sicherzustellen, dass die Risikokomponenten der Fonds ziemlich genau mit denen der entsprechenden Referenzindizes übereinstimmen. Weitere Details bezüglich dieser Merkmale finden Sie in den Abschnitten der „Fondsprofile“. Des Weiteren überprüfen der Investment-Manager und die Verwaltungsstelle täglich die Wertentwicklung der einen Index nachbildenden Fonds gegenüber den entsprechenden Referenzindizes. Mögliche Tracking Errors werden erkannt und vom Investment-Manager und der Verwaltungsstelle besprochen, um Nachforschungen durchzuführen und Lösungen zu finden. Markteinflüsse, Währungsdiskrepanzen und Zinsrisiken werden als mögliche Ursachen untersucht. Der Investment-Manager überwacht auch den Anlagestil und die Bestände der aktiv verwalteten Fonds, um sicherzugehen, dass die Anlageberater die Anlagemandate erfüllen. Der Investment-Manager überprüft überdies täglich das Fremdwährungsrisiko des Fonds. Die Devisenpositionen eines Fonds werden täglich mit dem Portfoliomanager abgestimmt und Diskrepanzen sofort behoben. Mit dem Investment-Manager werden Verfahren erstellt, um Devisen so nah wie möglich am Handelsschluss des Marktes zu handeln, um Wechselkurse zu erhalten, die den für die Bewertung des Fonds verwendeten Wechselkursen so weit wie möglich entsprechen.

Sensibilitätsanalyse der Marktrisiken. Die mit den Fonds verbundenen Marktrisiken werden durch die Value-at-Risk-(VaR)-Methode berechnet. Diese schätzt den maximal zu erwartenden Verlust in einem bestimmten Zeitraum für ein gegebenes Sicherheitsniveau. Die VAR-Methode ist ein statistisch definierter, wahrscheinlichkeitsbasierter Ansatz, der Schätzungen der Konjunkturschwankungen und Korrelationen zwischen Vermögenswerten im Portfolio berücksichtigt. Die Risiken für Märkte und Produkte können konsistent gemessen und Risikomassnahmen zusammengefasst werden, um eine einfache Risikozahl zu erhalten. Für diesen Jahresbericht wurde für jeden Fonds nachträglich eine historische absolute VaR-Berechnung über ein Jahr durchgeführt, wie im Folgenden dargelegt. Die Berechnung beinhaltet ein Konfidenzintervall von 95 % bei einer VaR-Periode von 260 Handelstagen (ein Jahr), bzw. seit der Auflegung des Fonds, wenn er keine Wertentwicklung von 260 Handelstagen hat. Das bedeutet, dass der Wert des Fondsvermögens unter normalen Marktbedingungen und der Annahme eines gleich bleibenden Fondsbesitzes mit einer Wahrscheinlichkeit von 95 % in einem Einjahreszeitraum keinen grösseren Verlust als den berechneten Wert erleiden wird.

	31. Dezember 2017	31. Dezember 2016
Emerging Markets Stock Index Fund	14,51 %	26,88 %
European Stock Index Fund	13,41 %	28,40 %
Eurozone Stock Index Fund	14,41 %	30,44 %
Global Enhanced Equity Fund	8,94 %	19,69 %
Global Small-Cap Index Fund	10,20 %	22,17 %
Global Stock Index Fund	7,55 %	19,05 %
Japan Stock Index Fund	17,13 %	35,92 %
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	17,97 %	26,42 %
SRI European Stock Fund	12,24 %	29,94 %
SRI Global Stock Fund	6,93 %	18,57 %
U.S. 500 Stock Index Fund	8,28 %	20,00 %
U.S. Discoveries Fund ¹	—	31,93 %
U.S. Fundamental Value Fund	13,88 %	31,84 %
U.S. Opportunities Fund	15,76 %	27,60 %
20+ Year Euro Treasury Index Fund	18,16 %	20,72 %
Euro Government Bond Index Fund	5,65 %	5,39 %
Euro Investment Grade Bond Index Fund	3,96 %	2,83 %
Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund	6,22 %	7,05 %
Global Bond Index Fund	3,75 %	3,76 %
Global Corporate Bond Index Fund ²	2,61 %	—
Global Credit Bond Fund ³	2,34 %	—
Global Short-Term Bond Index Fund	1,15 %	1,31 %
Global Short-Term Corporate Bond Index Fund ²	1,21 %	—
Japan Government Bond Index Fund	2,78 %	4,92 %
SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund ⁴	2,67 %	—
U.K. Government Bond Index Fund	10,70 %	12,53 %
U.K. Investment Grade Bond Index Fund	7,83 %	8,26 %
U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund	3,02 %	1,84 %
U.S. Government Bond Index Fund	4,64 %	5,56 %
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	4,91 %	4,88 %
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund	3,97 %	7,02 %
U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund	0,04 %	0,07 %

1 Der Fonds wurde am 23. Mai 2017 liquidiert.

2 Der Fonds wurde am 2. November 2017 aufgelegt.

3 Der Fonds wurde am 14. September 2017 aufgelegt.

4 Der Fonds wurde am 18. Juli 2017 aufgelegt.

Das globale Engagement wird durch den Commitment-Ansatz gemessen, der die gesamte Zusammensetzung des Portfolios berücksichtigt. Der Investment-Manager beaufsichtigt die aufsichtsrechtlich vorgegebenen Grenzen, die für das Portfolio geeignet sein können.

Der Einsatz von Derivaten kann mit einem höheren Risiko für die Fonds verbunden sein. Im Besonderen können Derivatgeschäfte starken Schwankungen unterliegen und die Höhe des Originaleinschusses ist allgemein gering im Vergleich zum Umfang des Kontrakts, sodass das Marktrisiko für Transaktionen mit einer Hebelwirkung steigen und sinken kann. Eine relativ geringe Konjunkturänderung kann auf Derivate einen potenziell höheren Effekt haben als auf Standardwertpapiere. Derivative Positionen mit Hebelwirkung können daher die Volatilität eines Fonds erhöhen. Die Hebelwirkung wird auf Grundlage des Bruttoengagements berechnet, indem die Summe der Nennwerte der von einem Fonds eingesetzten Derivate ohne Netting genommen wird, und wird als Prozentsatz des Nettoinventarwerts ausgedrückt. Bestimmte Fonds können in begrenztem Umfang Index-Terminkontrakte einsetzen, um ein volles Engagement am Aktienmarkt zu erreichen, liquide zu bleiben und Transaktionskosten zu minimieren. Nach Ansicht des Verwaltungsrats haben die Fonds im Jahresverlauf keine nennenswerten Hebelwirkung eingesetzt.

Liquiditätsrisiko. Alle finanziellen Verbindlichkeiten können innerhalb eines Monats realisiert werden, es sei denn, die Aufstellung der Kapitalanlagen besagt etwas anderes. Wie bereits erwähnt, investieren einige Fonds in Futures-Kontrakte, um das volle Engagement im Markt aufrechtzuerhalten. Einige dieser Futures-Kontrakte werden mehr als einen Monat nach dem Datum dieses Jahresabschlusses fällig. Dieses Engagement ist jedoch ohne Bedeutung für die Anlagestrategie des Fonds.

Management des Liquiditätsrisikos. Der Investment-Manager erhält täglich von der Verwaltungsstelle Berichte über die Kapitalbeteiligungsaktivität, die ihn in die Lage versetzen, Barmittel aus dem Portfolio des Fonds zu beschaffen, um Rücknahmeanträgen zu entsprechen. Des Weiteren überwacht der Investment-Manager täglich den Marktwert aller Finanzderivate, um sicherzustellen, dass dieses marktberichtigte Engagement die entsprechend beabsichtigten Ergebnisse erzielt. Die Abrechnungstermine der Termingeschäfte, Futures, Swaps und Optionen werden überwacht und die entsprechenden Verbindlichkeiten in die täglichen Barmittelprognosen aufgenommen. Für den Investment-Manager sind die Barmittelprognosen ein Teil des täglichen Portfoliomanagements. Die Kassenbestände der Fonds werden täglich vom Investment-Manager und der Verwaltungsstelle überwacht. In Einklang mit der Unternehmenspolitik der Gesellschaft überwacht der Investment-Manager täglich die Liquiditätsposition der Fonds und erstattet dem Verwaltungsrat vierteljährlich Bericht darüber.

Kreditrisiko. Das Kreditrisiko ist das Risiko, dass der Kontrahent eines Geschäfts oder der Emittent eines Finanzinstruments Zinsen und Kapital nicht rechtzeitig zahlt oder dass die negative Wahrnehmung der Fähigkeit eines Emittenten, solche Zahlungen zu leisten, zu einem Rückgang des Kurses der entsprechenden Anleihe führt. Transaktionen in Verbindung mit dem Kreditrisiko umfassen auch das Platzen von Termineinlagen oder das Eingehen von Derivatkontrakten. Das Kreditrisiko ist in der Regel für jene Fonds beträchtlicher, die vornehmlich in Schuldtitel investieren oder die in erheblichem Umfang ausserbörslich gehandelte Derivatkontrakte nutzen. Die folgenden Fonds sind einem Kreditrisiko ausgesetzt, das darin besteht, dass der Emittent eines Wertpapiers möglicherweise nicht in der Lage ist, die Zinsen und das Kapital rechtzeitig zurückzuzahlen.

Fonds	Fonds
Vanguard 20+ Year Euro Treasury Index Fund	Vanguard Japan Government Bond Index Fund
Vanguard Euro Government Bond Index Fund	Vanguard SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund
Vanguard Euro Investment Grade Bond Index Fund	Vanguard U.K. Government Bond Index Fund
Vanguard Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund	Vanguard U.K. Investment Grade Bond Index Fund
Vanguard Global Bond Index Fund	Vanguard U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund
Vanguard Global Corporate Bond Index Fund	Vanguard U.S. Government Bond Index Fund
Vanguard Global Credit Bond Fund	Vanguard U.S. Investment Grade Credit Index Fund
Vanguard Global Short-Term Bond Index Fund	Vanguard U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund
Vanguard Global Short-Term Corporate Bond Index Fund	Vanguard U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund

Der Global Credit Bond Fund investiert in Credit Default Swaps. Mit dem Einsatz von Credit Default Swaps ist das Risiko verbunden, dass ein Verlust aufgrund eines Zahlungsausfalls des Kontrahenten oder anderweitiger Verstösse gegen die Vertragsbedingungen eintritt. Kontrahenten dieser Transaktionen müssen daher Sicherheiten in Form von Barmitteln oder Wertpapieren stellen, um die Gesellschaft und den entsprechenden Fonds vor dem Risiko eines Ausfalls des Kontrahenten zu schützen.

Alle Vermögenswerte der Gesellschaft werden im Wesentlichen von der Verwahrstelle gehalten. Sollte die Verwahrstelle zahlungsunfähig werden, kann dies die Ansprüche der Gesellschaft im Hinblick auf von der Verwahrstelle gehaltene Wertpapiere und andere Positionen verzögern oder einschränken. Zum 31. Dezember 2017 verfügt die Verwahrstelle über ein langfristiges Kreditrating von A+ von Fitch (31. Dezember 2016: A+).

Die Wertpapiere und anderen Positionen der Gesellschaft sind vom Vermögen ihrer Verwahrstelle bzw. deren Bevollmächtigten getrennt. Im Falle einer Insolvenz oder eines Bankrotts der Verwahrstelle ist das Vermögen der Gesellschaft somit vom Vermögen ihrer Verwahrstelle bzw. deren Bevollmächtigten getrennt. Die Gesellschaft ist im Zusammenhang mit ihren von der Depotbank gehaltenen Barmitteln dennoch dem Kreditrisiko der Depotbank oder der Hinterlegungsstellen, auf die diese zurückgreift, ausgesetzt. Bei Konkurs oder Zahlungsunfähigkeit der Verwahrstelle wird die Gesellschaft im Hinblick auf ihre Barpositionen als allgemeiner Gläubiger der Verwahrstelle behandelt.

Einzelheiten zu den Beständen der Fonds als Prozentsatz des Nettovermögens sind in der Aufstellung der Kapitalanlagen aufgeführt. Einzelheiten zur durchschnittlichen Kreditqualität der Kapitalanlagen im Besitz dieser Fonds sind im Fondsprofil aufgeführt.

Management des Kreditrisikos. Der Investment-Manager überprüft täglich die Merkmale des Portfolios, wie z. B. die Sektoraufteilung und Bonität, und nimmt, wenn erforderlich, Anpassungen vor, um sicherzustellen, dass die Kreditrisikokomponenten der Fonds ziemlich genau mit denen der entsprechenden Referenzindizes übereinstimmen. Ferner führt der Investment-Manager im Rahmen der täglichen Kontrollen der Anlagebeschränkungen Tests zur Bonitätsbewertung von Schuldinstrumenten durch. Die Bonitätsratings der Kontrahenten werden in regelmässigen Abständen vom Investment-Manager beurteilt; eine zugelassene Kontrahentenliste wird aktualisiert und der Handel mit zugelassenen Kontrahenten nachdrücklich vorgeschrieben.

Angaben zur Zeitwerthierarchie. Gemäss FRS 102, „Finanzinstrumente: Offenlegung“ hat der Fonds die nachstehenden finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in Ebene 1, Ebene 2 und Ebene 3 klassifiziert.

FRS 102, Paragraph 11.27 über Angaben zum beizulegenden Zeitwert erfordert Angaben zur Zeitwerthierarchie, in der die Bewertungen des beizulegenden Zeitwerts für die finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten kategorisiert werden. Die Offenlegungen beruhen auf einer dreistufigen Zeitwerthierarchie für die Eingabedaten, die zur Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts verwendet werden.

Ebene 1 – basierend auf Börsenkursen (unbereinigt) in aktiven Märkten für identische Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten: Aktien und Terminkontrakte.

Ebene 2 – basierend auf anderen Inputs als den Börsenkursen in Ebene 1, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit entweder direkt (als Kurse) oder indirekt (von Kursen abgeleitet) beobachtbar sind: Anleihen, Diskontpapiere und Devisenterminkontrakte.

Ebene 3 – basierend auf Inputs für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit, die nicht auf beobachtbaren Marktdaten basieren (nicht beobachtbare Daten).

Die folgenden Tabellen zeigen eine Analyse innerhalb der Hierarchie der beizulegenden Zeitwerte der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Gesellschaft, die zum beizulegenden Zeitwert am 31. Dezember 2017 und 31. Dezember 2016 berechnet werden:

Fair-Value-Bewertung zum 31. Dezember 2017:	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Summe
Emerging Markets Stock Index Fund	USD	10.338.892.409	208.718.023	566.103	10.548.176.535
European Stock Index Fund	USD	5.226.674.828	57.151.382	594	5.283.826.804
Eurozone Stock Index Fund	EUR	1.713.260.746	26.575.717	—	1.739.836.463
Global Enhanced Equity Fund	USD	238.799.585	(131.403)	75	238.668.257
Global Small-Cap Index Fund	USD	1.423.612.384	1.133.187	370.280	1.425.115.851
Global Stock Index Fund	USD	10.759.789.312	32.429.599	272	10.792.219.183
Japan Stock Index Fund	EUR	3.379.964.653	(384.495)	—	3.379.580.158
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	EUR	2.758.573.598	3.073.748	—	2.761.647.346
SRI European Stock Fund	EUR	576.215.133	9.497.905	211	585.713.249
SRI Global Stock Fund	USD	649.997.480	2.405.761	25.496	652.428.737
U.S. 500 Stock Index Fund	USD	6.371.418.663	730.620	—	6.372.149.283
U.S. Fundamental Value Fund	USD	33.313.111	—	—	33.313.111
U.S. Opportunities Fund	USD	2.527.663.723	—	5.626.280	2.533.290.003
20+ Year Euro Treasury Index Fund	EUR	—	517.736.790	—	517.736.790
Euro Government Bond Index Fund	EUR	57.420	4.727.993.062	—	4.728.050.482
Euro Investment Grade Bond Index Fund	EUR	(1.660)	2.028.958.474	—	2.028.956.814
Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund	EUR	—	1.685.184.056	—	1.685.184.056
Global Bond Index Fund	USD	(99.661)	9.351.980.774	—	9.351.881.113
Global Corporate Bond Index Fund ¹	USD	7.057	333.021.031	—	333.028.088
Global Credit Bond Fund ²	USD	(46.296)	58.713.820	—	58.667.524
Global Short-Term Bond Index Fund	USD	(37.350)	1.353.091.724	—	1.353.054.374
Global Short-Term Corporate Bond Index Fund ³	USD	1.141	108.651.439	—	108.652.580
Japan Government Bond Index Fund -	JPY	150.000	141.189.869.915	—	141.190.019.915
SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund ⁴	EUR	(580)	133.481.090	—	133.480.510
U.K. Government Bond Index Fund	GBP	12.840	2.183.906.362	—	2.183.919.202
U.K. Investment Grade Bond Index Fund -	GBP	(3.160)	2.575.123.182	—	2.575.120.022
U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund	GBP	(1.580)	1.418.669.721	—	1.418.668.141
U.S. Government Bond Index Fund	USD	—	1.757.584.365	—	1.757.584.365
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	USD	(6.518)	1.973.679.918	—	1.973.673.400
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund	USD	—	2.269.723.417	—	2.269.723.417
U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund	USD	—	101.917.891	—	101.917.891

1 Der Fonds wurde am 2. November 2017 aufgelegt.

2 Der Fonds wurde am 14. September 2017 aufgelegt.

3 Der Fonds wurde am 2. November 2017 aufgelegt.

4 Der Fonds wurde am 18. Juli 2017 aufgelegt.

Fair-Value-Bewertung zum 31. Dezember 2016:	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Summe
Emerging Markets Stock Index Fund	USD	7.087.308.668	118.119.067	545.161	7.205.972.896
European Stock Index Fund	USD	4.878.492.365	41.311.556	73.154	4.919.877.075
Eurozone Stock Index Fund	EUR	1.304.894.668	—	2.173	1.304.896.841
Global Enhanced Equity Fund	USD	159.616.815	(183.306)	103	159.433.612
Global Small-Cap Index Fund	USD	914.775.773	462.820	206.334	915.444.927
Global Stock Index Fund	USD	8.904.571.235	53.891.803	29.991	8.958.493.029
Japan Stock Index Fund	EUR	2.396.939.693	2.047.814	—	2.398.987.507
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	EUR	1.755.721.374	362.004	—	1.756.083.378
SRI European Stock Fund	EUR	786.114.611	7.770.274	18.467	793.903.352
SRI Global Stock Fund	USD	720.791.129	1.960.522	5.933	722.757.584
U.S. 500 Stock Index Fund	USD	5.392.425.116	5.114.060	—	5.397.539.176
U.S. Discoveries Fund	USD	147.239.918	47.935	99.096	147.386.949
U.S. Fundamental Value Fund	USD	30.234.643	—	—	30.234.643
U.S. Opportunities Fund	USD	2.102.077.002	—	3.122.585	2.105.199.587
20+ Year Euro Treasury Index Fund	EUR	—	714.765.192	—	714.765.192
Euro Government Bond Index Fund	EUR	(82.200)	4.331.196.569	—	4.331.114.369
Euro Investment Grade Bond Index Fund	EUR	(122.894)	2.218.221.109	—	2.218.098.215

Fair-Value-Bewertung zum 31. Dezember 2016 anhand:	Währung	Ebene 1	Ebene 2	Ebene 3	Summe
Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund	EUR	—	1.501.183.063	—	1.501.183.063
Global Bond Index Fund	USD	55.695	6.236.969.096	—	6.237.024.791
Global Short-Term Bond Index Fund	USD	(24.994)	1.019.267.832	—	1.019.242.838
Japan Government Bond Index Fund -	JPY	—	110.194.799.789	—	110.194.799.789
U.K. Government Bond Index Fund	GBP	—	1.579.053.483	—	1.579.053.483
U.K. Investment Grade Bond Index Fund -	GBP	—	2.060.643.449	—	2.060.643.449
U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund	GBP	—	1.329.401.934	—	1.329.401.934
U.S. Government Bond Index Fund	USD	—	1.334.632.924	—	1.334.632.924
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	USD	(65.242)	1.569.865.765	—	1.569.800.523
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund	USD	—	1.550.074.369	—	1.550.074.369
U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund	USD	—	77.032.921	—	77.032.921

5. Besteuerung. Die Gesellschaft gilt laut gegenwärtigem Recht und Praxis als ein Anlageorganismus gemäss Paragraph 739B des Taxes Consolidation Act (Steuerkonsolidierungsgesetz) von 1997 in aktueller Fassung. Vanguard Investment Series plc ist in Irland von der Einkommens- und Kapitalertragsteuer befreit.

Bei Eintritt eines „zu besteuernenden Ereignisses“ können jedoch irische Steuern fällig werden. Ein Steuerereignis umfasst Ausschüttungen an Anteilinhaber, Einlösungen, Rücknahmen, Tilgungen oder Übertragungen von Anteilen sowie den Besitz an Anteilen zum Ende jedes Achtjahreszeitraums, der mit dem Erwerb entsprechender Anteile beginnt.

Die Gesellschaft ist in Irland bei Eintritt eines zu besteuernenden Ereignisses in Bezug auf Folgendes nicht steuerpflichtig:

- (a) einen Anteilinhaber, der zu Steuerzwecken zum Zeitpunkt des zu besteuernenden Ereignisses weder in Irland ansässig ist noch seinen gewöhnlichen Aufenthaltsort dort hat, sofern der Gesellschaft eine passende gültige Erklärung im Einklang mit den Vorschriften des Taxes Consolidation Act von 1997 in aktueller Fassung vorliegt oder die Gesellschaft durch die Irish Revenue dazu befugt ist, in Ermangelung passender Erklärungen Bruttozahlungen zu leisten; und
- (b) gewisse steuerbefreite in Irland ansässige Anteilinhaber, die der Gesellschaft die erforderlichen unterschriebenen Erklärungen vorgelegt haben.

Durch Anlagen erhaltene Dividenden, Zinsen und Kapitalgewinne, die die Gesellschaft erwirtschaftet hat, können Steuern unterliegen, die von dem Land auferlegt werden, von dem sie erhalten werden, und diese Steuern können der Gesellschaft bzw. deren Anteilhabern unter Umständen nicht erstattet werden.

6. Ausschüttungspolitik. Der Verwaltungsrat kann in Bezug auf alle Anteile Dividenden ausschütten. Die folgende Tabelle zeigt die Häufigkeit der Ausschüttungen in Bezug auf ausschüttende Anteilklassen der folgenden Fonds. Wenn keine Dividende ausgeschüttet wurde, werden die Erträge und Gewinne dieses Fonds im Nettoinventarwert je Anteil berücksichtigt.

Fonds	Dividende	Fonds	Dividende
European Stock Index Fund	Nicht erklärt	SRI European Stock Fund	Vierteljährlich
Eurozone Stock Index Fund	Nicht erklärt	SRI Global Stock Fund	Vierteljährlich
Global Enhanced Equity Fund	Nicht erklärt	Global Bond Index Fund	Vierteljährlich
Global Stock Index Fund	Nicht erklärt	Global Short-Term Bond Index Fund	Vierteljährlich
U.S. 500 Stock Index Fund	Nicht erklärt	Japan Government Bond Index Fund -	Vierteljährlich
20+ Year Euro Treasury Index Fund	Nicht erklärt	U.K. Government Bond Index Fund	Vierteljährlich
Euro Government Bond Index Fund	Nicht erklärt	U.K. Investment Grade Bond Index Fund -	Vierteljährlich
Euro Investment Grade Bond Index Fund	Nicht erklärt	U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund	Vierteljährlich
Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund	Nicht erklärt	U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Vierteljährlich
Global Credit Bond Fund	Nicht erklärt	U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund	Vierteljährlich
Global Corporate Bond Index Fund	Nicht erklärt	Emerging Markets Stock Index Fund	Jährlich
Global Short-Term Corporate Bond Index Fund	Nicht erklärt	Japan Stock Index Fund	Jährlich
SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund	Nicht erklärt	Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Jährlich
U.S. Government Bond Index Fund	Vierteljährlich	U.S. Fundamental Value Fund	Jährlich
Global Small-Cap Index Fund	Vierteljährlich		

Die folgenden Fonds verfügten über keine ausschüttungsfähigen Erträge.

Fonds
U.S. Discoveries Fund
U.S. Opportunities Fund

Für den Vanguard U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund wurden Dividenden täglich erklärt und am Ende des entsprechenden Kalendermonats in Form von zusätzlichen ganzen und anteiligen Anteilen ausgeschüttet, sofern ein Anteilinhaber nicht gewählt hat, dass Dividenden in bar ausgeschüttet werden sollen. In diesem Fall geschieht die Ausschüttung über telegrafische Überweisung auf das Konto, das vom Anteilinhaber in der Zeichnungsvereinbarung hinterlegt wurde, um den ersten Geschäftstag des nächsten Kalendermonats.

Die Dividenden für ausschüttende Anteilklassen für das Jahr zum 31. Dezember 2017 können der nachstehenden Tabelle entnommen werden.

	Daten der Dividendenzahlung			
	31. März 2017	30. Juni 2017	29. September 2017	29. Dezember 2017
Emerging Markets Stock Index Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	—	—	—	£ 3,5832
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	—	—	—	£ 2,4536
Global Small-Cap Index Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	£ 0,8635	£ 1,1041	£ 0,6741	£ 0,5679
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	£ 0,5571	£ 0,7055	£ 0,4410	£ 0,3781
Japan Stock Index Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	—	—	—	£ 3,0866
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	—	—	—	£ 2,4429
Pacific ex-Japan Stock Index Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	—	—	—	£ 8,6357
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	—	—	—	£ 5,1153
SRI European Stock Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	£ 1,0235	£ 2,3976	£ 0,5770	£ 0,4090
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	£ 0,8306	£ 1,9124	£ 0,4802	£ 0,3545
SRI Global Stock Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	£ 0,8193	£ 1,1355	£ 0,7768	£ 0,5602
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	£ 0,6232	£ 0,8451	£ 0,5809	£ 0,4356
U.S. Fundamental Value Fund				
GBP-Anlegeranteile (£)	—	—	—	£ 1,1858
Global Bond Index Fund				
Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)	£ 0,5384	£ 0,5355	£ 0,5270	£ 0,5467
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)	£ 0,4249	£ 0,4312	£ 0,4205	£ 0,4359
Global Short-Term Bond Index Fund				
Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)	£ 0,2153	£ 0,2222	£ 0,2257	£ 0,2324
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)	£ 0,2256	£ 0,2325	£ 0,2357	£ 0,2428
Japan Government Bond Index Fund -				
Institutionelle Plus JPY-Ertragsanteile (¥)	¥ 5,0785	¥ 5,0516	¥ 4,5414	¥ 4,9686
U.K. Government Bond Index Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	£ 0,4819	£ 0,4536	£ 0,4367	£ 0,4311
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	£ 0,4398	£ 0,4163	£ 0,4014	£ 0,3963
U.K. Investment Grade Bond Index Fund -				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	£ 0,3787	£ 0,3919	£ 0,3743	£ 0,3693
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	£ 0,7273	£ 0,7526	£ 0,7198	£ 0,7106
U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	£ 0,3417	£ 0,3581	£ 0,3264	£ 0,3297
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	£ 0,3673	£ 0,3841	£ 0,3524	£ 0,3557
U.S. Government Bond Index Fund				
GBP-Anlegeranteile (£)	—	—	—	£ 0,0205
U.S. Investment Grade Credit Index Fund				
Institutionelle Plus USD-Ertragsanteile (\$)	\$ 0,7968	\$ 0,8071	\$ 0,8098	\$ 0,8270
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)	£ 0,7514	£ 0,7539	£ 0,7467	£ 0,7738
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund				
Select USD-Ertragsanteile (\$)	\$ 0,3514	\$ 0,6238	\$ 0,0793	\$ 0,8397
Select-Ertragsanteile, abgesichert in CHF	CHF 0.3453	CHF 0.5991	CHF 0.0793	CHF 1.1932
Select-Ertragsanteile, abgesichert in EUR (€)	€ 0.3469	€ 0.5938	€ 0.0767	€ 0.7796
Select-Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)	£ 0,3455	£ 0,6070	£ 0,0747	£ 0,7862

Die Dividenden für den Ultra-Short-Term Bond Fund für das Jahr 2017 können der nachstehenden Tabelle entnommen werden.

	Stichtag											
	31. Jan. 2017	28. Feb. 2017	31. Mär. 2017	28. Apr. 2017	31. Mai 2017	30. Jun. 2017	31. Jul. 2017	31. Aug. 2017	29. Sep. 2017	31. Okt. 2017	30. Nov. 2017	29. Dez. 2017
U.S. Ultra-Short-Term Bond Index Fund												
Institutionelle USD-Anteile (\$)	\$ 0,00531	\$ 0,00525	\$ 0,00647	\$ 0,00598	\$ 0,00691	\$ 0,00784	\$ 0,00769	\$ 0,00831	\$ 0,00847	\$ 0,00847	\$ 0,00890	\$ 0,00994
USD-Anlegeranteile (\$)	\$ 0,00491	\$ 0,00486	\$ 0,00602	\$ 0,00560	\$ 0,00649	\$ 0,00741	\$ 0,00729	\$ 0,00788	\$ 0,00804	\$ 0,00806	\$ 0,00849	\$ 0,00952

Die Vergleichszahlen vom 31. Dezember 2016 lauten wie folgt:

	Daten der Dividendenzahlung			
	31. März 2016	30. Juni 2016	30. September 2016	30. Dezember 2016
Emerging Markets Stock Index Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	—	—	—	£ 3,4679
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	—	—	—	£ 2,3722
Global Small-Cap Index Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	£ 0,7103	£ 0,9319	£ 0,7139	£ 0,5921
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	£ 0,4554	£ 0,5898	£ 0,4670	£ 0,3896
Japan Stock Index Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	—	—	—	£ 2,9184
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	—	—	—	£ 2,2905
Pacific ex-Japan Stock Index Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	—	—	—	£ 6,9075
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	—	—	—	£ 3,5456
SRI European Stock Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	£ 0,7048	£ 2,3831	£ 0,5559	£ 0,3719
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	£ 0,5757	£ 1,8850	£ 0,4629	£ 0,3180
SRI Global Stock Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	£ 0,6773	£ 1,1199	£ 0,6586	£ 0,6386
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	£ 0,5091	£ 0,8279	£ 0,5016	£ 0,4881
U.S. Fundamental Value Fund				
GBP-Anlegeranteile (£)	—	—	—	£ 1,5868
Global Bond Index Fund				
Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)	£ 0,5770	£ 0,5738	£ 0,5588	£ 0,5344
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)	£ 0,4592	£ 0,4577	£ 0,4472	£ 0,4287
Global Short-Term Bond Index Fund				
Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)	£ 0,2437	£ 0,2242	£ 0,2247	£ 0,2087
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)	£ 0,2529	£ 0,2299	£ 0,2276	£ 0,2179
Japan Government Bond Index Fund -				
Institutionelle Plus JPY-Ertragsanteile (¥)	¥ 11,6158	¥ 9,3197	¥ 6,4439	¥ 5,6620
U.K. Government Bond Index Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	£ 0,5481	£ 0,6249	£ 0,5196	£ 0,4996
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	£ 0,4959	£ 0,5608	£ 0,4755	£ 0,4554
U.K. Investment Grade Bond Index Fund -				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	£ 0,4240	£ 0,4047	£ 0,4063	£ 0,3915
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	£ 0,8104	£ 0,7753	£ 0,8092	£ 0,7515
U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund				
Ausschüttende GBP-Anteile (£)	£ 0,5055	£ 0,4169	£ 0,3799	£ 0,3486
Institutionelle Plus-GBP-Ertragsanteile (£)	£ 0,5312	£ 0,4585	£ 0,4070	£ 0,3745
U.S. Investment Grade Credit Index Fund				
Institutionelle Plus USD-Ertragsanteile (\$)	\$ 0,8203	\$ 0,7912	\$ 0,7989	\$ 0,7969
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)	—	—	£ 0,0716	£ 0,7758
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund¹				
Select USD-Ertragsanteile (\$)	—	—	—	\$ 0,3458
Select-Ertragsanteile, abgesichert in CHF	—	—	—	CHF 0.3523
Select-Ertragsanteile, abgesichert in EUR (€)	—	—	—	€ 0.3497
Select-Ertragsanteile, abgesichert in GBP (£)	—	—	—	£ 0,3501

¹ Der Fonds wurde am 24. Oktober 2016 aufgelegt.

Die Dividenden für den Ultra-Short-Term Bond Fund für das Jahr 2016 können der nachstehenden Tabelle entnommen werden.

	Stichtag											
	29. Jan. 2016	29. Feb. 2016	31. Mär. 2016	29. Apr. 2016	31. Mai 2016	30. Jun. 2016	29. Jul. 2016	31. Aug. 2016	30. Sep. 2016	31. Okt. 2016	30. Nov. 2016	30. Dez. 2016
U.S. Ultra-Short-Term Bond Index Fund												
Institutionelle USD-Anteile (\$)	\$ 0,00294	\$ 0,00319	\$ 0,00364	\$ 0,00386	\$ 0,00013	\$ 0,00014	\$ 0,00429	\$ 0,00437	\$ 0,00441	\$ 0,00597	\$ 0,00399	\$ 0,00546
USD-Anlegeranteile (\$)	\$ 0,00251	\$ 0,00282	\$ 0,00322	\$ 0,00344	\$ 0,00012	\$ 0,00013	\$ 0,00387	\$ 0,00395	\$ 0,00400	\$ 0,00554	\$ 0,00358	\$ 0,00504

7. Kassenbestände. Alle Kassenbestände sind bei der Depotbank hinterlegt. Barbeträge waren bei Kontrahenten von Termin- und Swap-Kontrakten als Originaleinschuss- und/oder Nachschusszahlungen hinterlegt. Der Einsatz von Futures und Swap-Kontrakten wird in Erläuterung 3, Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze, näher erläutert.

Der Global Credit Bond Fund hielt zum 31. Dezember 2017 Futures und Swap-Kontrakte. Die folgende Tabelle zeigt die Überleitung der Bareinschüsse für diesen Fonds:

	US Dollar (\$) Zum 31. Dezember 2017
Global Credit Bond Fund	
Futures-Einschuss	32.803
Swap-Einschuss	101.191
	133.994

Der Global Credit Bond Fund wurde am 14. September 2017 aufgelegt.

Alle übrigen Fonds hielten nur Einschüsse für Futures.

8. Anteilskapital. Die Gesellschaft verfügt über ein variables Anteilskapital. Das genehmigte Anteilskapital der Gesellschaft besteht aus 500.000.030.000 nennwertlosen Anteilen, die in 30.000 nennwertlose Zeichneranteile und 500.000.000.000 zurücknehmbare gewinnberechtigte Anteile ohne Nennwert aufgeteilt wurden. Die Anzahl der zurücknehmbaren gewinnberechtigten Anteile, die für jede Klasse zum 31. Dezember 2017 ausgegeben wurden, ist in der Tabelle zum Nettoinventarwert je Anteil angegeben. Die Bewegungen im Kapital sind in den Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens für jeden Fonds und die Gesellschaft aufgeschlüsselt. Zurücknehmbare gewinnberechtigte Anteile können nach Wahl des Anteilinhabers zurückgenommen werden und werden als finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert.

Die Bewegungen der Anteile für das am 31. Dezember 2017 zu Ende gegangene Halbjahr sind nachstehend aufgeführt:

	Emerging Markets Stock Index Fund	European Stock Index Fund	Eurozone Stock Index Fund	Global Enhanced Equity Fund
Stand zu Jahresbeginn	50.064.116	227.243.450	8.246.119	1.072.100
Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile				
Institutionelle Anteile	7.439.279	41.510.321	959.715	301.460
Anlegeranteile	1.254.142	3.074.422	113.295	—
Thesaurierende Anteile	3.454.630	—	—	—
Ausschüttende Anteile	1.057.753	—	—	—
Institutionelle Plus-Anteile	12.419.974	3.345.083	5.283.977	—
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile	769.907	—	—	—
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	257.129	—	—	—
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile				
Institutionelle Anteile	(3.278.492)	(73.063.040)	(1.575.172)	(89.111)
Anlegeranteile	(3.341.015)	(2.462.791)	(88.224)	—
Thesaurierende Anteile	(3.191.363)	—	—	—
Ausschüttende Anteile	(2.400.959)	—	—	—
Institutionelle Plus-Anteile	(10.092.970)	(4.103.186)	(2.254.752)	—
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile	(64.236)	—	—	—
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	(138.806)	—	—	—
Stand am Jahresende	54.209.089	195.544.259	10.684.958	1.284.449

	Global Small-Cap Index Fund	Global Stock Index Fund	Japan Stock Index Fund	Pacific ex-Japan Stock Index Fund
Stand zu Jahresbeginn	4.068.530	380.591.538	13.735.064	9.211.667
Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile				
Institutionelle Anteile	578.094	70.654.714	3.644.667	3.334.027
Anlegeranteile	370.570	4.013.247	310.187	32.737
Thesaurierende Anteile	512.674	—	2.392.777	1.112.913
Ausschüttende Anteile	186.218	—	349.428	179.230
Institutionelle Plus-Anteile	1.114.431	2.068.804	2.433.521	5.102.337
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile	24.700	50	106	33.722
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	46.926	—	22.055	205.779
Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in AUD	—	—	—	59.543
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	—	48.898.168	—	—
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile				
Institutionelle Anteile	(500.548)	(69.702.158)	(1.771.338)	(2.375.909)
Anlegeranteile	(123.956)	(3.648.239)	(180.311)	(23.526)
Thesaurierende Anteile	(278.558)	—	(1.028.817)	(464.493)
Ausschüttende Anteile	(262.494)	—	(890.781)	(477.193)
Institutionelle Plus-Anteile	(240.393)	(4.133.168)	(574.309)	(1.072.194)
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile	(4.526)	—	(6)	(7801)
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	(19.053)	—	(1.554)	(19.368)
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	—	(41.264.617)	—	—
Stand am Jahresende	5.472.615	387.478.339	18.440.689	14.831.471
	SRI European Stock Fund	SRI Global Stock Fund	U.S. 500 Stock Index Fund	U.S. Discoveries Fonds ¹
Stand zu Jahresbeginn	4.698.272	3.841.490	183.903.913	460.202
Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile				
Institutionelle Anteile	776.328	191.296	52.544.620	—
Anlegeranteile	55.402	68.069	7.200.671	24.102
Thesaurierende Anteile	47.435	157.963	—	—
Ausschüttende Anteile	13.626	138.724	—	—
Institutionelle Plus-Anteile	25.238	32.397	2.669.417	—
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	—	—	4.844.560	—
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile	—	10.425	—	—
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile				
Institutionelle Anteile	(2.330.848)	(641.919)	(49.542.928)	—
Anlegeranteile	(46.266)	(36.730)	(5.514.772)	(484.304)
Thesaurierende Anteile	(16.438)	(105.711)	—	—
Ausschüttende Anteile	(3.878)	(86.289)	—	—
Institutionelle Plus-Anteile	(75.576)	(912.475)	(3.672.712)	—
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	(3.814)	—	—	—
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	—	—	(8.607.490)	—
Stand am Jahresende	3.139.481	2.657.240	183.825.279	—

	U.S. Fundamental Value Fund	U.S. Opportunities Fonds	20+ Year Euro Treasury Index Fund	Euro Government Bond Index Fund
Stand zu Jahresbeginn	163.020	3.269.764	3.607.039	23.569.302
Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile				
Institutionelle Anteile	—	425.442	348.654	3.480.536
Anlegeranteile	57.214	199.635	—	192.302
Institutionelle Plus-Anteile	—	—	16.824	4.704.713
Abgesicherte thesaurierende Anteile	—	—	—	960.252
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile				
Institutionelle Anteile	—	(728.127)	(1.315.869)	(2.953.475)
Anlegeranteile	(58.716)	(236.412)	—	(483.048)
Institutionelle Plus-Anteile	—	—	(3.089)	(3.906.238)
Abgesicherte thesaurierende Anteile	—	—	—	(12.119)
Stand am Jahresende	161.518	2.930.302	2.653.559	25.552.225
	Euro Investment Grade Bond Index Fund	Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund	Global Bond Index Fund	Global Corporate Bond Index Fund ²
Stand zu Jahresbeginn	11.392.652	13.139.553	46.597.726	—
Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile				
Institutionelle Anteile	1.511.492	585.248	—	—
Institutionelle Thesaurierungsanteile	—	—	—	50
Anlegeranteile	156.357	213.055	—	—
Institutionelle Plus-Anteile	261.969	3.190.378	—	—
Abgesicherte institutionelle Anteile	—	—	6.128.165	—
Abgesicherte Anlegeranteile	—	—	253.149	—
Abgesicherte thesaurierende Anteile	512.796	—	6.257.339	—
Abgesicherte Ertragsanteile	—	—	1.706.491	—
Abgesicherte institutionelle Plus-Anteile	—	—	13.021.510	—
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	—	—	1.407.374	2.503.451
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	—	—	1.966.794	—
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in GBP	—	—	—	1.143
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile				
Institutionelle Anteile	(2.861.752)	(623.823)	—	—
Anlegeranteile	(118.704)	(94.419)	—	—
Institutionelle Plus-Anteile	(284.196)	(1.854.798)	—	—
Abgesicherte institutionelle Anteile	—	—	(3.749.925)	—
Abgesicherte Anlegeranteile	—	—	(111.522)	—
Abgesicherte thesaurierende Anteile	(3.188)	—	(2.320.008)	—
Abgesicherte Ertragsanteile	—	—	(1.081.874)	—
Abgesicherte institutionelle Plus-Anteile	—	—	(5.492.307)	—
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	—	—	(80.971)	—
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	—	—	(701.202)	—
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in GBP	—	—	—	(5)
Stand am Jahresende	10.567.426	14.555.194	63.800.739	2.504.639

	Global Credit Bond Fund ³	Global Short-Term Bond Index Fund	Global Short-Term Corporate Bond Index Fund ²	Japan Government Bond Index Fund
Stand zu Jahresbeginn	—	8.694.849	—	7.066.548
Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile				
Institutionelle Anteile	—	—	—	2.924.234
Anlegeranteile	—	—	—	56.961
Thesaurierende Anteile	—	—	—	—
Abgesicherte institutionelle Anteile	284.162	1.538.633	—	—
Abgesicherte Anlegeranteile	240.043	173.610	—	—
Abgesicherte thesaurierende Anteile	—	1.417.326	—	410.412
Abgesicherte Ertragsanteile	—	1.392.950	—	—
Institutionelle Thesaurierungsanteile	—	—	50	—
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in CHF	—	409.577	—	—
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	—	63.519	821.702	—
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	—	123.507	—	—
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in GBP	—	—	612	—
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile				
Institutionelle Anteile	—	—	—	(1.659.517)
Anlegeranteile	—	—	—	(28.080)
Abgesicherte institutionelle Anteile	—	(629.132)	—	—
Abgesicherte Anlegeranteile	(960)	(218.481)	—	—
Abgesicherte thesaurierende Anteile	—	(876.211)	—	(3.997)
Abgesicherte Ertragsanteile	—	(1.333.640)	—	—
Institutionelle Plus JPY-Ertragsanteile	—	—	—	(2.200)
Abgesicherte institutionelle Plus-Anteile	—	(136.732)	—	—
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	—	(7.918)	—	—
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	—	(22.096)	—	—
Stand am Jahresende	523.245	10.589.761	822.364	8.764.361

	SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund ⁴	U.K. Government Bond Index Fund	U.K. Investment Grade Bond Index Fund	U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund
Stand zu Jahresbeginn	—	11.295.629	26.129.252	12.679.585
Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile				
Institutionelle Anteile	1.379.578	13.809	—	—
Thesaurierende Anteile	—	7.421.759	8.502.088	4.400.571
Ausschüttende Anteile	—	2.228.882	4.268.806	735.096
Institutionelle Plus-Anteile	50	—	—	—
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile	—	57.215	242.133	516.638
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	—	1.004.868	950.083	158.850
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile				
Institutionelle Anteile	(32.159)	(289.898)	—	—
Thesaurierende Anteile	—	(2.391.351)	(2.100.410)	(939.730)
Ausschüttende Anteile	—	(4.375.318)	(7.062.944)	(643.829)
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile	—	(14.341)	(421.721)	(3.617.887)
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	—	(417.995)	(345.723)	(88.356)
Stand am Jahresende	1.347.469	14.533.259	30.161.564	13.200.938

	U.S. Government Bond Index Fund	U.S. Investment Grade Credit Index Fund	U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund	U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund
Stand zu Jahresbeginn	8.423.058	10.480.566	15.408.225	7.706.539
Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile				
Thesaurierende Anteile	—	—	5.339.207	—
Ausschüttende Anteile	—	—	127.895	—
Institutionelle Anteile	1.328.972	2.647.583	—	2.718.078
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	1.843.723	—	—	—
Anlegeranteile	138.287	191.328	—	1.751.523
Institutionelle Plus-Anteile	1.422.379	4.134.659	—	—
Institutionelle Plus USD-Ertragsanteile	—	55.398	—	—
Abgesicherte thesaurierende Anteile	2.288.449	1.044.643	6.735.242	—
Abgesicherte Ertragsanteile	—	—	453.733	—
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in EUR	—	461.563	—	—
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	—	58.075	—	—
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	—	87.483	—	—
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile				
Thesaurierende Anteile	—	—	(1.748.831)	—
Ausschüttende Anteile	—	—	(131.339)	—
Institutionelle Anteile	(1.688.187)	(4.412.051)	—	(316.176)
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	(945.418)	—	—	—
Anlegeranteile	(150.468)	(115.938)	—	(1.645.842)
Institutionelle Plus-Anteile	(1.224.264)	(527.789)	—	—
Institutionelle Plus USD-Ertragsanteile	—	(6.929)	—	—
Abgesicherte thesaurierende Anteile	(134.130)	(118.103)	(3.759.475)	—
Abgesicherte Ertragsanteile	—	—	(587.577)	—
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in EUR	—	(191.267)	—	—
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	—	(200.129)	—	—
Stand am Jahresende	11.302.401	13.589.092	21.837.080	10.214.122

Die Bewegungen der Anteile für das am 31. Dezember 2016 zu Ende gegangene Halbjahr sind nachstehend aufgeführt:

	Emerging Markets Stock Index Fund	European Stock Index Fund	Eurozone Stock Index Fund	Global Enhanced Equity Fund
Stand zu Jahresbeginn	43.091.592	249.110.896	16.991.259	932.230
Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile				
Institutionelle Anteile	5.875.264	53.552.900	1.449.268	272.048
Anlegeranteile	2.866.271	2.727.980	86.885	—
Thesaurierende Anteile	2.694.657	—	—	—
Ausschüttende Anteile	1.010.364	—	—	—
Institutionelle Plus-Anteile	9.773.669	2.744.058	3.777.354	—
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile	1.199.526	—	—	—
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	292.388	—	—	—
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile				
Institutionelle Anteile	(2.909.742)	(72.297.458)	(3.015.594)	(132.178)
Anlegeranteile	(3.418.268)	(2.821.142)	(59.644)	—
Thesaurierende Anteile	(1.533.663)	—	—	—
Ausschüttende Anteile	(772.315)	—	—	—
Institutionelle Plus-Anteile	(7.784.543)	(5.773.784)	(10.983.409)	—
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile	(198.691)	—	—	—
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	(122.393)	—	—	—
Stand am Jahresende	50.064.116	227.243.450	8.246.119	1.072.100

1 Der Fonds wurde am 23. Mai 2017 liquidiert.

2 Der Fonds wurde am 2. November 2017 aufgelegt.

3 Der Fonds wurde am 14. September 2017 aufgelegt.

4 Der Fonds wurde am 18. Juli 2017 aufgelegt.

	Global Small-Cap Index Fund	Global Stock Index Fund	Japan Stock Index Fund	Pacific ex-Japan Stock Index Fund
Stand zu Jahresbeginn	2.902.621	414.375.526	12.634.784	6.312.020
Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile				
Institutionelle Anteile	451.113	91.441.307	950.654	2.618.661
Anlegeranteile	87.427	5.534.342	333.973	34.715
Thesaurierende Anteile	320.846	—	1.242.562	621.225
Ausschüttende Anteile	208.912	—	253.279	134.574
Institutionelle Plus-Anteile	601.297	4.596.070	1.888.504	1.823.425
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile	17.680	—	—	349
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	80.057	—	8.483	10.938
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	—	22.995.514	—	—
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile				
Institutionelle Anteile	(182.552)	(89.177.785)	(1.081.101)	(1.635.863)
Anlegeranteile	(19.310)	(9.179.895)	(193.205)	(33.846)
Thesaurierende Anteile	(219.006)	—	(875.688)	(505.546)
Ausschüttende Anteile	(117.401)	—	(49.910)	(64.717)
Institutionelle Plus-Anteile	(60.021)	(1.968.595)	(1.374.081)	(38.459)
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile	(182)	—	—	—
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	(2.951)	—	(3.190)	(65.809)
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	—	(58.024.946)	—	—
Stand am Jahresende	4.068.530	380.591.538	13.735.064	9.211.667
	SRI European Stock Fund	SRI Global Stock Fund	U.S. 500 Stock Index Fund	U.S. Discoveries Fonds
Stand zu Jahresbeginn	5.159.023	5.163.820	205.998.661	459.782
Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile				
Institutionelle Anteile	322.180	496.017	49.030.580	—
Anlegeranteile	23.788	36.484	5.935.982	172.107
Thesaurierende Anteile	25.489	160.189	—	—
Ausschüttende Anteile	6.412	103.615	—	—
Institutionelle Plus-Anteile	89.589	127.110	2.517.358	—
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	—	—	10.231.677	—
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	—	1	—	—
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile				
Institutionelle Anteile	(692.661)	(477.641)	(66.162.430)	—
Anlegeranteile	(32.205)	(24.565)	(6.237.604)	(171.687)
Thesaurierende Anteile	(17.846)	(98.675)	—	—
Ausschüttende Anteile	(3.061)	(42.260)	—	—
Institutionelle Plus-Anteile	(182.236)	(1.602.605)	(3.337.108)	—
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	(200)	—	—	—
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	—	—	(14.073.203)	—
Stand am Jahresende	4.698.272	3.841.490	183.903.913	460.202

	U.S. Fundamental Value Fund	U.S. Opportunities Fonds	20+ Year Euro Treasury Index Fund	Euro Government Bond Index Fund
Stand zu Jahresbeginn	183.953	3.645.234	4.041.107	19.814.825
Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile				
Institutionelle Anteile	—	738.611	755.062	4.996.398
Anlegeranteile	81.175	269.359	—	1.693.494
Institutionelle Plus-Anteile	—	—	344	1.693.132
Abgesicherte thesaurierende Anteile	—	—	—	556.350
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile				
Institutionelle Anteile	—	(805.863)	(1.189.471)	(2.691.847)
Anlegeranteile	(102.108)	(577.577)	—	(201.515)
Institutionelle Plus-Anteile	—	—	(3)	(2.218.674)
Abgesicherte thesaurierende Anteile	—	—	—	(72.861)
Stand am Jahresende	163.020	3.269.764	3.607.039	23.569.302
	Euro Investment Grade Bond Index Fund	Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund	Global Bond Index Fund	Global Short-Term Bond Index Fund
Stand zu Jahresbeginn	9.657.970	9.704.028	28.807.739	4.524.566
Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile				
Institutionelle Anteile	2.872.726	523.487	—	—
Anlegeranteile	122.092	68.842	—	—
Institutionelle Plus-Anteile	236.275	4.143.532	—	—
Institutionelle Anteile, abgesichert in CHF	—	—	3.199.135	6.479
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	—	—	2.451.717	1.796.066
Institutionelle Anteile, abgesichert in USD	—	—	2.231.399	239.769
Anlegeranteile, abgesichert in CHF	—	—	29.787	19.884
Anlegeranteile, abgesichert in EUR	—	—	63.656	322.707
Anlegeranteile, abgesichert in USD	—	—	98.870	46.498
Abgesicherte thesaurierende Anteile	274.185	—	5.966.336	1.307.738
Abgesicherte Ertragsanteile	—	—	1.982.900	1.319.111
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in CHF	—	—	37636	—
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in EUR	—	—	5.331.162	22.138
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in JPY	—	—	545	545
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in USD	—	—	7.126.496	64.885
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	—	—	52.093	43.927
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	—	—	1.641.908	134.182
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile				
Institutionelle Anteile	(987.540)	(307.150)	—	—
Anlegeranteile	(208.618)	(35.742)	—	—
Institutionelle Plus-Anteile	(564.161)	(957.444)	—	—
Institutionelle Anteile, abgesichert in CHF	—	—	(1.464.556)	(35.282)
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	—	—	(1.568.338)	(87.346)
Institutionelle Anteile, abgesichert in USD	—	—	(2.134.183)	(124.795)
Anlegeranteile, abgesichert in CHF	—	—	(5.620)	(1.077)
Anlegeranteile, abgesichert in EUR	—	—	(4.857)	(74.439)
Anlegeranteile, abgesichert in USD	—	—	(6.291)	(12.564)
Abgesicherte thesaurierende Anteile	(10.277)	—	(2.147.406)	(256.565)
Abgesicherte Ertragsanteile	—	—	(2.046.732)	(488.932)
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in CHF	—	—	(232.524)	—
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in EUR	—	—	(1.319.593)	(643)
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in USD	—	—	(1.034.338)	(55.554)
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	—	—	(3.099)	(10.281)
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	—	—	(456.116)	(6.168)
Stand am Jahresende	11.392.652	13.139.553	46.597.726	8.694.849

	Japan Government Bond Index Fund	U.K. Government Bond Index Fund	U.K. Investment Grade Bond Index Fund	U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund
Stand zu Jahresbeginn	3.801.695	6.758.056	19.996.291	8.707.808
Im Geschäftsjahr ausgegebene Anteile				
Institutionelle Anteile	3.600.215	300.244	—	—
Anlegeranteile	122.909	—	—	—
Thesaurierende Anteile	—	3.025.152	5.107.355	3.225.880
Ausschüttende Anteile	—	2.505.594	5.220.145	741.374
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile	—	489.420	1.883.530	4.783.865
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	—	1.244.659	967.183	150.662
Institutionelle Plus JPY-Ertragsanteile	9.500	—	—	—
Abgesicherte thesaurierende Anteile	398.935	—	—	—
Im Geschäftsjahr zurückgenommene Anteile				
Institutionelle Anteile	(517.059)	(24.099)	—	—
Anlegeranteile	(162.493)	—	—	—
Thesaurierende Anteile	—	(1.470.876)	(4.132.190)	(3.513.039)
Ausschüttende Anteile	—	(866.232)	(2.647.907)	(1.153.804)
Institutionelle Plus-GBP-Thesaurierungsanteile	—	(419.587)	(17.895)	(250.512)
Institutionelle Plus GBP-Ertragsanteile	—	(246.702)	(247.260)	(12.649)
Institutionelle Plus JPY-Ertragsanteile	(184.441)	—	—	—
Abgesicherte thesaurierende Anteile	(2.713)	—	—	—
Stand am Jahresende	7.066.548	11.295.629	26.129.252	12.679.585

	U.S. Government Bond Index Fund	U.S. Investment Grade Credit Index Fund	U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund ¹	U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund
Stand zu Beginn des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	4.228.813	9.256.191	—	9.191.562
Im Geschäftsjahr/Berichtszeitraum ausgegebene Anteile				
Thesaurierende Anteile	—	—	4.851.783	—
Ausschüttende Anteile	—	—	241.510	—
Institutionelle Anteile	3.941.755	2.103.762	—	835.538
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	1.271.607	—	—	—
Anlegeranteile	166.156	314.291	—	1.034.974
Institutionelle Plus-Anteile	267.266	1.538.344	—	—
Institutionelle Plus USD-Ertragsanteile	—	30.156	—	—
Abgesicherte thesaurierende Anteile	1.386.123	1.213.036	9.749.766	—
Abgesicherte Ertragsanteile	—	—	1.253.468	—
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in EUR	—	125.880	—	—
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert in GBP	—	55	—	—
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	—	914.647	—	—
Im Geschäftsjahr/Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile				
Thesaurierende Anteile	—	—	(276.061)	—
Ausschüttende Anteile	—	—	(9.430)	—
Institutionelle Anteile	(1.653.380)	(3.219.753)	—	(1.906.133)
Institutionelle Anteile, abgesichert in EUR	(315.707)	—	—	—
Anlegeranteile	(254.838)	(242.741)	—	(1.449.402)
Institutionelle Plus-Anteile	(207.028)	(439.755)	—	—
Institutionelle Plus USD-Ertragsanteile	—	(400.806)	—	—
Abgesicherte thesaurierende Anteile	(407.709)	(289.292)	(391.101)	—
Abgesicherte Ertragsanteile	—	—	(11.710)	—
Institutionelle Plus-Anteile, abgesichert in EUR	—	(90.395)	—	—
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert in GBP	—	(333.054)	—	—
Saldo zum Ende des Geschäftsjahres/Berichtszeitraums	8.423.058	10.480.566	15.408.225	7.706.539

¹ Der Fonds wurde am 24. Oktober 2016 aufgelegt.

9. Aufwendungen.

Laufende Kosten. Die Gesellschaft zahlt dem Manager aus dem Vermögen der einzelnen Fonds eine Pauschalgebühr je Anteilsklasse, die so genannte „laufende Kostenquote“ („LKQ“; früher „TER“) an Vanguard Group (Ireland) Limited (der „Manager“). Die LKQ wird täglich abgegrenzt und monatlich gezahlt. Der Manager zahlt folgende andere Aufwendungen in Namen der Fonds: Rechnungsprüfungshonorare, Vermarktungskosten, Buchhaltungsgebühren, Treuhänderhonorare, Börsengebühren, Gebühren der Übertragungsstelle, Verwahrstellengebühren, Verwahrungsgebühren, Verwaltungsrathonorare und Domizilstellengebühren. Der Fondsmanager kann einer Partei, die in die Gesellschaft investiert oder der Gesellschaft oder in Bezug auf einen Fonds Dienstleistungen erbringt, einen Nachlass auf alle oder einige seiner Gebühren gewähren. Der Investment-Manager zahlt die Honorare eines von ihm bestellten untergeordneten Investment-Managers aus seiner Gebühr.

Sollten die Kosten und Aufwendungen der Gesellschaft oder eines Fonds die LKQ überschreiten, ist der Manager dafür verantwortlich, den Überschuss aus seiner Gebühr zu zahlen.

Der Manager erhielt für die Leistung dieser Dienste wie folgt vom 1. Januar 2017 bis 31. Dezember 2017 einen festen Prozentsatz des Nettoinventarwerts jedes Fonds:

Fonds	Ausgewiesene laufende Kosten	Fonds	Ausgewiesene laufende Kosten
Emerging Markets Stock Index Fund		Pacific ex-Japan Stock Index Fund	
Institutionelle Anteile	0,27 %	Institutionelle Anteile	0,23 %
Anlegeranteile	0,40 %	Anlegeranteile	0,30 %
Thesaurierende Anteile	0,27 %	Thesaurierende Anteile	0,23 %
Ausschüttende Anteile	0,27 %	Ausschüttende Anteile	0,23 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,22 %	Institutionelle Thesaurierungsanteile	0,23 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,22 %	Institutionelle Plus-Anteile	0,20 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,22 %	Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,20 %
		Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,20 %
European Stock Index Fund		SRI European Stock Fund	
Institutionelle Anteile	0,30 %	Institutionelle Anteile	0,30 %
Anlegeranteile	0,35 %	Anlegeranteile	0,35 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,20 %	Thesaurierende Anteile	0,30 %
Eurozone Stock Index Fund		SRI Global Stock Fund	
Institutionelle Anteile	0,30 %	Institutionelle Anteile	0,35 %
Anlegeranteile	0,35 %	Anlegeranteile	0,40 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,20 %	Thesaurierende Anteile	0,35 %
Global Enhanced Equity Fund		U.S. 500 Stock Index Fund	
Institutionelle Anteile	0,50 %	Institutionelle Anteile	0,10 %
Global Small-Cap Index Fund		U.S. Discoveries¹ Fund	
Institutionelle Anteile	0,38 %	Anlegeranteile	0,85 %
Anlegeranteile	0,40 %	U.S. Fundamental Value Fund	
Thesaurierende Anteile	0,38 %	Anlegeranteile	0,95 %
Ausschüttende Anteile	0,38 %	U.S. Opportunities Fund	
Institutionelle Plus-Anteile	0,30 %	Institutionelle Anteile	0,85 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,30 %	Anlegeranteile	0,95 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,30 %	20+ Year Euro Treasury Index Fund	
Global Stock Index Fund		Institutionelle Anteile	
Institutionelle Anteile	0,25 %	0,25 %	
Anlegeranteile	0,30 %	Institutionelle Plus-Anteile	
Institutionelle Plus-Anteile	0,15 %	0,15 %	
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,15 %		
Abgesicherte institutionelle Anteile	0,25 %		
Japan Stock Index Fund			
Institutionelle Anteile	0,23 %		
Anlegeranteile	0,30 %		
Thesaurierende Anteile	0,23 %		
Ausschüttende Anteile	0,23 %		
Institutionelle Plus-Anteile	0,20 %		
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,20 %		
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,20 %		

Laufende Kostenquote (Fortsetzung)

Fonds	Ausgewiesene laufende Kosten
Euro Government Bond Index Fund	
Institutionelle Anteile	0,20 %
Anlegeranteile	0,25 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %
Abgesicherte thesaurierende Anteile	0,25 %
Euro Investment Grade Bond Index Fund	
Institutionelle Anteile	0,25 %
Anlegeranteile	0,30 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,15 %
Abgesicherte thesaurierende Anteile	0,30 %
Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund	
Institutionelle Anteile	0,20 %
Anlegeranteile	0,25 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %
Global Bond Index Fund	
Abgesicherte institutionelle Anteile	0,15 %
Abgesicherte thesaurierende Anteile	0,15 %
Abgesicherte Ertragsanteile	0,15 %
Abgesicherte Anlegeranteile	0,20 %
Abgesicherte institutionelle Plus-Anteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,10 %
Global Corporate Bond Index Fund²	
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert	0,25 %
Institutionelle Thesaurierungsanteile	0,20 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert	0,12 %
Global Credit Bond Fund³	
Institutionelle Thesaurierungsanteile abgesichert in EUR	0,30 %
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in GBP	0,35 %
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert in USD	0,35 %
Institutionelle Thesaurierungsanteile, abgesichert in USD	0,30 %
Global Short-Term Bond Index Fund	
Abgesicherte institutionelle Anteile	0,15 %
Abgesicherte thesaurierende Anteile	0,15 %
Abgesicherte Ertragsanteile	0,15 %
Abgesicherte Anlegeranteile	0,20 %
Abgesicherte institutionelle Plus-Anteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,10 %
Global Short-Term Corporate Bond Index Fund²	
Thesaurierende Anlegeranteile, abgesichert	0,25 %
Institutionelle Thesaurierungsanteile	0,20 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert	0,12 %
Japan Government Bond Index Fund -	
Institutionelle Anteile	0,20 %
Anlegeranteile	0,25 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,10 %
Abgesicherte thesaurierende Anteile	0,25 %

Fonds	Ausgewiesene laufende Kosten
SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund⁴	
Institutionelle Anteile	0,25 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,15 %
U.K. Government Bond Index Fund	
Thesaurierende Anteile	0,15 %
Institutionelle Anteile	0,15 %
Ausschüttende Anteile	0,15 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,06 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,06 %
U.K. Investment Grade Bond Index Fund	
Thesaurierende Anteile	0,15 %
Ausschüttende Anteile	0,15 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,06 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,06 %
U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund	
Thesaurierende Anteile	0,15 %
Ausschüttende Anteile	0,15 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,05 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,05 %
U.S. Government Bond Index Fund	
Institutionelle Anteile	0,20 %
Anlegeranteile	0,25 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %
Abgesicherte institutionelle Anteile	0,20 %
Abgesicherte thesaurierende Anteile	0,25 %
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	
Institutionelle Anteile	0,25 %
Anlegeranteile	0,30 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert	0,10 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert	0,10 %
Abgesicherte thesaurierende Anteile	0,30 %
Abgesicherte institutionelle Plus-Anteile	0,10 %
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund	
Select-Thesaurierungsanteile	0,09 %
Select-Ertragsanteile	0,09 %
Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert	0,09 %
Select-Ertragsanteile, abgesichert	0,09 %
U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund	
Institutionelle Anteile	0,25 %
Anlegeranteile	0,30 %

1 Der Fonds wurde am 23. Mai 2017 liquidiert.

2 Der Fonds wurde am 2. November 2017 aufgelegt.

3 Der Fonds wurde am 14. September 2017 aufgelegt.

4 Der Fonds wurde am 18. Juli 2017 aufgelegt.

Der Manager erhielt für die Leistung dieser Dienste wie folgt vom 1. Januar 2016 bis 31. Dezember 2016 einen festen Prozentsatz des Nettoinventarwerts jedes Fonds:

Fonds	Ausgewiesene laufende Kosten	Fonds	Ausgewiesene laufende Kosten
Emerging Markets Stock Index Fund		SRI Global Stock Fund	
Institutionelle Anteile	0,27 %	Institutionelle Anteile	0,35 %
Anlegeranteile	0,40 %	Anlegeranteile	0,40 %
Thesaurierende Anteile	0,27 %	Thesaurierende Anteile	0,35 %
Ausschüttende Anteile	0,27 %	Ausschüttende Anteile	0,35 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,22 %	Institutionelle Plus-Anteile	0,25 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,22 %	Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,25 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,22 %	Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,25 %
European Stock Index Fund		U.S. 500 Stock Index Fund	
Institutionelle Anteile	0,30 %	Institutionelle Anteile	0,10 %
Anlegeranteile	0,35 %	Anlegeranteile	0,25 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,20 %	Institutionelle Plus-Anteile	0,06 %
Eurozone Stock Index Fund		Abgesicherte institutionelle Anteile	
Institutionelle Anteile	0,30 %		0,10 %
Anlegeranteile	0,35 %	U.S. Discoveries	
Institutionelle Plus-Anteile	0,20 %	Anlegeranteile	0,85 %
Global Enhanced Equity Fund		U.S. Fundamental Value Fund	
Institutionelle Anteile	0,50 %	Anlegeranteile	0,95 %
Global Small-Cap Index Fund		U.S. Opportunities Fund	
Institutionelle Anteile	0,38 %	Institutionelle Anteile	0,85 %
Anlegeranteile	0,40 %	Anlegeranteile	0,95 %
Thesaurierende Anteile	0,38 %	20+ Year Euro Treasury Index Fund	
Ausschüttende Anteile	0,38 %	Institutionelle Anteile	0,25 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,30 %	Institutionelle Plus-Anteile	0,15 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,30 %	Euro Government Bond Index Fund	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,30 %	Institutionelle Anteile	0,20 %
Global Stock Index Fund		Anlegeranteile	0,25 %
Institutionelle Anteile	0,25 %	Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %
Anlegeranteile	0,30 %	Abgesicherte thesaurierende Anteile	0,25 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,15 %	Euro Investment Grade Bond Index Fund	
Abgesicherte institutionelle Anteile	0,25 %	Institutionelle Anteile	0,25 %
Japan Stock Index Fund		Anlegeranteile	0,30 %
Institutionelle Anteile	0,23 %	Institutionelle Plus-Anteile	0,15 %
Anlegeranteile	0,30 %	Abgesicherte thesaurierende Anteile	0,30 %
Thesaurierende Anteile	0,23 %	Eurozone Inflation-Linked Bond Index Fund	
Ausschüttende Anteile	0,23 %	Institutionelle Anteile	0,20 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,20 %	Anlegeranteile	0,25 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,20 %	Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,20 %	Global Bond Index Fund	
Pacific ex-Japan Stock Index Fund		Abgesicherte institutionelle Anteile	0,15 %
Institutionelle Anteile	0,23 %	Abgesicherte thesaurierende Anteile	0,15 %
Anlegeranteile	0,30 %	Abgesicherte Ertragsanteile	0,15 %
Thesaurierende Anteile	0,23 %	Abgesicherte Anlegeranteile	0,20 %
Ausschüttende Anteile	0,23 %	Abgesicherte institutionelle Plus-Anteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,20 %	Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,20 %	Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,20 %	Global Short-Term Bond Index Fund	
SRI European Stock Fund		Abgesicherte institutionelle Anteile	0,15 %
Institutionelle Anteile	0,30 %	Abgesicherte thesaurierende Anteile	0,15 %
Anlegeranteile	0,35 %	Abgesicherte Ertragsanteile	0,15 %
Thesaurierende Anteile	0,30 %	Abgesicherte Anlegeranteile	0,20 %
Ausschüttende Anteile	0,30 %	Abgesicherte institutionelle Plus-Anteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,20 %	Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,20 %	Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,20 %		

Laufende Kostenquote (Fortsetzung)

Fonds	Ausgewiesene laufende Kosten	Fonds	Ausgewiesene laufende Kosten
Japan Government Bond Index Fund -		U.S. Government Bond Index Fund	
Institutionelle Anteile	0,20 %	Institutionelle Anteile	0,20 %
Anlegeranteile	0,25 %	Anlegeranteile	0,25 %
Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %	Institutionelle Plus-Anteile	0,10 %
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,10 %	Abgesicherte institutionelle Anteile	0,20 %
Abgesicherte thesaurierende Anteile	0,25 %	Abgesicherte thesaurierende Anteile	0,25 %
U.K. Government Bond Index Fund		U.S. Investment Grade Credit Index Fund	
Thesaurierende Anteile	0,15 %	Institutionelle Anteile	0,25 %
Institutionelle Anteile	0,15 %	Anlegeranteile	0,30 %
Ausschüttende Anteile	0,15 %	Institutionelle Plus-Anteile	0,10 % ¹
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,06 %	Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,10 % ¹
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,06 %	Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile, abgesichert	0,10 %
U.K. Investment Grade Bond Index Fund -		Institutionelle Plus-Ertragsanteile, abgesichert	
Thesaurierende Anteile	0,15 %	Abgesicherte thesaurierende Anteile	0,30 %
Ausschüttende Anteile	0,15 %	Abgesicherte institutionelle Plus-Anteile	0,10 % ¹
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,06 %	U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund²	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,06 %	Select-Thesaurierungsanteile	0,09 %
U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund		Select-Ertragsanteile	0,09 %
Thesaurierende Anteile	0,15 %	Select-Thesaurierungsanteile, abgesichert	0,09 %
Ausschüttende Anteile	0,15 %	Select-Ertragsanteile, abgesichert	0,09 %
Institutionelle Plus-Thesaurierungsanteile	0,05 %	U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund	
Institutionelle Plus-Ertragsanteile	0,05 %	Institutionelle Anteile	0,25 %
		Anlegeranteile	0,30 %

¹ Die ausgewiesenen laufenden Kosten wurden zum 1. Dezember 2016 von 0,15 % auf 0,10 % verringert.

² Der Fonds wurde am 24. Oktober 2016 aufgelegt.

Die während des Geschäftsjahres gezahlten laufenden Kosten sind in der Betriebsergebnisrechnung als Verwaltungsgebühren aufgeführt. Die Verbindlichkeiten für laufende Kosten gegenüber Vanguard Group (Ireland) Limited zum 31. Dezember 2017 und 31. Dezember 2016 sind in der Vermögensbilanz als Verwaltungsgebühr ausgewiesen.

Verwahrstellengebühr. Die Verwahrstellengebühren werden, wie oben angegeben, vom Manager gezahlt.

Gebühren der Verwaltungsratsmitglieder. Die vom Manager im Namen der Gesellschaft aus der LKQ gezahlten gemeinsamen Einkünfte der Verwaltungsratsmitglieder beliefen sich im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017 auf US\$ 194.162 (31. Dezember 2016: US\$ 235.514), wovon US\$ null (31. Dezember 2016: US\$ null) zum Ende des Geschäftsjahres ausstanden.

Vergütung der Abschlussprüfer. Die Prüfungsgebühren werden, wie oben angegeben, vom Manager gezahlt. Die im Berichtszeitraum in Rechnung gestellten Vergütungen für die Abschlussprüfung beliefen sich zum 31. Dezember 2017 auf 596.627 US\$ (31. Dezember 2016: US\$ 572.257). Die Abschlussprüfer berechneten auch Gebühren für Schweizer Berichtsdienstleistungen, die für den Fonds bereitgestellt wurden. Diese beliefen sich auf 22.815 US\$ für das Jahr zum 31. Dezember 2017 (31. Dezember 2016: US\$ 20.041). Die Abschlussprüfer erbrachten keine weiteren Dienstleistungen für die Gesellschaft.

10. Kreditfazilität. Die Gesellschaft und bestimmte andere vom Investment-Manager verwaltete Fonds beteiligen sich an einer zugesagten Kreditfazilität in Höhe von \$ 3,1 Milliarden, die von einem Syndikat von Kreditgebern gemäss einem Kreditvertrag bereitgestellt wird, der jährlich erneuert werden kann; jeder beteiligte Fonds ist einzeln für seine ggf. im Rahmen der Kreditfazilität aufgenommenen Kredite haftbar. Kreditaufnahmen können vorübergehend oder im Notfall erfolgen und unterliegen den aufsichtsrechtlichen und vertraglichen Kreditaufnahmebeschränkungen des beteiligten Fonds. Den beteiligten Fonds werden Verwaltungsgebühren und eine jährliche Bereitstellungsgebühr in Höhe von 0,10 % des nicht in Anspruch genommenen Betrags der Fazilität berechnet, die den Fonds gemäss einer vom Verwaltungsrat der Gesellschaft genehmigten Methodik zugeteilt werden. Der Manager zahlt die Verwaltungsgebühren und die jährliche Bereitstellungsgebühren im Namen der Fonds. Kosten in Verbindung mit Kreditfazilitäten werden in der Betriebsergebnisrechnung als Finanzierungskosten behandelt.

Für keinen der Fonds standen zum 31. Dezember 2017 oder zu einem anderen Zeitpunkt während des dann endenden Geschäftsjahres (31. Dezember 2016: keine) aufgenommenen Kredite aus.

11. Effizientes Portfoliomanagement. Die Gesellschaft kann im Rahmen der Bedingungen und Grenzen, die von der Zentralbank und dem Prospekt festgelegt sind, Anlagetechniken zum effizienten Portfoliomanagement des Vermögens eines Fonds, unter anderem zur Absicherung gegen Marktbewegungen, Währungs- und Zinssatzrisiken, verwenden. Alle derartigen Anlagetechniken müssen vom Investment-Manager für wirtschaftlich angemessen erachtet und in kostengünstiger Weise realisiert werden.

Gemäss Verordnung 79 der CBI-OGAW-Verordnungen müssen OGAW-Fonds, die Techniken für ein effizientes Portfoliomanagement anwenden, diese offenlegen. OGAW-Fonds müssen die Erträge, die aus Techniken für ein effizientes Portfoliomanagement stammen, für den gesamten Berichtszeitraum zusammen mit den direkten und indirekten Betriebskosten und Gebühren, wenn Wertpapierleihgeschäfte, Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte getätigt wurden, offenlegen. Die Fonds gingen während der Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2017 und zum 31. Dezember 2016 keine Pensions- oder umgekehrten Pensionsgeschäfte ein.

Während des Geschäftsjahres wurde ein Wertpapierleihprogramm zum Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung eingegangen. Einzelheiten zu allen am Ende des Geschäftsjahres offenen Transaktionen sind in Erläuterung 20, Wertpapierleihe, aufgeführt.

Die JPMorgan Chase Bank, N.A. (Niederlassung London) wurde zur mit der Wertpapierleihe beauftragten Stelle ernannt. (Niederlassung London). Alle Erträge aus der Wertpapierleihe, mit Ausnahme einer Mindestgebühr für die mit der Wertpapierleihe beauftragte Stelle, fließen direkt in die Fonds. Alle Betriebskosten, die für das Wertpapierleihprogramm entstehen, werden von der mit der Wertpapierleihe beauftragten Stelle getragen und direkt aus der erhaltenen Gebühr für die mit der Wertpapierleihe beauftragte Stelle gezahlt. Die derzeitige Aufteilung der Einkünfte aus der Wertpapierleihe zwischen dem entsprechenden Fonds und der Wertpapierleihstelle ist 90:10, wobei 90 % der gesamten erzielten Erträge aus der Wertpapierleihe direkt in den entsprechenden Fonds fließen.

12. Barsicherheiten. Barsicherheiten gegenüber dem Makler werden als Vermögenswert der Fonds verbucht, unter Forderungen gegenüber Einschusskonten von Maklern zusammengefasst und zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Als Sicherheit erhaltene Barmittel werden in der Vermögensaufstellung als Passiva ausgewiesen und zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Eine entsprechende Verpflichtung zur Zurückzahlung der Sicherheit wird in der Vermögensaufstellung als Passiva ausgewiesen und ebenfalls zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

13. Sicherheiten. In den nachstehenden Tabellen sind die gestellten Sicherheiten für die Futures und Termingeschäfte aufgelistet. Die Einzelheiten zu Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte sind in Erläuterung 20, Wertpapierleihgeschäfte, offengelegt.

Gehaltene Sicherheiten zum 31. Dezember 2017

Fonds	Name der Besicherung	Gehaltener Betrag 2017	Marktwert zum 31. Dezember 2017
Global Stock Index Fund	US Treasury Note 11.15.2025	\$ 493.000	\$ 459.910
Global Stock Index Fund	US Treasury Note 6.15.2020	\$ 93.000	\$ 90.225
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	US Treasury Note 7.31.2019	\$ 410.000	\$ 392.975
Global Bond Index Fund	US Treasury Bond 8.15.2045	\$ 3.677.000	\$ 3.610.502
Global Bond Index Fund	US Treasury Bond 11.15.2046	\$ 3.500.000	\$ 3.269.767
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 1.31.2021	\$ 5.311.000	\$ 5.131.663
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 5.15.2020	\$ 563.000	\$ 573.999
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 8.31.2018	\$ 2.070.000	\$ 2.056.600
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 11.15.2025	\$ 104.000	\$ 99.084
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 9.30.2022	\$ 291.000	\$ 280.442
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 1.31.2021	\$ 363.000	\$ 347.164
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 2.15.2021	\$ 635.000	\$ 660.681
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 6.15.2018	\$ 406.000	\$ 401.423
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Bond 8.15.2042	\$ 87.000	\$ 83.852
Japan Government Bond Index Fund -	US Treasury Note 8.15.2024	\$ 410.000	\$ 389.384
U.S. Government Bond Index Fund	US Treasury Note 11.30.2021	\$ 73.000	\$ 69.858
U.S. Government Bond Index Fund	US Treasury Note 11.15.2025	\$ 98.000	\$ 91.422
U.S. Government Bond Index Fund	US Treasury Note 1.31.2021	\$ 62.000	\$ 59.295

Verpfändete Sicherheiten zum 31. Dezember 2017

Fonds	Name der Besicherung	Verpfändeter Betrag 2017	Marktwert zum 31. Dezember 2017
Euro Government Bond Index Fund	France O.A.T. 10.25.2032	(€ 1.400.000)	(€ 2.686.063)
Euro Government Bond Index Fund	Deutschland REP 8.15.2024	(€ 200.000)	(€ 249.624)
Euro Investment Grade Bond Index Fund	European Invnt BK 4.15.2020	(€ 200.000)	(€ 192.181)
Euro Investment Grade Bond Index Fund	European Invnt BK 3.15.2024	(€ 1.661.000)	(€ 1.569.808)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 8.15.2020	(\$ 4.079.000)	(\$ 3.973.369)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 11.15.2020	(\$ 8.047.000)	(\$ 7.773.408)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 4.30.2022	(\$ 850.000)	(\$ 795.171)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 11.15.2020	(\$ 196.000)	(\$ 191.288)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 8.15.2020	(\$ 482.000)	(\$ 464.727)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 9.30.2020	(\$ 32.985.000)	(\$ 31.919.932)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 3.15.2020	(\$ 993.000)	(\$ 971.343)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 9.30.2019	(\$ 365.000)	(\$ 355.729)
Global Corporate Bond Index Fund	Adobe Sys Inc. 1.2.2020	(\$ 11.000)	(\$ 8.843)
Global Corporate Bond Index Fund	Aetna Inc. 15.11.2022	(\$ 50.000)	(\$ 37.145)
Global Corporate Bond Index Fund	US Treasury Note 11.30.2019	(\$ 5.700)	(\$ 5.408)
Global Corporate Bond Index Fund	Apple Inc. 23.2.2021	(\$ 50.000)	(\$ 40.199)
Global Corporate Bond Index Fund	Bank Of America Corp. 1.22.2024	(\$ 169.000)	(\$ 145.817)
Global Corporate Bond Index Fund	Bank Of America Corp 10.19.2020	(\$ 300.000)	(\$ 242.969)
Global Corporate Bond Index Fund	Coca-Cola Co.5.30.2019	(\$ 78.000)	(\$ 61.922)
Global Corporate Bond Index Fund	HSBC USA Inc. 3.5.2020	(\$ 400.000)	(\$ 322.141)
Global Corporate Bond Index Fund	JPMorgan Chase 5.13.2024	(\$ 400.000)	(\$ 332.741)
Global Corporate Bond Index Fund	Kimberly-Clark 3.1.2022	(\$ 400.000)	(\$ 319.955)

Verpfändete Sicherheiten zum 31. Dezember 2017 (Fortsetzung)

Fonds	Name der Besicherung	Betrag Verpfändet 2017	Marktwert zum 31. Dezember 2017
Global Corporate Bond Index Fund	Kimberly-Clark 5.22.2019	(\$ 400.000)	(\$ 319.421)
Global Corporate Bond Index Fund	Microsoft Corp. 2.6.2027	(\$ 250.000)	(\$ 208.430)
Global Corporate Bond Index Fund	Pepsico Inc. 4.10.2019	(\$ 220.000)	(\$ 174.305)
Global Corporate Bond Index Fund	UNITEDHEALTH GRP 7.15.2025	(\$ 88.000)	(\$ 75.188)
Global Corporate Bond Index Fund	WAL-MART stores 12.15.2020	(\$ 305.000)	(\$ 242.969)
Global Corporate Bond Index Fund	Wells Fargo Co. 4.22.2019	(\$ 325.000)	(\$ 260.937)
Global Credit Bond Fund	AIR CAN 2017-1AA 144A 1.15.2030	(\$ 35.000)	(\$ 28.262)
Global Credit Bond Fund	AIR CAN 2017-1A 144A 1.15.2030	(\$ 20.000)	(\$ 15.977)
Global Credit Bond Fund	Ontario Province 6.17.2019	(\$ 146.000)	(\$ 115.385)
Global Credit Bond Fund	Ontario Province 6.17.2019	(\$ 140.000)	(\$ 110.643)
Global Credit Bond Fund	Ontario Province 4.14.2020	(\$ 50.000)	(\$ 49.661)
Global Credit Bond Fund	Quebec Province 9.15.2029	(\$ 140.000)	(\$ 182.944)
Global Credit Bond Fund	US Treasury Bond 8.15.2047	(\$ 169.000)	(\$ 160.227)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 2.15.2020	(\$ 1.171.000)	(\$ 1.191.376)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 11.30.2021	(\$ 713.000)	(\$ 682.311)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 3.15.2019	(\$ 300.000)	(\$ 294.799)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 8.31.2022	(\$ 99.000)	(\$ 92.132)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 10.15.2020	(\$ 211.000)	(\$ 205.533)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 1.31.2022	(\$ 6.179.000)	(\$ 5.972.314)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 11.30.2021	(\$ 407.000)	(\$ 389.482)
Global Short-Term Corporate Bond Index Fund	Altria Group Inc. 5.5.2021	(\$ 50.000)	(\$ 40.412)
Global Short-Term Corporate Bond Index Fund	Anheuser-Busch 2.1.2021	(\$ 317.000)	(\$ 257.649)
Global Short-Term Corporate Bond Index Fund	Bank Of America Corp. 4.21.2020	(\$ 300.000)	(\$ 240.883)
Global Short-Term Corporate Bond Index Fund	CISCO Systems 3.1.2019	(\$ 225.000)	(\$ 181.582)
Global Short-Term Corporate Bond Index Fund	Gilead Sciences 4.1.2019	(\$ 200.000)	(\$ 160.767)
Global Short-Term Corporate Bond Index Fund	Kimberly-Clark 5.22.2019	(\$ 78.000)	(\$ 62.287)
SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund	European Invnt BK 4.15.2020	(€ 300.000)	(€ 288.271)
U.K. Investment Grade Bond Index Fund	European Invnt BK 2.1.2019	(£ 755.000)	(£ 976.629)
U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund	Finland Rep OF 12.19.2019	(£ 300.000)	(£ 385.376)
U.S. Government Bond Index Fund	US Treasury Bond 8.15.2042	(\$ 66.000)	(\$ 63.612)
U.S. Government Bond Index Fund	US Treasury Note 5.15.2019	(\$ 4.231.000)	(\$ 4.095.062)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	ABB Finance USA 5.8.2022	(\$ 190.000)	(\$ 135.668)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	US Treasury Note 11.30.2019	(\$ 101.000)	(\$ 95.829)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Anheuser-Busch 2.1.2019	(\$ 400.000)	(\$ 322.779)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Anheuser-Busch 2.1.2026	(\$ 1.285.000)	(\$ 1.075.941)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Apple Inc. 3.5.2023	(\$ 1.137.000)	(\$ 901.070)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Procter & Gamble 2.6.2022	(\$ 425.000)	(\$ 341.331)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Target Corp. 6.26.2019	(\$ 275.000)	(\$ 220.594)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	UNITEDHEALTH GRP 7.15.2025	(\$ 1.050.000)	(\$ 897.126)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	WAL-MART stores 10.25.2020	(\$ 264.000)	(\$ 218.762)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Anheuser-Busch 2.1.2019	(\$ 240.000)	(\$ 192.588)
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund	US Treasury Bond Inflation Index 7.15.2020	(\$ 1.097.000)	(\$ 1.248.668)
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund	US Treasury Bond Inflation Index 7.15.2022	(\$ 430.000)	(\$ 445.846)

Gehaltene Sicherheiten zum 31. Dezember 2016

Fonds	Name der Besicherung	Gehaltener Betrag 2016	Marktwert zum 31. Dezember 2016
Global Stock Index Fund	US Treasury Bond Inflation Index 15.2.41	\$ 29.000	\$ 38.859
Japan Stock Index Fund	US Treasury Bond Inflation Index 15.2.41	\$ 205.000	\$ 269.026
Japan Stock Index Fund	US Treasury Note 31.8.18	\$ 110.000	\$ 109.032
Global Bond Index Fund	US Treasury Bond Inflation Index 15.1.22	\$ 17.821.000	\$ 18.303.183
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 31.7.20	\$ 16.749.000	\$ 16.338.137
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 15.5.20	\$ 10.773.000	\$ 11.150.758
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 15.8.25	\$ 10.900.000	\$ 10.096.157

Gehaltene Sicherheiten zum 31. Dezember 2016 (Fortsetzung)

Fonds	Name der Besicherung	Gehaltener Betrag 2016	Marktwert zum 31. Dezember 2016
Global Bond Index Fund	US Treasury Bond Inflation Index 15.2.41	\$ 982.000	\$ 1.288.701
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 15.11.17	\$ 1.072.000	\$ 1.098.067
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 15.6.18	\$ 521.000	\$ 511.436
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 15.5.19	\$ 372.000	\$ 381.483
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 30.11.20	\$ 96.000	\$ 93.782
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 15.5.20	\$ 4.767.000	\$ 4.934.156
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 31.8.21	\$ 2.810.000	\$ 2.753.028
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 31.7.20	\$ 1.460.000	\$ 1.424.185
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 31.1.21	\$ 232.000	\$ 224.954
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 15.3.19	\$ 176.000	\$ 172.088
Japan Government Bond Index Fund -	US Treasury Note 15.5.20	\$ 407.000	\$ 421.272
Japan Government Bond Index Fund -	US Treasury Note 30.4.18	\$ 50.000	\$ 49.307
U.S. Government Bond Index Fund	US Treasury Note 15.5.19	\$ 395.000	\$ 405.069

Verpfändete Sicherheiten zum 31. Dezember 2016

Fonds	Name der Besicherung	Verpfändeter Betrag 2016	Marktwert zum 31. Dezember 2016
European Stock Index Fund	US Treasury Bill 18.5.17	(USD 33.840)	(USD 33.764)
European Stock Index Fund	US Treasury Bill 18.5.17	(USD 104.000)	(USD 102.728)
European Stock Index Fund	US Treasury Bill 16.3.17	(USD 129.000)	(USD 125.005)
European Stock Index Fund	US Treasury Bill 16.3.17	(USD 204.000)	(USD 201.758)
European Stock Index Fund	US Treasury Bill 16.3.17	(USD 362.000)	(USD 361.638)
Global Stock Index Fund	US Treasury Bill 19.1.17	(USD 236.000)	(USD 228.879)
Global Stock Index Fund	US Treasury Bill 20.4.17	(USD 409.000)	(USD 408.337)
Global Stock Index Fund	US Treasury Bill 9.2.17	(USD 324.000)	(USD 323.854)
Global Stock Index Fund	US Treasury Bill 9.2.17	(USD 930.000)	(USD 920.286)
Global Stock Index Fund	US Treasury Bill 12.1.17	(\$ 3.427.000)	(\$ 3.392.391)
Global Stock Index Fund	US Treasury Bill 16.2.17	(\$ 3.739.000)	(\$ 3.699.611)
Global Stock Index Fund	US Treasury Bill 20.4.17	(\$ 5.060.000)	(\$ 5.001.285)
Japan Stock Index Fund	US Treasury Bill 27.4.17	(USD 162.000)	(USD 161.718)
Japan Stock Index Fund	US Treasury Bill 25.5.17	(USD 269.000)	(USD 260.306)
Japan Stock Index Fund	US Treasury Bill 25.5.17	(USD 300.000)	(USD 299.283)
Japan Stock Index Fund	US Treasury Bill 30.3.17	(USD 376.000)	(USD 375.556)
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	US Treasury Bill 27.4.17	(USD 100.000)	(USD 99.826)
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	US Treasury Bill 4.5.17	(USD 403.000)	(USD 402.214)
U.S. 500 Stock Index Fund	US Treasury Bill 20.4.17	(USD 166.000)	(USD 164.074)
U.S. 500 Stock Index Fund	US Treasury Bill 12.1.17	(USD 220.000)	(USD 217.778)
U.S. 500 Stock Index Fund	US Treasury Bill 9.3.17	(USD 500.000)	(USD 494.569)
U.S. 500 Stock Index Fund	US Treasury Bill 5.1.17	(USD 727.000)	(USD 719.753)
U.S. 500 Stock Index Fund	US Treasury Bill 9.2.17	(USD 750.000)	(USD 742.166)
U.S. 500 Stock Index Fund	US Treasury Bill 19.1.17	(\$ 1.310.000)	(\$ 1.296.667)
Euro Government Bond Index Fund	Germany Government Bond 13.4.18	(USD 225.000)	(USD 235.693)
Euro Government Bond Index Fund	France Government Bond 25.4.41	(USD 541.000)	(USD 840.360)
Euro Investment Grade Bond Index Fund	European Investment Bank 15.07.2020	(USD 146.000)	(USD 132.014)
Euro Investment Grade Bond Index Fund	European Investment Bank 28.09.2022	(USD 533.000)	(USD 533.014)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 31.12.17	(USD 100.000)	(USD 98.838)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 15.2.24	(\$ 1.554.000)	(\$ 1.538.920)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 15.5.20	(\$ 3.794.000)	(\$ 3.927.038)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 15.5.19	(\$ 3.998.000)	(\$ 4.058.079)
Global Bond Index Fund	US Treasury Bond 15.8.25	(USD 68.000)	(USD 89.909)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 30.11.21	(\$ 6.856.000)	(\$ 6.607.511)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 30.9.20	(\$ 12.854.000)	(\$ 12.365.000)

Verpfändete Sicherheiten zum 31. Dezember 2016 (Fortsetzung)

Fonds	Name der Besicherung	Verpfändeter Betrag 2016	Marktwert zum 31. Dezember 2016
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 30.11.21	(\$ 216.000)	(\$ 211.257)
Global Bond Index Fund	US Treasury Bond 15.8.20	(\$ 333.000)	(\$ 413.936)
Global Bond Index Fund	US Treasury Bond 15.2.45	(\$ 1.941.000)	(\$ 1.587.275)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 30.11.20	(\$ 2.105.000)	(\$ 2.035.373)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 15.2.22	(\$ 2.821.000)	(\$ 2.702.148)
Global Bond Index Fund	US Treasury Bond 15.11.45	(\$ 4.996.000)	(\$ 4.493.808)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 31.5.22	(\$ 5.990.000)	(\$ 5.649.764)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 15.2.20	(\$ 6.534.000)	(\$ 6.830.056)
Global Bond Index Fund	US Treasury Note 15.10.19	(\$ 8.670.000)	(\$ 8.337.725)
Global Bond Index Fund	US Treasury Bond 15.8.23	(\$ 7.279.000)	(\$ 8.799.657)
Global Bond Index Fund	US Treasury Bond 15.8.20	(\$ 7.264.000)	(\$ 9.029.522)
Global Bond Index Fund	US Treasury Bond 15.2.44	(\$ 11.205.000)	(\$ 11.424.717)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 30.11.20	(\$ 157.000)	(\$ 151.807)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 28.2.21	(\$ 123.000)	(\$ 122.239)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 15.7.18	(\$ 1.400.000)	(\$ 1.359.100)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 15.5.20	(\$ 1.540.000)	(\$ 1.594.000)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 15.5.19	(\$ 1.650.000)	(\$ 1.674.795)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 31.3.20	(\$ 125.000)	(\$ 119.996)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 28.2.19	(\$ 123.000)	(\$ 123.067)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 31.8.21	(\$ 837.000)	(\$ 787.131)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 30.11.20	(\$ 1.040.000)	(\$ 1.005.600)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 31.3.21	(\$ 1.796.000)	(\$ 1.706.149)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 30.4.18	(\$ 2.463.000)	(\$ 2.428.872)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 15.11.19	(\$ 3.346.000)	(\$ 3.209.962)
Global Short-Term Bond Index Fund	US Treasury Note 28.2.21	(\$ 4.311.000)	(\$ 4.082.918)
U.S. Government Bond Index Fund	US Treasury Note 15.2.25	(\$ 421.000)	(\$ 391.892)
U.S. Government Bond Index Fund	US Treasury Note 30.11.19	(\$ 495.000)	(\$ 481.649)
U.S. Government Bond Index Fund	US Treasury Note 15.8.25	(\$ 1.019.000)	(\$ 943.852)
U.S. Government Bond Index Fund	US Treasury Note 31.5.22	(\$ 552.000)	(\$ 520.646)
U.S. Government Bond Index Fund	US Treasury Note 15.8.24	(\$ 1.798.000)	(\$ 1.729.776)
U.S. Government Bond Index Fund	US Treasury Note 15.2.25	(\$ 2.841.000)	(\$ 2.644.574)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Anheuser-Busch InBev 1.2.19	(\$ 458.000)	(\$ 453.231)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	GlaxoSmithKline 8.5.22	(\$ 90.000)	(\$ 72.759)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Cisco Systems 28.2.18	(\$ 124.000)	(\$ 99.699)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	European Investment Bank 15.08.2018	(\$ 200.000)	(\$ 159.330)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Toyota Motor Credit 8.4.21	(\$ 250.000)	(\$ 196.688)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Toyota Motor Credit 13.7.18	(\$ 250.000)	(\$ 201.392)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Toyota Motor Credit 12.1.18	(\$ 250.000)	(\$ 201.431)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Medtronic 15.3.24	(\$ 250.000)	(\$ 209.972)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	GlaxoSmithKline 18.3.23	(\$ 280.000)	(\$ 226.080)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	European Investment Bank 15.12.2020	(\$ 300.000)	(\$ 236.532)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	GlaxoSmithKline 8.5.22	(\$ 310.000)	(\$ 250.615)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Toyota Motor Credit 6.4.18	(\$ 400.000)	(\$ 319.694)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Toyota Motor Credit 12.3.20	(\$ 400.000)	(\$ 320.733)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	JPMorgan Chase & Co. 23.01.2020	(\$ 529.000)	(\$ 426.398)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Colgate-Palmolive 1.2.23	(\$ 625.000)	(\$ 483.777)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	GlaxoSmithKline 15.5.18	(\$ 575.000)	(\$ 488.271)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	JPMorgan Chase & Co. 15.01.2018	(\$ 756.000)	(\$ 647.838)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	European Investment Bank 15.10.2021	(\$ 1.116.000)	(\$ 891.510)
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	Anheuser-Busch InBev 1.2.26	(\$ 2.260.000)	(\$ 1.860.930)
U.S. Treasury Inflation-Protected Securities Index Fund	US Treasury Bond Inflation Index 15.4.19	(\$ 157.000)	(\$ 160.705)

14. Geschäftsvorfälle mit nahestehenden Unternehmen und Personen. Unternehmen und Personen gelten als nahestehend, wenn ein Unternehmen oder eine Person die Möglichkeit hat, das andere Unternehmen bei finanziellen oder betrieblichen Entscheidungen zu lenken oder einen erheblichen Einfluss auf das andere Unternehmen auszuüben.

Nach Ansicht des Verwaltungsrats des Managers sind der Manager und der Investment-Manager verbundene Parteien gemäss Abschnitt 33 von FRS 102, „Angaben zu Beziehungen über nahe stehende Parteien“. Die während des Jahres gezahlten Gebühren und die am Jahresende an den Manager zu zahlenden Gebühren finden Sie unter „Verwaltungsgebühren“ und „Fällige Verwaltungsgebühren“ in der Betriebsergebnisrechnung bzw. in der Vermögensaufstellung. Diese Beträge werden dem Investment-Manager vom Manager erstattet. James M. Norris ist ein Managing Director von Vanguard International, einer Abteilung des Investment-Managers. Thomas M. Rampulla ist ein Managing Director von Vanguard Financial Advisor Services, einer Abteilung des Investment Managers. Alex Lomholt ist ein leitender Mitarbeiter von Vanguard und für den Bereich International ETFs verantwortlich. Sean P. Hagerty ist ein Managing Director von Vanguard Asset Management, Limited, einer Tochtergesellschaft des Investment-Managers.

Einzelheiten zu den Honoraren der Verwaltungsratsmitglieder sind in Anmerkung 9, Aufwendungen, angegeben.

In der nachfolgenden Tabelle sind die Inter-Fonds-Geschäfte zwischen der Gesellschaft und mehreren US-Investmentfonds aufgelistet, die im Geschäftsjahr zum 31. Juni 2017 ebenfalls vom Investment-Manager verwaltet wurden. Zum Bilanzstichtag standen zwischen diesen Parteien keine Beträge aus.

Fonds	Gekauft	Verkauft
Global Small-Cap Index Fund	\$ 22.467.580	\$ 60.879.274
Global Stock Index Fund	\$ 32.343.728	\$ 18.274.718
SRI Global Stock Fund	\$ 1.800.735	\$ 2.746.587
U.S. 500 Stock Index Fund	\$ 20.826.985	\$ 13.856.808
20+ Year Euro Treasury Index Fund	—	€ 231.698.503
Euro Government Bond Index Fund	€ 11.238.310	€ 23.689.398
Euro Investment Grade Bond Index Fund	€ 2.416.692	€ 371.854.717
Global Bond Index Fund	\$ 52.333.579	\$ 193.689.589
Global Corporate Bond Index Fund	\$ 169.803.642	\$ 4.535.879
Global Credit Bond Fund	\$ 160.390	\$ 767.967
Global Short-Term Bond Index Fund	\$ 13.465.616	\$ 22.626.576
Global Short-Term Corporate Bond Index Fund	\$ 42.319.837	\$ 3.215.590
Japan Government Bond Index Fund -	¥ 19.037	¥ 3.738.861
SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund	€ 161.015.832	€ 5.066.780
U.K. Investment Grade Bond Index Fund -	£ 6.097.541	£ 19.481.425
U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund	£ 3.612.979	£ 476.395.580
U.S. Investment Grade Credit Index Fund	\$ 76.428.687	\$ 308.824.079

Die Vergleichszahlen vom 2016 lauten wie folgt:

Fonds	Gekauft	Verkauft
Vanguard Global Small-Cap Index Fund	\$ 8.124.000	\$ 32.642.117
Vanguard Global Stock Index Fund	\$ 22.717.301	\$ 9.764.478
Vanguard SRI Global Stock Fund	\$ 644.501	\$ 459.394
Vanguard U.S. 500 Stock Index Fund	\$ 21.481.636	\$ 11.068.473
Vanguard U.K. Government Bond Index Fund	£ 127.395	—
Vanguard U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund	£ 661.001	£ 38.659.362
Vanguard Euro Government Bond Index Fund	€ 8.438.113.00	—
Vanguard U.S. Investment Grade Credit Index Fund	\$ 258.301.603	\$ 388.573.157
Vanguard Global Bond Index Fund	\$ 166.817.873	\$ 864.510.942
Vanguard Japan Government Bond Index Fund	¥ 1.159.661.782	¥ 1.293.680
Vanguard Euro Investment Grade Bond Index Fund	€ 14.341.672.88	€ 34.041.978.40
Vanguard 20+ Year Euro Treasury Index Fund	—	€ 3.317.754.14
Vanguard Global Short-Term Bond Index Fund	\$ 587.672.842	\$ 4.966.998
Vanguard U.K. Investment Grade Bond Index Fund	£ 7.655.962	£ 16.097.218

15. Nettoinventarwert je Anteil. Der Nettoinventarwert je Anteil jedes Fonds ergibt sich durch Teilen des Nettovermögenswerts des Portfolios durch die Gesamtanzahl der zum jeweiligen Zeitpunkt ausgegebenen Anteile.

16. Soft-Commission-Vereinbarungen. Weder der Investment-Manager noch PRIMECAP Management Company, der Unterverwalter für Vanguard U.S. Opportunities Fund, haben eine Client-Commission-Vereinbarung im Auftrag der Gesellschaft. Sowohl Granahan Investment Management, Inc., der der Unterverwalter für Vanguard U.S. Discoveries Fund war, als auch Pzena Investment Management, LLC, der Unterverwalter für Vanguard U.S. Fundamental Value Fund, haben Client-Commission-Vereinbarungen gemäss dem Konzept in Abschnitt 28(e) des Securities Exchange Act von 1934 und den entsprechenden durch die US Securities and Exchange Commission herausgegebenen Auslegungshilfen geschaffen. Nach diesen Vereinbarungen erhält ein Berater eine Reihe verschiedener Research- und Makler-Produkte, einschliesslich, doch nicht ausschliesslich schriftlicher Rechercheberichte, die die Wertentwicklungen oder Wertpapiere analysieren, Gesprächen mit Research Analysts, Treffen mit Führungskräften zur Entwicklung des Unternehmens und Marktdaten. Alle eventuellen Leistungen, die ein Berater im Zusammenhang mit einer Client-Commission-Vereinbarung empfängt, werden zugunsten des Fonds verwendet.

17. Wechselkurse. Bei der Erstellung des Halbjahresabschlusses zum 31. Dezember 2017 wurden hauptsächlich folgende Wechselkurse gegenüber einem US-Dollar verwendet:

Währung		Kurs	Währung		Kurs
AED	Vereinte Arabische Emirate Dirham	3,6728	JPY	Japanischer Yen	112,6500
AUD	Australischer Dollar	1,2785	KRW	Südkoreanischer Won	1.070,5500
BRL	Brasilianischer Real	3,3171	MXN	Mexikanischer Peso	19,5655
CAD	Kanadischer Dollar	1,2530	MYR	Malaysischer Ringgit	4,047
CHF	Schweizer Franken	0,9745	NOK	Norwegische Krone	8,1794
CLP	Chilenischer Peso	614,9800	NZD	Neuseeländischer Dollar	1,4061
COP	Kolumbianischer Peso	2.984,5000	PHP	Philippinischer Peso	49,9200
CZK	Tschechische Krone	21,2600	PKR	Pakistanische Rupie	110,3500
DKK	Dänische Krone	6,2004	PLN	Polnischer Zloty	3,4748
EGP	Ägyptisches Pfund	17,7800	QAR	Katar-Rial	3,6420
EUR	Euro	0,8328	RUB	Russischer Rubel	57,5713
GBP	Britisches Pfund	0,7392	SEK	Schwedische Krone	8,1875
HKD	Hongkong-Dollar	7,8173	SGD	Singapur-Dollar	1,3364
HUF	Ungarischer Forint	258,3320	THB	Thailändischer Baht	32,5900
IDR	Indonesische Rupiah	13.567,5000	TRY	Türkische Lira	3,7916
ILS	Israelischer Schekel	3,4717	TWD	Taiwanesischer Dollar	29,7585
INR	Indische Rupie	63,8275	ZAR	Südafrikanischer Rand	12,3800

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses zum 31. Dezember 2017 wurden hauptsächlich folgende Wechselkurse gegenüber einem Euro verwendet:

Währung		Kurs	Währung		Kurs
AUD	Australischer Dollar	1,5353	NOK	Norwegische Krone	9,8218
CHF	Schweizer Franken	1,1702	NZD	Neuseeländischer Dollar	1,6884
DKK	Dänische Krone	7,4454	SEK	Schwedische Krone	9,8316
GBP	Britisches Pfund	0,8877	SGD	Singapur-Dollar	1,6047
HKD	Hongkong-Dollar	9,3870	USD	US-Dollar	1,2008
JPY	Japanischer Yen	135,2701			

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses zum 31. Dezember 2017 wurden hauptsächlich folgende Wechselkurse gegenüber einem japanischen Yen verwendet:

Währung		Kurs	Währung		Kurs
GBP	Britisches Pfund	0,0066	USD	US-Dollar	0,0089

Bei der Erstellung des Halbjahresabschlusses zum 31. Dezember 2017 wurden hauptsächlich folgende Wechselkurse gegenüber einem Pfund Sterling verwendet:

Währung		Kurs
USD	US-Dollar	1,3528

Bei der Erstellung des Halbjahresabschlusses zum 31. Dezember 2016 wurden hauptsächlich folgende Wechselkurse gegenüber einem US-Dollar verwendet:

Währung		Kurs	Währung		Kurs
AED	Vereinigte Arabische Emirate Dirham	3,6729	JPY	Japanischer Yen	116,2791
AUD	Australischer Dollar	1,3810	KRW	Südkoreanischer Won	1.207,8000
BRL	Brasilianischer Real	3,2547	MXN	Mexikanischer Peso	20,6015
CAD	Kanadischer Dollar	1,3411	MYR	Malaysischer Ringgit	4,4860
CHF	Schweizer Franken	1,0164	NOK	Norwegische Krone	8,6077
CLP	Chilenischer Peso	669,7850	NZD	Neuseeländischer Dollar	1,4341
COP	Kolumbianischer Peso	3.002,0000	PHP	Philippinischer Peso	49,7125
CZK	Tschechische Krone	25,6180	PLN	Polnischer Zloty	4,1743
DKK	Dänische Krone	7,0496	QAR	Katar-Rial	3,6414
EGP	Ägyptisches Pfund	18,1300	RUB	Russischer Rubel	61,0438
EUR	Euro	0,9480	SEK	Schwedische Krone	9,0846
GBP	Britisches Pfund	0,8093	SGD	Singapur-Dollar	1,4447
HKD	Hongkong-Dollar	7,7532	THB	Thailändischer Baht	35,8105
HUF	Ungarischer Forint	292,8325	TRY	Türkische Lira	3,5176
IDR	Indonesische Rupiah	13.472,5000	TWD	Taiwanesischer Dollar	32,2290
ILS	Israelischer Schekel	3,8487	ZAR	Südafrikanischer Rand	13,6750
INR	Indische Rupie	67,8700			

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses zum 31. Dezember 2016 wurden hauptsächlich folgende Wechselkurse gegenüber einem Euro verwendet:

Währung		Kurs	Währung		Kurs
AUD	Australischer Dollar	1,4566	NOK	Norwegische Krone	9,0790
CHF	Schweizer Franken	1,0720	NZD	Neuseeländischer Dollar	1,5126
DKK	Dänische Krone	7,4355	SEK	Schwedische Krone	9,5820
GBP	Britisches Pfund	0,8536	SGD	Singapur-Dollar	1,5238
HKD	Hongkong-Dollar	8,1776	USD	US-Dollar	1,0548
JPY	Japanischer Yen	123,0208			

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses zum 31. Dezember 2016 wurden hauptsächlich folgende Wechselkurse gegenüber einem japanischen Yen verwendet:

Währung		Kurs	Währung		Kurs
GBP	Britisches Pfund	0,0069	USD	US-Dollar	0,0086

Bei der Erstellung des Halbjahresabschlusses zum 31. Dezember 2016 wurden hauptsächlich folgende Wechselkurse gegenüber einem Pfund Sterling verwendet:

Währung		Kurs
USD	US-Dollar	1,2357

18. Haftungstrennung. Jeder Fonds wird behandelt, als trüge er seine eigenen Verbindlichkeiten.

19. Eventualverbindlichkeit. Zum 31. Dezember 2017 und zum 31. Dezember 2016 gab es keine Eventualverbindlichkeiten.

20. Wertpapierleihgeschäfte. Die Gesamtmenge der Wertpapiere, die zum 31. Dezember 2017 von den Fonds ausgeliehen waren und der Wert der von den Fonds im Hinblick auf diese Wertpapiere gehaltenen Sicherheiten ist nachstehend aufgeführt. Die erhaltene Barsicherheit haben die untergeordneten Investment-Manager in Form von Termineinlagen und Rückkaufvereinbarungen angelegt.

Fonds	Wert der ausstehenden ausgeliehenen Wertpapiere	Wert der Besicherung
Emerging Markets Stock Index Fund	\$ 141.178.526	\$ 154.974.202
European Stock Index Fund	\$ 33.854.662	\$ 36.099.643
Eurozone Stock Index Fund	€ 1.799.684	€ 1.966.803
Global Enhanced Equity Fund	\$ 480.358	\$ 509.351
Global Small-Cap Index Fund	\$ 34.826.983	\$ 39.880.227
Global Stock Index Fund	\$ 80.837.499	\$ 87.731.714
Japan Stock Index Fund	€ 153.592.698	€ 165.034.277
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	€ 15.861.166	€ 16.704.186
SRI European Stock Fund	€ 1.435.090	€ 1.813.463
SRI Global Stock Fund	\$ 875.131	\$ 947.699
U.S. 500 Stock Index Fund	\$ 1.116.218	\$ 1.187.116
U.S. Opportunities Fund	\$ 27.615.813	\$ 31.244.078

Die Vergleichszahlen vom 31. Dezember 2016 lauten wie folgt:

Fonds	Wert der ausstehenden ausgeliehenen Wertpapiere	Wert der Besicherung
Emerging Markets Stock Index Fund	\$ 52.643.912	\$ 56.256.186
European Stock Index Fund	\$ 5.733.892	\$ 6.040.639
Eurozone Stock Index Fund	€ 1.770.424	€ 1.864.921
Global Enhanced Equity Fund	\$ 1.130.168	\$ 1.194.598
Global Small-Cap Index Fund	\$ 12.616.185	\$ 13.382.827
Global Stock Index Fund	\$ 52.438.942	\$ 55.398.469
Japan Stock Index Fund	€ 78.361.738	€ 82.595.520
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	€ 10.558.850	€ 11.129.578
SRI European Stock Fund	€ 1.674.162	€ 1.771.310
SRI Global Stock Fund	\$ 1.462.410	\$ 1.544.040
U.S. 500 Stock Index Fund	\$ 1.401.079	\$ 1.482.966
U.S. Discoveries Fund	\$ 82.400	\$ 87.821
U.S. Opportunities Fund	\$ 11.059.581	\$ 11.741.603

21. Ereignisse während des Jahres.

Am 3. April 2017 ersetzte der Investment-Manager Granahan Investment Management Inc. als Portfoliomanager des Vanguard U.S. Discoveries Fund. Ein überarbeiteter Prospekt wurde am 3. April 2017 von der Central Bank genehmigt und ersetzt den vorherigen Prospekt vom 1. Dezember 2016. Der Prospekt wurde aktualisiert, um die Abberufung von Granahan Investment Management Inc. als untergeordneter Investment-Manager des Vanguard U.S. Discoveries Fund zu berücksichtigen. Vanguard U.S. Discoveries Fund wurde am 23. Mai 2017 liquidiert.

Thomas M. Rampulla schied am 9. Juni 2017 als Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und des Managers aus. Sean P. Hagerty wurde am 9. Juni 2017 zum Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und des Managers bestellt.

Ein überarbeiteter Prospekt wurde am 30. Juni 2017 von der Central Bank genehmigt und ersetzt den vorherigen Prospekt vom 3. April 2017. Der Prospekt wurde aktualisiert, um Änderungen bezüglich der Verwaltungsratsmitglieder des Unternehmens, die Genehmigung des Vanguard SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund, die Änderung der Benchmark des Vanguard U.K. Short-Term Investment Grade Bond Index Fund und die Aufnahme neuer Anteilsklassen widerzuspiegeln.

Vanguard SRI Euro Investment Grade Bond Index Fund wurde am 30. Juni 2017 von der Zentralbank zugelassen und nahm seine Geschäftstätigkeit am 18. Juli 2017 auf.

Am 16. August 2017 wurden der Vanguard Global Corporate Bond Index Fund und der Vanguard Global Short-Term Corporate Bond Index Fund von der Zentralbank genehmigt.

Ein Nachtrag zum Prospekt vom 30. Juni 2017 wurde am 5. September 2017 genehmigt. Der Nachtrag aktualisierte den Abrechnungstag für die Zeichnung in allen Fonds ausser dem Vanguard Japan Stock Index Fund und dem Vanguard Japan Enhanced Equity Fund und die Aufnahme neuer Anteilsklassen.

Vanguard Global Credit Bond Fund nahm seine Geschäftstätigkeit am 14. September 2017 auf.

Ein überarbeiteter Prospekt wurde am 2. Oktober 2017 von der Central Bank genehmigt und ersetzt den vorherigen Prospekt vom 30. Juni 2017. Der Prospekt wurde aktualisiert, um die Anwendung des Swing Pricing und die Aufhebung von Verwässerungs- und Standard-Verwässerungsgebühren, die Aufnahme neuer Anteilsklassen und andere aufsichtsrechtliche Änderungen widerzuspiegeln.

Tara Doyle wurde am 3. Oktober 2017 zum Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und des Managers bestellt.

Vanguard Global Corporate Bond Index Fund und Vanguard Global Short-Term Corporate Bond Index Fund nahmen ihre Geschäftstätigkeit am 2. November 2017 auf.

Mit Wirkung zum 5. September 2017 änderte sich die Abwicklungszeit der Fonds (ausser beim Vanguard Japan Stock Index Fund) in Bezug auf Zeichnungen und Rücknahmen von drei Geschäftstagen in zwei Geschäftstage.

Ab dem 2. Oktober 2017 wurde keine Verwässerungsabgabe mehr erhoben. Stattdessen wurde das Swing Pricing eingeführt.

Die Notierung der Anteile der Gesellschaft wurde am 29. Dezember 2017 vom Hauptmarkt der Irish Stock Exchange auf deren Global Exchange Market übertragen.

22. Ereignisse nach dem Bilanzstichtag.

Der Prospekt wurde am 3. Januar 2018 geändert, um die Änderungen von MiFID II und allgemeine Änderungen sowie Änderungen im Verwaltungsrat und aufsichtsrechtliche Aktualisierungen widerzuspiegeln.

Vanguard Global Advisors, LLC, ersetzte am 15. Januar 2018 The Vanguard Group Inc. als Investment-Manager der Gesellschaft.

Der Prospekt wurde am 15. Januar 2018 per Nachtrag geändert, um diese Änderung widerzuspiegeln.

Der Prospekt wurde ferner am 14. Februar 2018 und am 7. März 2018 per Nachtrag geändert, um die Aufnahme von Anteilsklassen widerzuspiegeln.

23. Genehmigung des Jahresabschlusses. Der Jahresabschluss wurde am 23. April 2018 vom Verwaltungsrat genehmigt.

Bericht des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat (der „Verwaltungsrat“) legt seinen Jahresbericht zusammen mit dem geprüften Jahresabschluss für Vanguard Investment Series plc (die „Gesellschaft“) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017 vor.

Aufgaben des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat ist für das Erstellen des Jahresberichts und des Jahresabschlusses gemäss irischem Recht und Bestimmungen verantwortlich.

Laut irischem Gesellschaftsrecht hat der Verwaltungsrat einen Abschluss zu erstellen, der einen wahrheitsgemässen und fairen Überblick über die Situation der Gesellschaft und die Gewinne oder Verluste der Gesellschaft für das jeweilige Jahr enthält. Gemäss diesem Recht hat der Verwaltungsrat von seinem Wahlrecht Gebrauch gemacht, den Abschluss in Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen (vom Financial Reporting Council herausgegebene und vom Institute of Chartered Accountants in Ireland und dem irischen Gesetz veröffentlichte Rechnungslegungsgrundsätze) zu erstellen.

Bei der Erstellung dieses Abschlusses muss der Verwaltungsrat:

- geeignete Rechnungslegungsgrundsätze auswählen und diese einheitlich anwenden;
- Entscheidungen treffen und Schätzungen für die Rechnungslegung vornehmen, die angemessen und umsichtig sind;
- den Jahresabschluss nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellen, es sei denn, die Annahme, dass die Gesellschaft ihre Geschäfte fortführen wird, wäre unangemessen; und
- angeben, ob der Abschluss in Übereinstimmung mit den anwendbaren Bilanzierungsrichtlinien erstellt wurde, die entsprechenden Grundsätze angeben und die Auswirkungen und Gründe für wesentliche Abweichungen von diesen Grundsätzen erläutern.

Der Verwaltungsrat ist für die Führung ordnungsgemässer Buchhaltungsunterlagen verantwortlich, anhand derer die finanzielle Situation der Gesellschaft jederzeit mit angemessener Genauigkeit ausgewiesen ist und mit denen er sicherstellen kann, dass der Abschluss im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsstandards erstellt ist und dem Companies Act von 2014 (Gesetz über Kapitalgesellschaften) und den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften von 2011 (Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren) (in ihrer jeweils gültigen Fassung) entspricht. Es ist ausserdem Aufgabe des Verwaltungsrats, das Vermögen der Gesellschaft zu schützen und daher angemessene Massnahmen zum Schutz vor Betrug und anderen Unregelmässigkeiten bzw. deren Aufdeckung zu ergreifen.

Sowohl der Verwaltungsrat als auch die Gesellschaft sind laut Satzung und Gründungsurkunde befugt, den Zeitpunkt und Ort festzulegen, an dem die Bezahlung für Anteile zu erfolgen hat. Dementsprechend liegt es im Ermessen des Verwaltungsrats, unter besonderen Umständen Zeichnungsgelder nach der im Prospekt angegebenen

Transaktionszeit zu akzeptieren. Der Verwaltungsrat wird bei Ausübung dieser Ermessensfreiheit rechtliche Gesichtspunkte, Terminaspekte und andere relevante Gesichtspunkte berücksichtigen.

Der Abschluss wird unter www.vanguard.co.uk veröffentlicht. Der Verwaltungsrat ist gemeinsam mit dem Manager und dem Investment-Manager für die Pflege und Integrität der Website im Hinblick auf Vanguard Investment Series plc verantwortlich. Die von den Abschlussprüfern durchgeführte Arbeit erstreckt sich nicht auf die Berücksichtigung der Pflege und Integrität der Website. Folglich übernehmen die Abschlussprüfer keinerlei Verantwortung für Änderungen, die an dem auf der Website präsentierten Abschluss vorgenommen wurden. Die in der Republik Irland für die Präsentation und Veröffentlichung des Abschlusses geltende Gesetzgebung kann sich von der Gesetzgebung in anderen Rechtsordnungen unterscheiden.

Erklärung zu relevanten Prüfungsinformationen

Jedes zum Datum dieses Berichts amtierende Verwaltungsratsmitglied hat Folgendes bestätigt:

- Soweit ihnen bekannt ist, liegen keine relevanten Prüfungsinformationen vor, die dem Abschlussprüfer der Gesellschaft nicht bekannt sind; und
- Sie haben alle Schritte unternommen, die sie als Verwaltungsratsmitglieder zu unternehmen gehabt hätten, um Kenntnis von solchen Prüfungsinformationen zu erhalten und sicherzustellen, dass der Abschlussprüfer der Gesellschaft von diesen Informationen Kenntnis hat.

Erklärung des Verwaltungsrats zur Erfüllung der einschlägigen Verpflichtungen

Die Unternehmenspolitik der Gesellschaft ist darauf ausgerichtet, die einschlägigen Verpflichtungen (gemäss dem Companies Act von 2014) zu erfüllen. Gemäss Section 225(2) des Companies Act von 2014 bestätigt der Verwaltungsrat, dass er dafür verantwortlich ist, die Erfüllung der einschlägigen Verpflichtungen sicherzustellen. Der Verwaltungsrat hat eine Grundsatzklärung zur Compliance gemäss Section 225(3)(a) des Companies Act von 2014 entwickelt, sowie eine Compliance-Richtlinie in Bezug auf die bestehenden Vorkehrungen und Strukturen, die nach Ansicht des Verwaltungsrats darauf ausgerichtet sind, die einschlägigen Verpflichtungen der Gesellschaft im Wesentlichen zu erfüllen. Bei der Erfüllung seiner Aufgaben gemäss Section 225 stützte sich der Verwaltungsrat unter anderem auf Dienstleistungen, Empfehlungen und/oder Zusicherungen Dritter, die nach Ansicht des Verwaltungsrats über die erforderlichen Kenntnisse und Erfahrungen verfügen, um die wesentliche Erfüllung der einschlägigen Verpflichtungen der Gesellschaft sicherzustellen.

Geschäftsbücher

Die vom Verwaltungsrat ergriffenen Massnahmen, mit denen dafür gesorgt wird, dass die Verpflichtungen der Gesellschaft bezüglich der Führung ordnungsgemässer Geschäftsbücher erfüllt werden, bestehen aus der Verwendung geeigneter Systeme und Verfahren, der Ernennung eines Verwalters und der Einstellung kompetenter Personen. Die Geschäftsbücher werden bei der Verwaltungsstelle in 30 Herbert Street, Dublin 2, Irland, aufbewahrt.

Rückblick auf das Geschäft und zukünftige Entwicklungen

Die Gesellschaft wurde nach irischem Recht gemäss Companies Act von 2014 und der OGAW-Richtlinien als Investmentgesellschaft mit variablem Kapital in Form einer Aktiengesellschaft (public limited company) gegründet. Im Verlauf des Jahres gab es keine Änderung der Geschäftsart der Gesellschaft.

Eine vollständige Auflistung der Fonds finden Sie in Erläuterung 2 der Erläuterungen zum Jahresabschluss.

Risikomanagementziele und -strategien

Der Verwaltungsrat möchte Sie auf die Hauptrisiken aufmerksam machen, denen die Fonds ausgesetzt sind. Diese sind in Erläuterung 4 der Erläuterungen zum Abschluss dargelegt.

Ergebnisse und Dividenden

Die Ergebnisse und Dividenden des Jahres sind in der Betriebsergebnisrechnung ausgewiesen.

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Der Prospekt wurde am 3. Januar 2018 geändert, um die Änderungen von MiFID II und allgemeine Änderungen sowie Änderungen im Verwaltungsrat und aufsichtsrechtliche Aktualisierungen widerzuspiegeln.

Der Prospekt wurde am 15. Januar 2018 per Nachtrag geändert, um die Änderung des Investment-Managers von The Vanguard Group, Inc. in Vanguard Global Advisors, LLC widerzuspiegeln.

Der Prospekt wurde ferner am 14. Februar 2018 und am 7. März 2018 per Nachtrag geändert, um die Aufnahme von Anteilklassen widerzuspiegeln.

Verwaltungsrat

Nachstehend sind die Namen der Personen aufgeführt, die während des gesamten oder einem Teil des am 31. Dezember 2017 endenden Jahres Mitglied des Verwaltungsrats waren.

Peter Blessing (Irland)
Michael S. Miller (USA)
James M. Norris (USA)
Thomas M. Rampulla (USA)¹
Axel Lomholt (Dänemark)
William Slattery (Irland)
Sean P. Hagerty (USA)²
Tara Doyle (Irland)³

Beteiligungen des Verwaltungsrats und des Gesellschaftssekretärs

Der Verwaltungsrat bzw. der Gesellschaftssekretär und deren Familien besitzen keine Beteiligungen an den Anteilen der Gesellschaft zum 31. Dezember 2017. Kein Verwaltungsrat hatte zu einem jeglichen Zeitpunkt im Laufe des Jahres eine erhebliche Beteiligung an einem wesentlichen Vertrag, der während des Jahres oder am Jahresende im Hinblick auf das Geschäft der Gesellschaft existierte.

Unabhängige Rechnungsprüfer

Die Rechnungsprüfer PricewaterhouseCoopers werden im Einklang mit Paragraph 160(2) des Companies Act von 2014 erneut beauftragt.

Offenlegung der Geschäftsführung des Verwaltungsrats

Geschäftsführung

Die Gesellschaft ist in Irland im Sinne des Companies Act von 2014 und der OGAW-Verordnungen zugelassen. Gemäss diesen ist der Verwaltungsrat dazu verpflichtet, die Geschäfte der Gesellschaft gemäss den OGAW-Verordnungen und in Übereinstimmung mit allen relevanten Vorschriften der Companies Act von 2014 durchzuführen. Der Verwaltungsrat hat zudem den durch die Irish Funds Industry Association ausgegebenen Corporate Governance Code (den „IFIA Corporate Governance Code“) übernommen. Eine Kopie des IFIA Corporate Governance Code ist unter <http://www.irishfunds.ie/publications/> verfügbar.

Versammlungen der Anteilhaber und Stimmrechte

Hauptversammlungen

Alle Hauptversammlungen der Gesellschaft werden in Irland abgehalten. Jährlich wird mindestens eine Hauptversammlung der Gesellschaft als Jahreshauptversammlung der Gesellschaft abgehalten. Die Anteilhaber werden mindestens 21 Tage (einschliesslich des Tages, an dem die Benachrichtigung zugestellt wird oder als zugestellt gilt, und des Tages, für den die Benachrichtigung erteilt wird) im Voraus benachrichtigt. Die Benachrichtigung gibt Auskunft über Ort, Tag und Uhrzeit der Versammlung und die Inhalte der vorgelegten Beschlüsse. Es können Stellvertreter im Namen der Anteilhaber teilnehmen.

Stimmrechte

Jeder Anteilhaber hat Anspruch auf die Anzahl Stimmen, die sich ergibt, wenn man den gesamten Nettoinventarwert des Anteilsbestandes dieses Inhabers (zum „geltenden Stichtag“ in US-Dollar ausgedrückt oder umgerechnet) durch eins dividiert. Inhaber von Zeichneranteilen haben eine Stimme pro Zeichneranteil. Der relevante Aufzeichnungstermin ist in diesem Sinne ein Datum, das nicht mehr als 30 Tage vor dem Datum der betreffenden Hauptversammlung der Anteilhaber oder des schriftlichen Umlaufbeschlusses liegt, wie vom Verwaltungsrat festgelegt. Bei einer Beschlussfassung, die nach Ansicht des Verwaltungsrats Anlass für einen Interessenkonflikt zwischen den Anteilhabern einer Klasse gibt oder geben könnte, gilt der Beschluss nur dann als ordnungsgemäss gefasst, wenn er nicht auf einer einzigen Versammlung der Anteilhaber dieser Klasse, sondern jeweils auf separaten Versammlungen der Anteilhaber einer solchen Klasse verabschiedet worden ist. Alle Stimmen werden durch Abstimmung der entweder persönlich oder durch Stellvertreter auf der betreffenden

¹ Am 9. Juni 2017 als Verwaltungsratsmitglied ausgeschieden.

² Am 9. Juni 2017 zum Verwaltungsratsmitglied ernannt.

³ Am 3. Oktober 2017 zum Verwaltungsratsmitglied ernannt.

Anteilhaberversammlung anwesenden Anteilhaber oder durch einstimmigen schriftlichen Umlaufbeschluss der Anteilhaber abgegeben.

Versammlungen der Inhaber einer Klasse –

Veränderung der Rechte der Inhaber einer Klasse

Laut Satzung der Gesellschaft (die „Satzung“) können die mit jeder Anteilsklasse verbundenen Rechte unabhängig davon, ob die Gesellschaft aufgelöst wird oder nicht, nach schriftlicher Zustimmung der Inhaber von drei Vierteln der umlaufenden Anteile dieser Klasse oder mit Genehmigung eines ausserordentlichen Beschlusses, der auf einer separaten Hauptversammlung der Inhaber der Anteile dieser Klasse gefasst wurde, geändert werden. Durch die Schaffung oder Ausgabe weiterer Anteile, die mit den bereits ausgegebenen Anteilen gleichrangig sind, gelten die mit einer Anteilsklasse verbundenen Rechte nicht als geändert, es sei denn, die Ausgabebedingungen dieser Anteile sehen ausdrücklich Anderslautendes vor.

Die Bestimmungen der Satzung bezüglich der Hauptversammlungen gelten für jede derartige gesonderte Hauptversammlung, mit der Ausnahme, dass zur Beschlussfähigkeit einer solchen Versammlung zwei Inhaber von Anteilen der fraglichen Klasse, die entweder persönlich oder durch Stellvertreter anwesend sind, oder bei einer vertagten Versammlung ein Inhaber von Anteilen der fraglichen Klasse oder sein Stellvertreter erforderlich sind.

Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft

Sofern per ordentlichem Beschluss der Gesellschaft auf einer Hauptversammlung nichts anderes beschlossen wird, muss die Anzahl der Verwaltungsratsmitglieder mindestens drei und höchstens neun betragen. Derzeit gibt es sieben Verwaltungsratsmitglieder. Diese sind in diesem Jahresabschluss aufgeführt.

Die Geschäfte der Gesellschaft werden vom Verwaltungsrat geführt, der alle Vollmachten der Gesellschaft ausüben kann, die nicht gemäss den Companies Acts und der Satzung von der Hauptversammlung der Gesellschaft ausgeübt werden müssen. Ein Verwaltungsratsmitglied kann und der Gesellschaftssekretär der Gesellschaft muss auf Antrag eines Verwaltungsratsmitglieds jederzeit eine Versammlung der Verwaltungsratsmitglieder einberufen. Alle bei einer Hauptversammlung aufkommenden Fragen sind durch eine Mehrheit der Stimmen zu klären. Die Verwaltungsratsmitglieder können die zur Durchführung eines Geschäfts erforderliche beschlussfähige Mehrheit festlegen. Sofern die beschlussfähige Mehrheit nicht auf eine andere Zahl festgesetzt wird, beträgt sie zwei.

Interne Steuerung und Risikomanagement

Die Verwaltungsratsmitglieder sind dafür verantwortlich, angemessene Systeme zur internen Steuerung und für das Risikomanagement der Gesellschaft in Bezug auf die Finanzberichterstattung zu schaffen und zu pflegen. Solche Systeme sind so zu gestalten, dass sie das Risiko von Fehlern oder Irrtümern bei der Erreichung der Finanzberichterstattungsziele der Gesellschaft weniger ausräumen als vielmehr verwalten. Sie liefern lediglich eine Absicherung gegen falsche Angaben oder Verluste in vernünftiger Masse, jedoch keine absolute Sicherheit.

Die Verwaltungsratsmitglieder haben verschiedene Verantwortungsbereiche zur Überwachung der Systeme zur internen Steuerung und für das Risikomanagement an verschiedene Stellen übertragen. Insbesondere wurde die Hauptverantwortung für die Auswertung der unabhängigen Rechnungsprüfer, die Prüfung für den Geltungsbereich der Prüfung und den Einsatz von Prüfressourcen sowie die Aufsicht über die Finanzberichterstattungs- und Rechnungsprüfungsverfahren an zwei Verwaltungsratsmitglieder, Peter Blessing und Michael S. Miller, delegiert. Das interne Prüfverfahren der Gesellschaft wird vom Internal Audit Department („IAD“) der Vanguard Group, Inc („VGI“) durchgeführt. Die IAD ist damit beauftragt, die Verwaltungsratsmitglieder bei der Ziehung von Schlüssen über die allgemeine Effizienz interner Prüfungen zu unterstützen und den Verwaltungsratsmitgliedern die für die Ausübung ihrer Aufgaben erforderlichen Informationen zur Verfügung zu stellen.

Die Verwaltungsratsmitglieder haben Verfahren geschaffen, die sicherstellen sollen, dass alle erforderlichen Geschäftsbücher ordentlich geführt werden und stets verfügbar sind. Dazu zählt auch die Erstellung der Jahres- und Halbjahresabschlüsse. Die Verwaltungsratsmitglieder sind dafür verantwortlich, dass die Geschäftsbücher die finanzielle Situation der Gesellschaft jederzeit mit angemessener Genauigkeit ausweisen und sichergestellt ist, dass der Abschluss im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsstandards erstellt ist und dem Companies Act 2014 (Gesetz über Kapitalgesellschaften) sowie den OGAW-Verordnungen entspricht. Der Jahresabschluss der Gesellschaft ist durch die Verwaltungsratsmitglieder zu verabschieden. Der gesetzliche Jahresabschluss ist durch die unabhängigen Rechnungsprüfer der Gesellschaft, PricewaterhouseCoopers, zu prüfen. Die Rechnungsprüfer erstatten dem Prüfungsausschuss jährlich Bericht über die Ergebnisse dieser Prüfung.

Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) wurde als unabhängige Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft ernannt, um die Bücher und Unterlagen aufzubewahren. Die Verwaltungsgesellschaft ist durch die Central Bank of Ireland zugelassen und geregelt und muss die durch die Central Bank of Ireland geschaffenen Vorschriften einhalten. Darüber hinaus erstellt der Verwalter sämtliche Jahresabschlüsse und die dazugehörigen Erläuterungen der Gesellschaft zusammen mit den Jahres- und Halbjahresberichten.

Bisweilen prüft und bewertet der Verwaltungsrat auch die Finanzberichterstattungs- und buchhaltungsverfahren des Fondsverwalters und überwacht und bewertet die Leistung, Qualifikation und Unabhängigkeit der externen Rechnungsprüfer. Es ist ausserdem Aufgabe des Verwaltungsrats, das Vermögen der Gesellschaft zu schützen, was angemessene Massnahmen zum Schutz vor Betrug und anderen Unregelmässigkeiten bzw. deren Aufdeckung umfasst.

Im Namen des Verwaltungsrats

Axel Lomholt
Peter Blessing
23. April 2018

Zusätzliche Informationen vom Verwaltungsrat (ungeprüft)

Offenlegung der Vergütung

Die EU-Richtlinie 2014/91/EU (bekannt als „OGAW-V-Richtlinie“) wurde 21. März 2016 wirksam. Um die Auflagen der OGAW-V-Richtlinie zu erfüllen, hat der Manager mit Wirkung zum 18. März 2016 eine Vergütungspolitik eingeführt, die in Anbetracht der Grösse und internen Struktur des Managers sowie der Art, des Umfangs und der Komplexität seiner Tätigkeiten angemessen ist. Die Vergütungspolitik des Managers gilt für Mitarbeiter, deren berufliche Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der Gesellschaft und des Managers haben. Zum 31. Dezember 2017 hatten weder der Manager noch die Gesellschaft Mitarbeiter und die Vergütungspolitik des Managers galt nur für Mitglieder des Leitungsorgans des Managers, dem Verwaltungsrat, die identifizierte Mitarbeiter im Sinne der Vergütungspolitik sind. Die Vergütungspolitik und deren Umsetzung werden gemäss den Auflagen der Verordnung 24B(1) Abs. (c) und (d) der OGAW-Vorschriften einmal jährlich überprüft.

Die Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft erhalten von der Gesellschaft keine Vergütung für diese Dienste.

Bestimmte Verwaltungsratsmitglieder des Managers erhalten eine Vergütung für solche Dienste, die sie für den Manager und für Organismen für gemeinsame Anlagen erbringen, für die sie bestellt wurden. Insbesondere die Verwaltungsratsmitglieder des Managers, die keine Mitarbeiter des Investment-Managers oder einer Tochtergesellschaft des Investment-Managers sind, erhalten eine feste Vergütung, jedoch keine variable Vergütung. Die gesamte an die vorgenannten Verwaltungsratsmitglieder zahlbare Vergütung darf einen bestimmten Betrag nicht überschreiten, der jeweils von Zealous, Inc, dem Alleinaktionär des Managers, genehmigt wird. Die Verwaltungsratsmitglieder des Managers, die Angestellte des Investment-Managers oder einer Tochtergesellschaft des Investment-Managers sind, erhalten keine Vergütung in Bezug auf diese Dienste. Die gemeinsamen Einkünfte der Verwaltungsratsmitglieder des Managers, die in Bezug auf die Gesellschaft für das zum 31. Dezember 2017 endende Geschäftsjahr gezahlt wurden, sind in Erläuterung 9 dargelegt.

Offenlegung zu verbundenen Personen

Transaktionen, die im Jahr zum 31. Dezember 2017 durch den Investment-Manager, den Manager, die Depotbank, den Anlageberater und/oder durch angeschlossene oder Konzernunternehmen von diesen („verbundene Personen“) mit der Gesellschaft ausgeführt wurden, wurden so ausgeführt, als wären sie unter gewöhnlichen geschäftlichen Bedingungen ausgehandelt worden, und waren im besten Interesse der Anteilhaber der Gesellschaft. Der Verwaltungsrat der Gesellschaft ist davon überzeugt, dass (durch schriftliche Verfahren nachweisbare) Vorkehrungen getroffen wurden, um sicherzustellen, dass alle von der Gesellschaft mit verbundenen Personen eingegangenen Transaktionen so ausgeführt werden, als wären sie unter gewöhnlichen geschäftlichen Bedingungen ausgehandelt worden, und im besten Interesse der Anteilhaber der Gesellschaft sind.

Securities Financing Transaction Regulation – Verordnung zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften

Mit der EU-Verordnung zur Erhöhung der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften („SFT-Verordnung“) wurden Meldepflichten in Bezug auf Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFT“) und Total Return Swaps eingeführt.

Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft (SFT) ist gemäss Artikel 3(11) der SFT-Verordnung definiert als:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft;
- ein Wertpapier- oder Warenverleihgeschäft bzw. ein Wertpapier- oder Warenentleihgeschäft;
- ein Kauf-/Rückverkaufgeschäft oder Verkauf-/Rückkaufgeschäft; oder
- ein Lombardgeschäft.

Zum 31. Dezember 2017 unterhielt Vanguard Investment Series Plc ein Wertpapierleihprogramm, das als Wertpapierfinanzierungsgeschäft unter die SFT-Verordnung fällt.

Allgemeine Angaben

Zum 31. Dezember 2017 waren Wertpapiere in folgender Höhe ausgeliehen:

Fonds	Betrag	Anteil des NIW (%)	% der verleihbaren Vermögenswerte
Emerging Markets Stock Index Fund	\$ 141.178.526	1,32	2,87
European Stock Index Fund	\$ 33.854.662	0,64	0,84
Eurozone Stock Index Fund	€ 1.799.684	0,10	0,16
Global Enhanced Equity Fund	\$ 480.358	0,20	0,23

Zusätzliche Informationen vom Verwaltungsrat (ungeprüft)

Fonds	Betrag	Anteil des NIW (%)	% der verleihbaren Vermögenswerte
Global Small-Cap Index Fund	\$ 34.826.983	2,42	2,73
Global Stock Index Fund	\$ 80.837.499	0,74	0,87
Japan Stock Index Fund	€ 153.592.698	4,52	4,56
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	€ 15.861.166	0,57	1,42
SRI European Stock Fund	€ 1.435.090	0,24	0,32
SRI Global Stock Fund	\$ 875.131	0,13	0,16
U.S. 500 Stock Index Fund	\$ 1.116.218	0,02	0,02
U.S. Opportunities Fund	\$ 27615.813	1,07	1,16

Daten zur Weiterverwendung von Sicherheiten

Vanguard Investment Series Plc hat während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2017 keine erhaltenen Sicherheiten weiterverwendet.

Angaben zur Konzentration

Die folgende Tabelle zeigt die Aufteilung der Emittenten aller im Rahmen von Wertpapierfinanzierungsgeschäften vom Fonds erhaltenen Sicherungswertpapiere zum 31. Dezember 2017:

Fonds	Emittent der Sicherheit	Höhe der Sicherheit
Emerging Markets Stock Index Fund	Regierung der USA	\$ 64.431.272
Emerging Markets Stock Index Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	\$ 28.750.605
Emerging Markets Stock Index Fund	Regierung Frankreichs	\$ 25.813.015
Emerging Markets Stock Index Fund	Regierung der Niederlande	\$ 19.237.746
Emerging Markets Stock Index Fund	Regierung Deutschlands	\$ 16.741.564
European Stock Index Fund	Regierung der USA	\$ 8.971.945
European Stock Index Fund	Regierung der Niederlande	\$ 8.840.029
European Stock Index Fund	Regierung Frankreichs	\$ 7.446.414
European Stock Index Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	\$ 6.563.280
European Stock Index Fund	Regierung Deutschlands	\$ 4.277.975
Eurozone Stock Index Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	€ 889.354
Eurozone Stock Index Fund	Regierung Frankreichs	€ 596.140
Eurozone Stock Index Fund	Regierung Deutschlands	€ 207.838
Eurozone Stock Index Fund	Regierung der USA	€ 180.877
Eurozone Stock Index Fund	Regierung der Niederlande	€ 92.594
Global Enhanced Equity Fund	Regierung der USA	\$ 332.429
Global Enhanced Equity Fund	Regierung Frankreichs	\$ 89.069
Global Enhanced Equity Fund	Regierung Deutschlands	\$ 78.328
Global Enhanced Equity Fund	Regierung der Niederlande	\$ 9.525
Global Small-Cap Index Fund	Regierung Frankreichs	\$ 9.607.775
Global Small-Cap Index Fund	Regierung der USA	\$ 8.680.067
Global Small-Cap Index Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	\$ 7.884.135
Global Small-Cap Index Fund	Regierung der Niederlande	\$ 7.516.529
Global Small-Cap Index Fund	Regierung Deutschlands	\$ 6.191.721
Global Stock Index Fund	Regierung Frankreichs	\$ 29.930.282
Global Stock Index Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	\$ 24.084.462
Global Stock Index Fund	Regierung Deutschlands	\$ 13.062.258
Global Stock Index Fund	Regierung der USA	\$ 12.139.575
Global Stock Index Fund	Regierung der Niederlande	\$ 8.515.137
Japan Stock Index Fund	Regierung Frankreichs	€ 42.036.388
Japan Stock Index Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	€ 36.626.803
Japan Stock Index Fund	Regierung Deutschlands	€ 36.095.700
Japan Stock Index Fund	Regierung der USA	€ 33.306.280
Japan Stock Index Fund	Regierung der Niederlande	€ 16.969.106
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	€ 9.863.357
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Regierung der Niederlande	€ 3.604.461
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Regierung Frankreichs	€ 1.685.698
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Regierung Deutschlands	€ 968.608
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Regierung der USA	€ 582.062
SRI European Stock Fund	Regierung der USA	€ 721.499

Fonds	Emittent der Sicherheit	Höhe der Sicherheit
SRI European Stock Fund	Regierung der Niederlande	€ 571.148
SRI European Stock Fund	Regierung Frankreichs	€ 385.270
SRI European Stock Fund	Regierung Deutschlands	€ 114.275
SRI European Stock Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	€ 21.271
SRI Global Stock Fund	Regierung der USA	\$ 376.671
SRI Global Stock Fund	Regierung Frankreichs	\$ 205.585
SRI Global Stock Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	\$ 186.797
SRI Global Stock Fund	Regierung Deutschlands	\$ 145.496
SRI Global Stock Fund	Regierung der Niederlande	\$ 33.150
U.S. 500 Stock Index Fund	Regierung der USA	\$ 423.117
U.S. 500 Stock Index Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	\$ 303.365
U.S. 500 Stock Index Fund	Regierung Frankreichs	\$ 290.122
U.S. 500 Stock Index Fund	Regierung Deutschlands	\$ 159.460
U.S. 500 Stock Index Fund	Regierung der Niederlande	\$ 11.052
U.S. Opportunities Fund	Regierung der USA	\$ 12.116.583
U.S. Opportunities Fund	Regierung Frankreichs	\$ 7.143.948
U.S. Opportunities Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	\$ 4.684.566
U.S. Opportunities Fund	Regierung der Niederlande	\$ 3.916.626
U.S. Opportunities Fund	Regierung Deutschlands	\$ 3.382.355

Die folgende Tabelle zeigt die Aufteilung der Kontrahenten des Wertpapierleihprogramms zum 31. Dezember 2017:

Fonds	Kontrahent	Betrag der verliehenen Wertpapiere
Emerging Markets Stock Index Fund	Credit Suisse Group	\$ 79.751.371
Emerging Markets Stock Index Fund	UBS	\$ 25.925.326
Emerging Markets Stock Index Fund	Morgan Stanley	\$ 18.040.500
Emerging Markets Stock Index Fund	Merrill Lynch	\$ 13.134.270
Emerging Markets Stock Index Fund	Barclays	\$ 2.613.234
Emerging Markets Stock Index Fund	Citigroup	\$ 1.113.669
Emerging Markets Stock Index Fund	JP Morgan	\$ 557.654
Emerging Markets Stock Index Fund	HSBC	\$ 42.502
European Stock Index Fund	Merrill Lynch	\$ 14.835.096
European Stock Index Fund	Credit Suisse Group	\$ 10.313.473
European Stock Index Fund	UBS	\$ 4.055.997
European Stock Index Fund	JP Morgan	\$ 2.612.466
European Stock Index Fund	Barclays	\$ 1.034.897
European Stock Index Fund	Morgan Stanley	\$ 692.264
European Stock Index Fund	HSBC	\$ 310.469
Eurozone Stock Index Fund	JP Morgan	€ 1.638.441
Eurozone Stock Index Fund	Morgan Stanley	€ 161.243
Global Enhanced Equity Fund	Credit Suisse Group	\$ 480.358
Global Small-Cap Index Fund	Morgan Stanley	\$ 8.230.070
Global Small-Cap Index Fund	Credit Suisse Group	\$ 6.065.841
Global Small-Cap Index Fund	JP Morgan	\$ 5.644.049
Global Small-Cap Index Fund	Merrill Lynch	\$ 4.803.906
Global Small-Cap Index Fund	Citigroup	\$ 3.621.739
Global Small-Cap Index Fund	UBS	\$ 3.372.523
Global Small-Cap Index Fund	Barclays	\$ 1.738.819
Global Small-Cap Index Fund	Deutsche Bank	\$ 1.350.036
Global Stock Index Fund	Barclays	\$ 28.720.590
Global Stock Index Fund	Credit Suisse Group	\$ 11.756.469
Global Stock Index Fund	Merrill Lynch	\$ 10.712.541
Global Stock Index Fund	JP Morgan	\$ 9.261.742
Global Stock Index Fund	Citigroup	\$ 7.033.321
Global Stock Index Fund	UBS	\$ 5.029.821
Global Stock Index Fund	Deutsche Bank	\$ 4.346.177
Global Stock Index Fund	Morgan Stanley	\$ 3.976.838

Fonds	Kontrahent	Betrag der verliehenen Wertpapiere
Japan Stock Index Fund	JP Morgan	€ 49.926.654
Japan Stock Index Fund	Credit Suisse Group	€ 39.198.423
Japan Stock Index Fund	Merrill Lynch	€ 28.506.680
Japan Stock Index Fund	Deutsche Bank	€ 20.582.350
Japan Stock Index Fund	Citigroup	€ 13.546.520
Japan Stock Index Fund	UBS	€ 1.195.630
Japan Stock Index Fund	Morgan Stanley	€ 636.441
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	UBS	€ 9.368.747
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Merrill Lynch	€ 6.492.419
SRI European Stock Fund	Morgan Stanley	€ 976.166
SRI European Stock Fund	Credit Suisse Group	€ 415.516
SRI European Stock Fund	JP Morgan	€ 39.187
SRI European Stock Fund	Merrill Lynch	€ 4.221
SRI Global Stock Fund	Credit Suisse Group	\$ 498.101
SRI Global Stock Fund	JP Morgan	\$ 202.988
SRI Global Stock Fund	UBS	\$ 64.005
SRI Global Stock Fund	Citigroup	\$ 47.524
SRI Global Stock Fund	Morgan Stanley	\$ 40.459
SRI Global Stock Fund	Barclays	\$ 22.054
U.S. 500 Stock Index Fund	JP Morgan	\$ 558.883
U.S. 500 Stock Index Fund	Credit Suisse Group	\$ 557.335
U.S. Opportunities Fund	Credit Suisse Group	\$ 12.600.223
U.S. Opportunities Fund	JP Morgan	\$ 8.630.292
U.S. Opportunities Fund	Morgan Stanley	\$ 6.385.298

Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

Alle im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften erhaltenen Sicherheiten werden zum 31. Dezember 2017 von JPM—Securities Collateral Management gehalten.

Aggregierte Transaktionsdaten

Die folgende Tabelle zeigt die aggregierten Transaktionsdaten für die in Bezug auf das Wertpapierleihprogramm vom Fonds erhaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2017:

Fonds	Art der Sicherheit	Betrag der Sicherheit	Fitch Rating	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Emerging Markets Stock Index Fund	Anleihe	\$ 23.924	AA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Emerging Markets Stock Index Fund	Anleihe	\$ 25.789.091	AA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Emerging Markets Stock Index Fund	Anleihe	\$ 28.750.605	AA	>1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Emerging Markets Stock Index Fund	Anleihe	\$ 386.543	AAA	1 Monat bis 3 Monate	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Emerging Markets Stock Index Fund	Anleihe	\$ 109.024	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Emerging Markets Stock Index Fund	Anleihe	\$ 35.483.743	AAA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Emerging Markets Stock Index Fund	Anleihe	\$ 12.814.568	AAA	1 Woche bis 1 Monat	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Emerging Markets Stock Index Fund	Anleihe	\$ 233.817	AAA	1 Monat bis 3 Monate	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Emerging Markets Stock Index Fund	Anleihe	\$ 51.382.887	AAA	>1 Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
European Stock Index Fund	Anleihe	\$ 112.078	AA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
European Stock Index Fund	Anleihe	\$ 7.334.336	AA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
European Stock Index Fund	Anleihe	\$ 6.563.280	AA	>1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
European Stock Index Fund	Anleihe	\$ 32.173	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
European Stock Index Fund	Anleihe	\$ 13.085.831	AAA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
European Stock Index Fund	Anleihe	\$ 1.827.260	AAA	1 Woche bis 1 Monat	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
European Stock Index Fund	Anleihe	\$ 264.095	AAA	1 Monat bis 3 Monate	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
European Stock Index Fund	Anleihe	\$ 6.880.590	AAA	>1 Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Eurozone Stock Index Fund	Anleihe	€ 70.291	AA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Eurozone Stock Index Fund	Anleihe	€ 525.848	AA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Eurozone Stock Index Fund	Anleihe	€ 889.354	AA	>1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Eurozone Stock Index Fund	Anleihe	€ 275	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Eurozone Stock Index Fund	Anleihe	€ 300.157	AAA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Eurozone Stock Index Fund	Anleihe	€ 109.695	AAA	1 Woche bis 1 Monat	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party

Fonds	Art der Sicherheit	Betrag der Sicherheit	Fitch Rating	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Eurozone Stock Index Fund	Anleihe	€ 71.183	AAA	>1 Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Enhanced Equity Fund	Anleihe	\$ 89.069	AA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Enhanced Equity Fund	Anleihe	\$ 87.853	AAA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Enhanced Equity Fund	Anleihe	\$ 76.960	AAA	1 Woche bis 1 Monat	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Enhanced Equity Fund	Anleihe	\$ 255.469	AAA	>1 Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Small-Cap Index Fund	Anleihe	\$ 56.446	AA	1 Monat bis 3 Monate	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Small-Cap Index Fund	Anleihe	\$ 242.137	AA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Small-Cap Index Fund	Anleihe	\$ 9.309.192	AA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Small-Cap Index Fund	Anleihe	\$ 102.358	AA	3 Monate bis 1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Small-Cap Index Fund	Anleihe	\$ 7.781.777	AA	>1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Small-Cap Index Fund	Anleihe	\$ 1.257.068	AAA	1 Monat bis 3 Monate	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Small-Cap Index Fund	Anleihe	\$ 66.108	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Small-Cap Index Fund	Anleihe	\$ 12.385.074	AAA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Small-Cap Index Fund	Anleihe	\$ 1.349.697	AAA	1 Woche bis 1 Monat	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Small-Cap Index Fund	Anleihe	\$ 85.519	AAA	1 Monat bis 3 Monate	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Small-Cap Index Fund	Anleihe	\$ 7.244.851	AAA	>1 Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Stock Index Fund	Anleihe	\$ 181.718	AA	1 Monat bis 3 Monate	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Stock Index Fund	Anleihe	\$ 397.341	AA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Stock Index Fund	Anleihe	\$ 29.351.223	AA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Stock Index Fund	Anleihe	\$ 329.523	AA	3 Monate bis 1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Stock Index Fund	Anleihe	\$ 23.754.938	AA	>1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Stock Index Fund	Anleihe	\$ 2.441.194	AAA	1 Monat bis 3 Monate	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Stock Index Fund	Anleihe	\$ 866.899	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Stock Index Fund	Anleihe	\$ 18.269.303	AAA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Stock Index Fund	Anleihe	\$ 2.503.616	AAA	1 Woche bis 1 Monat	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Stock Index Fund	Anleihe	\$ 190.705	AAA	1 Monat bis 3 Monate	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Global Stock Index Fund	Anleihe	\$ 9.445.254	AAA	>1 Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 860.570	AA	1 Monat bis 3 Monate	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 2.141.917	AA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 39.033.901	AA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 1.560.535	AA	3 Monate bis 1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 35.066.268	AA	>1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 4.701.858	AAA	1 Monat bis 3 Monate	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 1.085	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 48.361.863	AAA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 9.622.695	AAA	1 Woche bis 1 Monat	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 507.477	AAA	1 Monat bis 3 Monate	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 23.176.108	AAA	>1 Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 1.685.698	AA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 9.863.358	AA	>1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 4.573.069	AAA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 115.578	AAA	1 Monat bis 3 Monate	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	Anleihe	€ 466.483	AAA	>1 Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI European Stock Fund	Anleihe	€ 1.681	AA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI European Stock Fund	Anleihe	€ 383.589	AA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI European Stock Fund	Anleihe	€ 21.271	AA	>1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI European Stock Fund	Anleihe	€ 1.665	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI European Stock Fund	Anleihe	€ 683.758	AAA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI European Stock Fund	Anleihe	€ 69.195	AAA	1 Woche bis 1 Monat	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI European Stock Fund	Anleihe	€ 75	AAA	1 Monat bis 3 Monate	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI European Stock Fund	Anleihe	€ 652.229	AAA	>1 Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI Global Stock Fund	Anleihe	\$ 8.708	AA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI Global Stock Fund	Anleihe	\$ 196.877	AA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI Global Stock Fund	Anleihe	\$ 186.797	AA	>1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI Global Stock Fund	Anleihe	\$ 16.495	AAA	1 Monat bis 3 Monate	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party

Fonds	Art der Sicherheit	Betrag der Sicherheit	Fitch Rating	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
SRI Global Stock Fund	Anleihe	\$ 730	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI Global Stock Fund	Anleihe	\$ 161.421	AAA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI Global Stock Fund	Anleihe	\$ 93.392	AAA	1 Woche bis 1 Monat	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
SRI Global Stock Fund	Anleihe	\$ 283.279	AAA	>1 Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
U.S. 500 Stock Index Fund	Anleihe	\$ 23.977	AA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
U.S. 500 Stock Index Fund	Anleihe	\$ 266.146	AA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
U.S. 500 Stock Index Fund	Anleihe	\$ 303.365	AA	>1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
U.S. 500 Stock Index Fund	Anleihe	\$ 170.511	AAA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
U.S. 500 Stock Index Fund	Anleihe	\$ 126.710	AAA	1 Woche bis 1 Monat	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
U.S. 500 Stock Index Fund	Anleihe	\$ 296.407	AAA	>1 Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
U.S. Opportunities Fund	Anleihe	\$ 370.251	AA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
U.S. Opportunities Fund	Anleihe	\$ 6.773.697	AA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
U.S. Opportunities Fund	Anleihe	\$ 4.684.566	AA	>1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
U.S. Opportunities Fund	Anleihe	\$ 10.888	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
U.S. Opportunities Fund	Anleihe	\$ 7.288.093	AAA	>1 Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
U.S. Opportunities Fund	Anleihe	\$ 2.596.521	AAA	1 Woche bis 1 Monat	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party
U.S. Opportunities Fund	Anleihe	\$ 9.520.062	AAA	>1 Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Tri-Party

Rendite/Kosten

Die JPMorgan Chase Bank, N.A. (Niederlassung London) wurde zur mit der Wertpapierleihe beauftragten Stelle ernannt. (Niederlassung London). Alle Erträge aus der Wertpapierleihe, mit Ausnahme einer Mindestgebühr für die mit der Wertpapierleihe beauftragte Stelle, fließen direkt in die Fonds.

Die folgende Tabelle zeigt die Aufteilung der aktuellen Erträge aus Wertpapierleihe zwischen dem betreffenden Fonds und der Wertpapierleihstelle für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017:

Fonds	Renditen	Betrag	% der Gesamrendite
Emerging Markets Stock Index Fund	An Fonds:	\$ 2.010.277	90
Emerging Markets Stock Index Fund	An Wertpapierleihstelle:	\$ 223.364	10
European Stock Index Fund	An Fonds:	\$ 1.446.645	90
European Stock Index Fund	An Wertpapierleihstelle:	\$ 160.738	10
Eurozone Stock Index Fund	An Fonds:	€ 206.123	90
Eurozone Stock Index Fund	An Wertpapierleihstelle:	€ 22.903	10
Global Enhanced Equity Fund	An Fonds:	\$ 25.470	90
Global Enhanced Equity Fund	An Wertpapierleihstelle:	\$ 2.830	10
Global Small-Cap Index Fund	An Fonds:	\$ 962.164	90
Global Small-Cap Index Fund	An Wertpapierleihstelle:	\$ 106.907	10
Global Stock Index Fund	An Fonds:	\$ 1.764.364	90
Global Stock Index Fund	An Wertpapierleihstelle:	\$ 196.040	10
Japan Stock Index Fund	An Fonds:	€ 733.013	90
Japan Stock Index Fund	An Wertpapierleihstelle:	€ 81.446	10
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	An Fonds:	€ 232.303	90
Pacific ex-Japan Stock Index Fund	An Wertpapierleihstelle:	€ 25.811	10
SRI European Stock Fund	An Fonds:	€ 192.358	90
SRI European Stock Fund	An Wertpapierleihstelle:	€ 21.373	10
SRI Global Stock Fund	An Fonds:	\$ 98.489	90
SRI Global Stock Fund	An Wertpapierleihstelle:	\$ 10.943	10
U.S. 500 Stock Index Fund	An Fonds:	\$ 41.327	90
U.S. 500 Stock Index Fund	An Wertpapierleihstelle:	\$ 4.592	10
U.S. Discoveries Fund	An Fonds:	\$ 593	90
U.S. Discoveries Fund	An Wertpapierleihstelle:	\$ 66	10
U.S. Fundamental Value Fund	An Fonds:	\$ 11.631	90
U.S. Fundamental Value Fund	An Wertpapierleihstelle:	\$ 1.292	10
U.S. Opportunities Fund	An Fonds:	\$ 168.687	90
U.S. Opportunities Fund	An Wertpapierleihstelle:	\$ 18.743	10

Bericht der Verwahrstelle an die Anteilinhaber

In unserer Funktion als Verwahrstelle der Vanguard Investment Series plc (die „Gesellschaft“) haben wir uns über die Handlungsweise der Gesellschaft im Laufe des am 31. Dezember 2017 endenden Jahres erkundigt.

Der vorliegende Bericht einschliesslich unseres Bestätigungsvermerks wurde einzig und allein für die Anteilinhaber der Gesellschaft in Übereinstimmung mit Teil 5 der Verordnungen der Europäischen Gemeinschaft (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities Regulations 2011) in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Verordnungen“) und für keinen anderen Zweck erstellt. Wir akzeptieren bzw. übernehmen durch die Abgabe dieser Beurteilung keine Verantwortung zu jeglichen anderen Zwecken oder gegenüber jeglichen anderen Personen, denen dieser Bericht gezeigt wird oder in deren Hände er gelangt.

Aufgaben der Verwahrstelle

Unsere Aufgaben und Pflichten werden in Teil 5 der OGAW-Verordnungen erklärt. Eine unserer Aufgaben besteht darin, das Geschäftsgebaren der Gesellschaft in jedem jährlichen Berichtszeitraum zu prüfen und den Anteilinhabern darüber Bericht zu erstatten.

In unserem Bericht legen wir dar, ob die Gesellschaft unseres Erachtens im jeweiligen Berichtszeitraum entsprechend den Bestimmungen der Gründungsurkunde und der Satzung der Gesellschaft sowie den OGAW-Richtlinien geführt wurde. Die Gesellschaft ist dafür verantwortlich, diese Vorschriften einzuhalten. Sollte die Gesellschaft diese nicht erfüllt haben, ist es unsere Pflicht als Verwahrstelle, anzugeben, warum dies der Fall ist, und die Schritte zu umreissen, die wir zur Korrektur dieser Situation unternommen haben.

Grundlage des Bestätigungsvermerks für die Verwahrstelle

Die Verwahrstelle nimmt diejenigen Überprüfungen vor, die sie nach ihrer berechtigten Einschätzung als erforderlich erachtet, um ihre in Teil 5 der OGAW-Verordnungen dargelegten Pflichten zu erfüllen und somit sicherzustellen, dass die Gesellschaft in allen wesentlichen Punkten:

- (i) gemäss den in der Gründungsurkunde und Satzung sowie den geltenden Vorschriften festgelegten Beschränkungen ihrer Anlage- und Kreditbefugnisse; und
- (ii) auch ansonsten im Einklang mit der Satzung und den geltenden Vorschriften geführt wurde.

Beurteilung

Nach unserer Meinung wurde die Gesellschaft in jeder wesentlichen Hinsicht während des Jahres:

- (i) im Einklang mit den Einschränkungen zu Anlagen und Kreditaufnahmen durch die Satzung und Gründungsurkunde, den OGAW-Vorschriften und den OGAW-Vorschriften der Zentralbank; und
- (ii) auch sonst gemäss den Bestimmungen der Gründungsurkunde und Satzung, der OGAW-Vorschriften und der OGAW-Vorschriften der Central Bank verwaltet.

Für und im Namen von
Brown Brother Harriman Trustee Services (Ireland) Limited
30 Herbert Street
Dublin 2
Irland

23. April 2018

Bestätigungsvermerk der unabhängigen Rechnungsprüfer an die Mitglieder von Vanguard Investment Series PLC

Bericht über die Prüfung des Abschlusses

Beurteilung

Wir sind der Ansicht, dass der Abschluss von Vanguard Investment Series plc:

- ein wahres und faires Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und der finanziellen Position der Gesellschaft und der Fonds (wie auf Seite 850 aufgeführt) zum 31. Dezember 2017 und ihrer Ergebnisse für das zu diesem Stichtag endende Geschäftsjahr widerspiegelt;
- ordnungsgemäss in Übereinstimmung mit den in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen (bestehend aus den vom Financial Reporting Council im Vereinigten Königreich erstellten und von der irischen Wirtschaftsprüfervereinigung (Institute of Chartered Accountants) veröffentlichten Rechnungslegungsstandards, u. a. dem Financial Reporting Standard 102 „The Financial Reporting Standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ sowie irischen Rechtsvorschriften) erstellt wurde; und
- nach den Bestimmungen des irischen Companies Act von 2014 sowie den European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (in der jeweils geltenden Fassung) erstellt wurde.

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

- die Vermögensaufstellung der Gesellschaft und die Vermögensaufstellung für die einzelnen Fonds zum 31. Dezember 2017;
- die Betriebsergebnisrechnung der Gesellschaft und die Betriebsergebnisrechnung für die einzelnen Fonds für das zu diesem Stichtag endende Geschäftsjahr;
- die Aufstellung der Gesellschaft über Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer, gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens und die Aufstellung der Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer, gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens für die einzelnen Fonds für das zu diesem Stichtag endende Geschäftsjahr;
- die Aufstellung der Kapitalanlagen für jeden Fonds zum 31. Dezember 2017; und
- die Erläuterungen zum Abschluss für die Gesellschaft und ihre Fonds, die eine Beschreibung der wesentlichen Rechnungslegungsgrundsätze enthalten.

Grundlage für den Bestätigungsvermerk

Wir haben unsere Prüfung nach den International Standards on Auditing (Ireland) („ISAs (Ireland)“) und den geltenden Gesetzen vorgenommen.

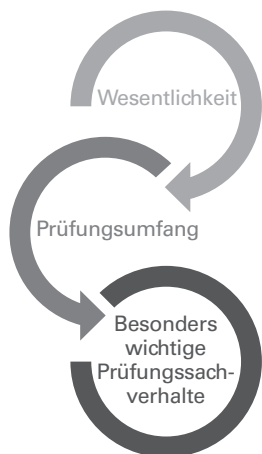
Unsere Pflichten gemäss den ISAs (Ireland) sind im Abschnitt „Pflichten der Abschlussprüfer in Bezug auf die Prüfung des Abschlusses“ in unserem Bericht näher erläutert. Nach unserer Auffassung sind die erhaltenen Prüfungsnachweise als Grundlage für die Erteilung unseres Bestätigungsvermerks ausreichend und angemessen.

Unabhängigkeit

Wir haben gemäss den in Irland für unsere Abschlussprüfung massgeblichen ethischen Anforderungen, darunter dem für börsennotierte Unternehmen von öffentlichem Interesse geltenden IAASA Ethical Standard, unsere Unabhängigkeit gegenüber der Gesellschaft gewahrt und sind unserer sonstigen ethischen Verantwortung gemäss diesen Anforderungen gerecht geworden.

Unser Prüfungsansatz

Übersicht



Wesentlichkeit

- Allgemeine Wesentlichkeit: 50 Basispunkte des Nettoinventarwerts („NIW“) zum 31. Dezember 2017 für jeden Fonds der Gesellschaft.

Prüfungsumfang

- Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und hat Vanguard Group (Ireland) Limited (der „Manager“) mit der Wahrnehmung bestimmter Aufgaben und Verantwortlichkeiten in Bezug auf die tägliche Verwaltung der Gesellschaft beauftragt. Wir haben bei der Festlegung des Umfangs unserer Abschlussprüfung die Anlagearten innerhalb der Fonds, die Einbindung der umseitig aufgeführten Dritten, die Bilanzierungsverfahren und Kontrollen sowie die Branche, in der die Gesellschaft tätig ist, berücksichtigt. Wir untersuchen jeden Fonds auf individueller Ebene.

Besonders wichtige Prüfungssachverhalte

- Vorhandensein und Bewertung der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte.

Prüfungsumfang

Im Rahmen der Planung unserer Abschlussprüfung haben wir die Wesentlichkeit festgestellt und die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen im Abschluss beurteilt. Insbesondere haben wir Bereiche untersucht, in denen der Verwaltungsrat subjektive Beurteilungen vorgenommen hat, beispielsweise die Auswahl der Kursquellen zur Bewertung des Investmentportfolios. Wie bei allen unseren Abschlussprüfungen haben wir uns auch mit dem Risiko einer Ausserkraftsetzung von Kontrollen durch das Management befasst, einschliesslich der Beurteilung, ob Nachweise für eine Einseitigkeit des Verwaltungsrats vorliegen, die ein Risiko für wesentliche falsche Darstellungen aufgrund doloser Handlungen darstellen.

Besonders wichtige Prüfungssachverhalte

Besonders wichtige Prüfungssachverhalte sind Sachverhalte, die gemäss dem fachlichen Urteil der Abschlussprüfer bei der Prüfung des Abschlusses für den aktuellen Berichtszeitraum von höchster Bedeutung waren und die bedeutendsten beurteilten Risiken wesentlicher falscher Darstellungen (sei es aufgrund doloser Handlungen oder aus anderen Gründen) umfassen, die vom Abschlussprüfer festgestellt wurden, einschliesslich der Sachverhalte, die die grössten Auswirkungen auf folgende Bereiche hatten: die allgemeine Prüfungsstrategie, die Zuteilung von Ressourcen bei der Abschlussprüfung und die Steuerung der Aktivitäten des Prüfungsteams. Diese Sachverhalte und unsere Kommentare zu den Ergebnissen der diesbezüglichen Verfahren wurden im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Abschlusses insgesamt und der Erstellung des Bestätigungsvermerks angesprochen. Wir legen in Bezug auf diese Sachverhalte keine gesonderte Stellungnahme vor. Dies ist keine vollständige Liste aller während unserer Abschlussprüfung festgestellten Risiken.

Besonders wichtiger Prüfungssachverhalt	Behandlung des besonders wichtigen Prüfungssachverhalts bei der Abschlussprüfung
<p>Vorhandensein und Bewertung der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</p> <p>Lesen Sie hierzu die Aufstellung der Kapitalanlagen und die Rechnungslegungsgrundsätze in Erläuterung 3(a).</p> <p>Die in der Vermögensaufstellung enthaltenen erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte zum 31. Dezember 2017 werden gemäss den allgemein anerkannten Rechnungsführungsgrundsätzen in Irland zum beizulegenden Zeitwert bewertet.</p> <p>Dies wird als wesentlicher Prüfungsgegenstand angesehen, da es das Hauptelement des Abschlusses darstellt.</p>	<p>Wir erhielten unabhängige Bestätigungen von der Verwahrstelle oder sonstigen Kontrahenten der zum 31. Dezember 2017 gehaltenen Investmentportfolios, die mit den in den Rechnungslegungsunterlagen ausgewiesenen Beträgen übereinstimmten.</p> <p>Wir haben die Bewertung der Investmentportfolios geprüft, indem wir die Bewertungen der Kapitalanlagen unabhängig voneinander mit den Quellen der Drittanbieter verglichen haben.</p> <p>Bei den von uns durchgeführten Verfahren wurden keine wesentlichen falschen Darstellungen festgestellt.</p>

Festlegung des Prüfungsumfangs

Wir haben den Prüfungsumfang in einer Weise festgelegt, die sicherstellt, dass die von uns durchgeführten Arbeiten ausreichend sind, um einen Bestätigungsvermerk zum Abschluss insgesamt abzugeben, unter Berücksichtigung der Struktur der Gesellschaft, Bilanzierungsverfahren und Kontrollen sowie der Branche, in der die Gesellschaft tätig ist.

Zum 31. Dezember 2017 sind 31 Fonds aktiv und 1 Fonds wurde während des Geschäftsjahres geschlossen. Die Vermögensaufstellung, die Betriebsergebnisrechnung und Veränderungen des den Inhabern zurücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens der Gesellschaft stellen eine Zusammenfassung der Positionen und Ergebnisse der 32 Fonds dar.

Der Verwaltungsrat beaufsichtigt die Geschäfte der Gesellschaft und ist verantwortlich für die allgemeine Anlagepolitik, die von ihm festgelegt wird. Die Gesellschaft hat den Manager mit der Wahrnehmung bestimmter Aufgaben und Verantwortlichkeiten in Bezug auf die tägliche Verwaltung der Gesellschaft beauftragt. Der Manager hat bestimmte Verantwortlichkeiten an The Vanguard Group Inc. (der „Investment-Manager“) sowie an Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited (die „Verwaltungsstelle“) übertragen. Der Abschluss unterliegt weiterhin der Verantwortung des Verwaltungsrats und wurde in dessen Namen von der Verwaltungsstelle erstellt. Die Gesellschaft hat Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) zur Verwahrstelle für die Vermögenswerte der Gesellschaft bestellt. Bei der Festlegung unseres Prüfungsansatzes haben wir das Risiko wesentlicher falscher Darstellungen auf Fondsebene unter Berücksichtigung der Art, Wahrscheinlichkeit und potenziellen Grössenordnung falscher Darstellungen beurteilt. Im Rahmen unserer Risikobeurteilung haben wir die Zusammenarbeit der Gesellschaft mit der Verwaltungsstelle untersucht und das Kontrollumfeld der Verwaltungsstelle beurteilt.

Wesentlichkeit

Der Prüfungsumfang wurde durch die Anwendung der Wesentlichkeit beeinflusst. Wir haben bestimmte quantitative Schwellenwerte für die Wesentlichkeit festgelegt. Zusammen mit qualitativen Erwägungen halfen uns diese Schwellenwerte, den Prüfungsumfang und die Art, die Terminierung und das Ausmass der Prüfungshandlungen der Einzelposten und Abschlussangaben festzulegen und die Auswirkungen falscher Darstellungen auf den Abschluss insgesamt zu bewerten, sowohl einzeln als auch in ihrer Gesamtheit.

Aufgrund unseres fachlichen Urteils haben wir die Wesentlichkeit der Abschlüsse für die einzelnen Fonds der Gesellschaft wie folgt festgelegt:

<i>Die allgemeine Wesentlichkeit und ihre Festlegung</i>	50 Basispunkte (2016: 50 Basispunkte) des NIW zum 31. Dezember 2017 für jeden Fonds der Gesellschaft
<i>Begründung der angewandten Benchmark</i>	Wir haben diese Benchmark verwendet, weil das Hauptziel der Gesellschaft darin besteht, den Anlegern eine Gesamtrendite auf Fondsebene zu bieten, die Kapital- und Ertragsrenditen enthält.

Wir haben mit dem Prüfungsausschuss vereinbart, dass wir falsche Darstellungen, die wir im Rahmen unserer Prüfung festgestellt haben und die mehr als 5 Basispunkte des NIW des jeweiligen Fonds betragen, sofern sich die Abweichungen auf den NIW je Anteil auswirken (2016: 5 Basispunkte des NIW des jeweiligen Fonds, sofern sich die Abweichungen auf den NIW je Anteil auswirken) an den Prüfungsausschuss melden, sowie falsche Darstellungen unterhalb dieser Schwelle, deren Meldung nach unserer Ansicht aus qualitativen Gründen gerechtfertigt war.

Schlussfolgerungen in Bezug auf die Unternehmensfortführung

Wir haben nichts im Hinblick auf die folgenden Belange zu berichten, hinsichtlich derer wir gemäss den ISAs (Irland) Bericht erstatten müssen, wenn:

- der vom Verwaltungsrat bei der Erstellung des Abschlusses angewandte Grundsatz der Unternehmensfortführung nicht angemessen ist, oder
- der Verwaltungsrat eventuell festgestellte wesentliche Unsicherheitsfaktoren, die erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft aufwerfen, den Grundsatz der Unternehmensfortführung bei der Rechnungslegung für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab dem Datum, an dem der Abschluss zur Veröffentlichung genehmigt wird, weiterhin anzuwenden, im Abschluss nicht offengelegt hat.

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

Berichterstattung über sonstige Informationen

Die sonstigen Informationen umfassen alle im Jahresbericht enthaltenen Informationen, die nicht zum Abschluss und unserem diesbezüglichen Prüfungsbericht gehören. Für die sonstigen Informationen ist der Verwaltungsrat verantwortlich. Unser Bestätigungsvermerk zum Abschluss bezieht sich nicht auf die sonstigen Informationen. Dementsprechend geben wir diesbezüglich keinerlei Prüfungsurteil oder Garantie ab, sofern dies nicht an anderer Stelle in diesem Bericht ausdrücklich vermerkt ist. In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses sind wir dafür verantwortlich, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob die sonstigen Informationen wesentlich im Widerspruch zum Abschluss oder zu unserem bei der Abschlussprüfung erlangten Wissen stehen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Wenn wir einen offensichtlichen wesentlichen Widerspruch oder eine wesentliche falsche Darstellung feststellen, sind wir verpflichtet, entsprechende Verfahren durchzuführen, um zu ermitteln, ob eine wesentliche falsche Darstellung in Bezug auf den Abschluss oder die sonstigen Informationen vorliegt. Wenn wir aufgrund der von uns durchgeführten Tätigkeiten zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, müssen wir über diese Tatsache berichten. In Bezug auf diese Pflichten haben wir nichts zu berichten.

Im Hinblick auf den Bericht des Verwaltungsrats haben wir auch geprüft, ob die gemäss dem Companies Act 2014 erforderlichen Angaben enthalten sind.

Aufgrund der oben beschriebenen Pflichten und unserer Tätigkeiten im Rahmen der von uns durchgeführten Prüfung des Abschlusses sind wir darüber hinaus gemäss den ISAs (Irland) und dem Companies Act 2014 verpflichtet, über bestimmte Ansichten und Angelegenheiten zu berichten, wie nachstehend erläutert:

- Unserer Ansicht nach und auf Basis unserer Tätigkeiten im Rahmen der von uns durchgeführten Prüfung stimmen die im Bericht des Verwaltungsrats für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017 enthaltenen Informationen mit dem Abschluss überein. Der Bericht wurde gemäss den geltenden gesetzlichen Vorschriften erstellt.
- Auf der Grundlage unseres Wissens und unserer Kenntnisse über die Gesellschaft und ihr Umfeld, die wir im Laufe unserer Prüfung des Abschlusses erlangt haben, konnten wir keine wesentlichen falschen Darstellungen im Bericht des Verwaltungsrats feststellen.

Zuständigkeiten für den Abschluss und die Prüfung

Pflichten des Verwaltungsrats in Bezug auf den Abschluss

Wie im Bericht über die Pflichten des Verwaltungsrats auf Seite 885 ausführlicher erläutert, ist der Verwaltungsrat verantwortlich für die Erstellung des Abschlusses gemäss dem geltenden Rahmenwerk und dafür, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt.

Weiterhin ist der Verwaltungsrat verantwortlich für die internen Kontrollen, die seiner Ansicht nach erforderlich sind, um die Erstellung eines Abschlusses zu ermöglichen, der frei von aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultierenden wesentlichen falschen Darstellungen ist.

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

Pflichten der Abschlussprüfer in Bezug auf die Prüfung des Abschlusses

Unser Ziel ist es, eine angemessene Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss insgesamt frei von aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultierenden wesentlichen falschen Darstellungen ist. Die angemessene Sicherheit stellt einen hohen Grad an Sicherheit dar, ist jedoch keine Garantie dafür, dass bei einer gemäss den ISAs (Irland) durchgeführten Prüfung bestehende wesentliche falsche Darstellungen immer aufgedeckt werden. Falsche Darstellungen können durch dolose Handlungen oder Irrtümer entstehen und gelten als wesentlich, wenn vernünftigerweise erwartet werden kann, dass sie einzeln oder insgesamt die wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen, die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffen werden.

Eine nähere Beschreibung unserer Pflichten in Bezug auf die Prüfung des Abschlusses finden Sie auf der Website der IAASA unter: https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf. Diese Beschreibung ist Teil unseres Prüfungsberichts.

Verwendung dieses Berichts

Dieser Bestätigungsvermerk einschliesslich der Beurteilung wurde einzig und alleine für die Mitglieder der Gesellschaft als Körperschaft im Einklang mit Abschnitt 391 des Companies Act von 2014 und zu keinem anderen Zweck erstellt. Wir akzeptieren bzw. übernehmen durch die Abgabe dieser Beurteilung keine Verantwortung zu jeglichen anderen Zwecken oder gegenüber jeglichen anderen Personen, denen dieser Bericht gezeigt wird oder in deren Hände er gelangt, es sei denn, es ist vorher eine ausdrückliche schriftliche Zustimmung unsererseits erfolgt.

Sonstige meldepflichtige Angaben

Companies Act 2014 - Stellungnahmen zu sonstigen Angelegenheiten

- Wir haben alle Informationen und Erklärungen eingeholt, die wir für unsere Rechnungsprüfung für notwendig erachten.
 - Nach unserer Ansicht waren die Geschäftsbücher der Gesellschaft ausreichend, um eine schnelle und ordnungsgemässe Prüfung des Abschlusses zu ermöglichen.
 - Der Abschluss stimmt mit den Geschäftsbüchern überein.
-

Companies Act 2014 - Exception Reporting

Vergütung und Geschäfte der Verwaltungsratsmitglieder

Gemäss dem Companies Act von 2014 müssen wir Sie informieren, wenn nach unserer Einschätzung die in Abschnitt 305 bis 312 dieses Act dargelegten Angaben über die Vergütung und Geschäfte der Verwaltungsratsmitglieder nicht gemacht wurden. Wir haben keine Ausnahmen zu melden, die aus dieser Verantwortung entstehen.

Declan Murphy

für und im Namen von PricewaterhouseCoopers
Beeidigte Wirtschaftsprüfer und Abschlussprüfungsgesellschaft
Dublin
23. April 2018

Glossar der Anlagebegriffe

Durchschnittlicher Kupon. Der durchschnittliche Zinssatz, der auf die festverzinslichen Wertpapiere im Bestand eines Fonds gezahlt wird. Dieser Zinssatz wird als Prozentsatz des Nennwerts ausgedrückt.

Durchschnittliche Duration. Eine Schätzung, wie sehr der Wert der Anleihen im Bestand eines Fonds in Folge einer Änderung der Zinssätze schwanken wird. Um zu sehen, wie sich der Wert verändern könnte, multipliziert man die durchschnittliche Duration des Fonds mit der Änderung der Zinssätze. Steigen die Zinssätze um einen Prozentpunkt, würde der Wert der Anleihen in einem Fonds mit einer durchschnittlichen Duration von fünf Jahren um ca. 5 % fallen. Gehen die Zinssätze um einen Prozentpunkt zurück, würde der Wert um ca. 5 % steigen.

Durchschnittliche effektive Fälligkeit. Die durchschnittliche Zeitspanne, bis festverzinsliche Wertpapiere im Bestand eines Fonds ihre Fälligkeit erreichen und zurückgezahlt werden, unter Berücksichtigung der Möglichkeit, dass der Emittent die Anleihe eventuell vor ihrem Fälligkeitsdatum kündigt. Diese Zahl spiegelt den proportionalen Anteil am Fondsvermögen, der von jedem Wertpapier repräsentiert wird, sowie etwaige, im Bestand befindliche Terminkontrakte wider. Generell gilt, je länger die durchschnittliche effektive Laufzeit ist, desto mehr wird der Kurs der Anteile eines Fonds in Folge von Änderungen der Marktzinssätze schwanken.

Durchschnittliche Qualität. Ein Indikator für das Kreditrisiko. Diese Zahl ist der Durchschnitt der Bewertungen, die den festverzinslichen Wertpapieren im Bestand eines Fonds von Rating-Agenturen zugewiesen werden. Die Agenturen treffen ihre Entscheidung, nachdem sie die Fähigkeit des Emittenten, seinen Verpflichtungen nachzukommen, eingestuft haben. Die Bonität wird anhand einer Skala bewertet, wobei Aaa bzw. AAA Anleiheemittenten mit der höchsten Kreditwürdigkeit bezeichnen.

Durchschnittliche gewichtete Fälligkeit. Die durchschnittliche Zeitspanne, bis festverzinsliche Wertpapiere im Bestand eines Fonds ihre Fälligkeit erreichen und zurückgezahlt werden. Diese Zahl reflektiert den proportionalen Anteil am Fondsvermögen, der von jedem Wertpapier repräsentiert wird.

Beta. Ein Mass für die Grössenordnung der vergangenen Kursschwankungen eines Fonds im Verhältnis zu Auf- und Abwärtsbewegungen eines bestimmten Marktindex. Dem Index wird ein Betafaktor von 1,00 zugewiesen. Im Vergleich zu einem bestimmten Index hätte ein Fonds mit einem Betafaktor von 1,20 normalerweise einen Anstieg oder Rückgang seines Kurses um 12 % erfahren, wenn der Index um 10 % gestiegen oder gefallen wäre. Zum Zweck dieses Berichts basiert der Betafaktor sowohl für den Fonds als auch für den Index auf den Anlageerträgen der letzten 36 Monate. Bitte beachten Sie, dass der Betafaktor eines Fonds in Verbindung mit der Grösse R-Squared (siehe Definition weiter unten) überprüft werden sollte. Je niedriger der Wert von R-Squared, desto geringer ist die Korrelation zwischen dem Fonds und dem Index und desto weniger zuverlässig ist der Betafaktor als Indikator für die Volatilität.

Kreditqualität. Die Kreditbeurteilung für festverzinsliche Wertpapiere stellt einen Hinweis auf das Risiko dar. Sie stellt die Einstufung einer Rating-Agentur der Fähigkeit des Emittenten dar, seinen Verpflichtungen nachzukommen. Zum Zweck dieses Abschlusses stammen die Kreditqualitäts-Einstufungen für die verschiedenen Emissionen von Moody's Investors Service.

Handelstag. Jeder Tag, an dem ein Teilfonds Zeichnungs-, Rücknahme- und Umtauschanträge akzeptiert, und/oder jeder andere Tag oder alle anderen Tage, die vom Manager festgelegt und den Anteilinhabern vorab mitgeteilt werden.

Ertragswachstumsrate. Die durchschnittliche jährliche Wachstumsrate der Erträge über die vergangenen fünf Jahre für die sich gegenwärtig im Bestand eines Fonds befindlichen Aktien.

Auflegungsdatum. Das Datum, an dem die Vermögenswerte eines Fonds (oder eine seiner Anteilsklassen) erstmalig gemäss dem Anlageziel des Fonds angelegt werden. Im Falle von Fonds mit Zeichnungsfristen entspricht das Auflegungsdatum dem Tag nach Ablauf dieser Frist. Die Wertentwicklung der Anlagen wird ab dem Auflegungsdatum gemessen.

Mittlere Marktkapitalisierung. Ein Indikator für die Grösse der Unternehmen, in die ein Fonds investiert. Der Mittelwert der Marktkapitalisierung (Marktkurs x ausgegebene Aktien) der Aktien eines Fonds, gewichtet nach dem Anteil des Fondsvermögens, das in jede Aktie investiert ist. Aktien, die eine Hälfte des Fondsvermögens ausmachen, haben eine über dem Mittelwert liegende Marktkapitalisierung; die restlichen Aktien liegen darunter.

Nicht-US-Positionen. Der Prozentsatz des Fondsvermögens, das in Aktien oder American Depositary Receipts von Unternehmen mit Sitz ausserhalb der USA investiert ist.

Ausgewiesene laufende Kosten. Die Summe der jährlichen betrieblichen Aufwendungen des Fonds als Prozentsatz des durchschnittlichen Nettovermögens des Fonds. Die Kostenquote umfasst Management- und Verwaltungsaufwendungen, beinhaltet jedoch nicht die Transaktionskosten für den Kauf und Verkauf von Wertpapieren des Portfolios.

Kurs-Buchwert-Verhältnis. Der Kurs einer Aktie geteilt durch ihren Nettowert bzw. Buchwert je Aktie. Für einen Fonds ist dieser Wert das gewichtete durchschnittliche Kurs/Buch-Verhältnis der Aktien in seinem Bestand.

Kurs-Gewinn-Verhältnis. Das Verhältnis des aktuellen Kurses zum Gewinn je Aktie über das vergangene Jahr. Für einen Fonds ist dies das gewichtete durchschnittliche KGV der Aktien in seinem Bestand. Das KGV ist ein Indikator für die Erwartungen an die Entwicklung eines Unternehmens: Je höher das KGV ist, desto grösser sind die Erwartungen an das künftige Wachstum eines Unternehmens.

R-Squared. Ein Mass dafür, inwieweit die vergangenen Renditen eines Fonds durch die Renditen des Marktes insgesamt (gemessen an einem bestimmten Index) erklärt werden können. Wären die Gesamrenditen eines Fonds und die Renditen eines Index völlig synchron, betrüge sein R-Squared 1,00. Wenn die Renditen des Fonds keine Beziehung zu denen des Index hätten, wäre sein R-Squared 0. Zum Zweck dieses Berichts basiert R-Squared sowohl für den Fonds als auch für den Index auf den Anlageerträgen der letzten 36 Monate.

Eigenkapitalrendite. Die jährliche durchschnittliche Rendite, die ein Unternehmen in den letzten fünf Jahren für jeden Dollar Aktienkapital erwirtschaftet hat (Nettogewinn geteilt durch Aktienkapital). Für einen Fonds ist dies die gewichtete durchschnittliche Eigenkapitalrendite für die Unternehmen, deren Aktien sich in seinem Bestand befinden.

Kurzfristige Reserven. Der prozentuale Anteil eines Fonds, der in hochliquide, kurzfristige Wertpapiere investiert ist, die ohne weiteres in Bargeld umgewandelt werden können.

Portfolioumschlag. Ein Indikator der Handelsaktivität des Fonds. Fonds mit einem hohen Portfolioumschlag sind mit höheren Transaktionskosten verbunden. Transaktionen in natura sind vom Portfolioumschlag ausgenommen, da sie sich nur minimal auf die Kosten auswirken.

Rendite. Der aktuelle annualisierte Dividendensatz, der auf eine Aktie gezahlt wird, geteilt durch ihren aktuellen Aktienkurs. Für einen Fonds ist dies die durchschnittliche gewichtete Rendite der Aktien in seinem Bestand. Für den Vanguard U.S. Ultra-Short-Term Bond Fund wird die Rendite als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des Fonds ausgedrückt, die auf in den letzten 30 Tagen erwirtschafteten Erträgen basiert, annualisiert wird oder für das kommende Jahr prognostiziert wiedergegeben wird.

Rendite auf Endfälligkeit. Die Rendite, die ein Anleger erhalten würde, wenn die festverzinslichen Wertpapiere im Bestand eines Fonds bis zu ihren Fälligkeitsterminen gehalten würden.

VANGUARD INVESTMENT SERIES PLC

Zusätzliche Informationen für Anleger in der Schweiz

Diese zusätzlichen Informationen für Anleger in der Schweiz sind Bestandteil des Jahresberichtes vom 31. Dezember 2017 und sind zusammen mit dem Prospekt der Vanguard Investment Series Plc (im Weiteren die „Gesellschaft“) und allen Anhängen, Ergänzungen und Nachträgen zu lesen.

1. SCHWEIZER VERTRETER UND ZAHLSTELLE

BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, CH-8002 Zürich.

Kopien des Prospekts, das Dokument mit wesentlichen Informationen für den Anleger, der Satzung der Gesellschaft, etwaiger späterer Neufassungen der vorstehenden Dokumentation, des aktuellen Jahresberichts und –abschlusses der Gesellschaft oder, sofern jüngeren Datums, deren Zwischenbericht und –abschluss können kostenlos beim Geschäftssitz des Schweizer Vertreters bezogen werden.

2. GESAMTKOSTENQUOTE (TOTAL EXPENSE RATIO, TER)

Alle im Abschnitt Fondsprofil des Berichts ausgewiesenen Gesamtkostenquoten (TER) wurden im Einklang mit den Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER vom 16. Mai 2008 der Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA) berechnet. Die Berechnungsmethode entspricht der in Irland angewandten Methode. Da die Gesellschaft dem irischen Recht unterliegt, wird die nach den SFAMA-Richtlinien berechnete TER ausschliesslich zu Informationszwecken angegeben. Alle Abweichungen beschränken sich in der Regel auf Rundungsdifferenzen.

Die TER wurde für jedes Segment („Teilfonds“) bzw. jede Anteilsklasse zum 31. Dezember 2017 berechnet.

Abhängig von der Transaktion werden die Transaktionskosten mit dem Anschaffungswert der Effekten oder separat in der Umsatzabrechnung ausgewiesen. Diese Kosten, die gemäss den Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER nicht zu Betriebsaufwendungen gehören, werden bei der Berechnung der TER nicht berücksichtigt.

3. PERFORMANCE DES FONDS UND PORTFOLIOUMSCHLAG

Die Fondsp performance wurde gemäss den Richtlinien der SFAMA für die Berechnung und Offenlegung der Fondsp performance vom 16. Mai 2008 berechnet. Die historischen Performance-Daten geben keine Hinweise auf die aktuelle oder künftige Wertentwicklung. Diese Performance-Daten beinhalten keine Gebühren und Kosten, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen entstehen.

Die Fondsp performance zum 31. Dezember 2017 wird im Abschnitt Überblick über die Wertentwicklung des Berichts dargestellt.

Der Portfolioumschlag (PTR) wurde im Einklang mit den Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung des PTR der SFAMA vom 16. Mai 2008 berechnet und wird separat für jeden Teilfonds ausgewiesen.

4. ÄNDERUNGEN DER ZUSAMMENSETZUNG DES WERTPAPIERPORTFOLIOS

Eine Übersicht über die Änderungen der Zusammensetzung des Wertpapierportfolios während des Berichtszeitraums (01. Januar 2017 bis 31. Dezember 2017) kann kostenlos beim Schweizer Vertreter bezogen werden.

5. RÜCKERSTATTUNGEN

Für institutionelle Anleger werden gemäss den Ausführungen im irischen Recht Rückerstattungen gezahlt.

BLOOMBERG ist eine Marke und Dienstleistungsmarke von Bloomberg Finance L.P. BARCLAYS ist eine Marke und Dienstleistungsmarke von Barclays Bank Plc, die unter Lizenz verwendet wird. Bloomberg Finance L.P. und dessen verbundene Unternehmen, einschliesslich Bloomberg Index Services Limited (BISL) (zusammen Bloomberg), oder die Lizenzgeber von Bloomberg, besitzen sämtliche Eigentumsrechte an folgenden Indizes: Bloomberg Barclays Euro Treasury 20+ Year Bond Index, Bloomberg Barclays Euro Government Float Adjusted Bond Index, Bloomberg Barclays EUR Non-Government Float Adjusted Bond Index, Bloomberg Barclays Global Inflation-Linked: Eurozone – Euro CPI Index, Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Bond Index, Bloomberg Barclays Global Aggregate Float Adjusted Corporate Index Hedged, Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index Hedged, Bloomberg Barclays Global Aggregate Ex US MBS 1–5 Year Float Adjusted Bond Index, Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate 1–5 Year Float Adjusted Index, Bloomberg Barclays Japan Government Float Adjusted Bond Index, Bloomberg Barclays U.K. Government Float Adjusted Bond Index, Bloomberg Barclays GBP Non-Government Float Adjusted Bond Index, Bloomberg Barclays GBP Non-Government 1–5 Year 200MM Float Adjusted Bond Index, Bloomberg Barclays U.S. Government Float Adjusted Bond Index, Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Credit Float Adjusted Bond Index und Bloomberg Barclays U.S. Government Inflation-Linked 1–10 Year Index (die „Indizes“ oder „Bloomberg Barclays Indizes“).

Weder Barclays Bank PLC, Barclays Capital Inc., noch verbundene Unternehmen (gemeinsam „Barclays“) oder Bloomberg sind Emittent oder Produzent der Vanguard-Fonds, und weder Bloomberg, noch Barclays haben Verantwortung, Verpflichtungen oder Aufgaben gegenüber Anlegern der Vanguard-Fonds. Die Indizes sind für die Verwendung durch The Vanguard Group, Inc. (Vanguard) als Sponsor der Vanguard-Fonds lizenziert. Die einzige Beziehung von Bloomberg und Barclays zu Vanguard im Hinblick auf die Indizes ist die Lizenzierung der Indizes, die von BISL oder einem ihrer Nachfolger ohne Berücksichtigung des Emittenten oder der Vanguard-Fonds oder der Eigentümer der Vanguard-Fonds festgelegt, zusammengestellt und berechnet werden.

Darüber hinaus kann Vanguard eigene Geschäfte mit Barclays bezüglich der Indizes in Verbindung mit den Vanguard-Fonds tätigen. Anleger erwerben die Vanguard-Fonds von Vanguard und Anleger erwerben weder eine Beteiligung an den Indizes noch gehen sie im Rahmen der Anlage in die Vanguard-Fonds irgendeine Beziehung mit Bloomberg oder Barclays ein. Die Vanguard-Fonds werden von Bloomberg oder Barclays

weder gesponsert noch unterstützt, verkauft oder gefördert. Weder Bloomberg noch Barclays machen Zusagen und geben Garantien, weder ausdrücklich noch stillschweigend, hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in die Vanguard-Fonds, hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder hinsichtlich der Fähigkeit der Indizes, die jeweilige oder relative Entwicklung des Marktes nachzubilden. Weder Bloomberg noch Barclays nehmen Stellung zur Rechtmässigkeit oder Eignung der Vanguard-Fonds für eine Person oder Körperschaft. Weder Bloomberg noch Barclays sind verantwortlich für die und waren beteiligt an der Festlegung des Zeitpunkts, der Preise oder der Anzahl der auszugebenden Anteile der Vanguard-Fonds. Weder Bloomberg noch Barclays sind verpflichtet, die Bedürfnisse des Emittenten oder der Eigentümer der Vanguard-Fonds oder anderer Dritter bei der Festlegung, Zusammensetzung oder Berechnung der Indizes zu berücksichtigen. Weder Bloomberg noch Barclays haben eine Verpflichtung oder Haftung in Verbindung mit der Verwaltung bzw. Vermarktung der Vanguard-Fonds.

Die Lizenzvereinbarung zwischen Bloomberg und Barclays dient ausschliesslich den Interessen von Bloomberg und Barclays und nicht den Interessen der Eigentümer der Vanguard-Fonds, der Anleger oder Dritter. Darüber hinaus dient die Lizenzvereinbarung zwischen Vanguard und Bloomberg ausschliesslich den Interessen von Vanguard und Bloomberg und nicht den Interessen der Eigentümer der Vanguard-Fonds, der Anleger oder Dritter.

WEDER BLOOMBERG NOCH BARCLAYS HAFTEN GEGENÜBER DEM EMITTENTEN, ANLEGERN ODER SONSTIGEN DRITTEN FÜR DIE QUALITÄT, RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DER BLOOMBERG BARCLAYS -INDIZES ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ODER FÜR UNTERBRECHUNGEN BEI DER BEREITSTELLUNG DER BLOOMBERG BARCLAYS-INDIZES. WEDER BLOOMBERG NOCH BARCLAYS GEBEN EINE AUSDRÜCKLICHE ODER IMPLIZITE GARANTIE HINSICHTLICH DER VOM EMITTENTEN, DEN ANLEGERN ODER ANDEREN PERSONEN ODER GESELLSCHAFTEN DURCH DIE NUTZUNG DER BLOOMBERG BARCLAYS INDIZES ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. BLOOMBERG UND BARCLAYS GEBEN KEINE GARANTIE, WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH IMPLIZIT, UND LEHNEN HIERMIT JEGLICHE GARANTIE HINSICHTLICH DER MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINSATZ FÜR DIE BLOOMBERG BARCLAYS INDIZES ODER DARIN ENTHALTENE DATEN AB. BLOOMBERG BEHÄLT SICH DAS RECHT VOR, DIE METHODEN DER BERECHNUNG ODER VERÖFFENTLICHUNG ZU ÄNDERN ODER DIE BERECHNUNG ODER VERÖFFENTLICHUNG DER BLOOMBERG BARCLAYS INDIZES EINZUSTELLEN, UND WEDER BLOOMBERG NOCH BARCLAYS IST HAFTBAR FÜR FEHLERHAFTRE BERECHNUNGEN ODER FALSCHER, VERSPÄTETER ODER UNTERBROCHENER VERÖFFENTLICHUNGEN IN BEZUG AUF DIE BLOOMBERG BARCLAYS INDIZES. BLOOMBERG UND BARCLAYS HAFTEN NICHT FÜR SCHÄDEN, INSBESONDERE SPEZIELLE, INDIREKTE ODER FOLGESCHÄDEN, ODER FÜR ENTGANGENE GEWINNE, SELBST WENN SIE VON DER MÖGLICHKEIT SOLCHER IN KENNNTNIS GEGESATZT WURDEN, DIE AUS DER NUTZUNG DER BLOOMBERG BARCLAYS INDIZES ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ODER IM HINBLICK AUF DIE VANGUARD-FONDS ENTSTEHEN.

Keine der von Bloomberg oder Barclays bereitgestellten und in dieser Publikation verwendeten Informationen darf in irgendeiner Art ohne vorherige schriftliche Genehmigung durch Bloomberg und Barclays, dem Geschäftsbereich Investment Banking der Barclays Bank PLC, reproduziert werden. Barclays Bank PLC ist in England unter der Nr. 1026167 registriert. Eingetragener Sitz 1 Churchill Place London E14 5HP.

© 2018 Bloomberg. Autorisierte Verwendung.

Quelle: Bloomberg Index Services Limited. Copyright 2018, Bloomberg. Alle Rechte vorbehalten.

Diese Seite wurde absichtlich leer gelassen.

Diese Seite wurde absichtlich leer gelassen.

Verwaltungsrat

Peter Blessing¹ (Irland)
Michael S. Miller (USA)
James M. Norris (USA)
Axel Lomholt (Dänemark)
William Slattery (Irland)
Sean P. Hagerty³ (USA)
Tara Doyle^{1,4} (Irland)

Manager

Vanguard Group (Ireland) Limited
70 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Irland

Investment-Manager bis zum 14. Januar 2018

The Vanguard Group, Inc.
P.O. Box 2600
Valley Forge, PA 19482
USA

Investment-Manager ab dem 15. Januar 2018

Vanguard Global Advisors, LLC
P.O. Box 2600
Valley Forge, PA 19482
USA

Sponsernder irischer Börsenmakler

J & E Davy
Davy House
49 Dawson Street
Dublin 4
Irland

Verwahrstelle

Brown Brothers Harriman
Trustee Services (Ireland) Limited
30 Herbert Street
Dublin 2
Irland

Verwaltungsstelle

Brown Brothers Harriman
Fund Administration Services (Ireland) Limited
30 Herbert Street
Dublin 2
Irland

Gesellschaftssekretär

Matsack Trust Limited
70 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Irland

Rechtsberater für Angelegenheiten irischen Rechts

Matheson
70 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Irland

Unabhängige Rechnungsprüfer

PricewaterhouseCoopers
One Spencer Dock
North Wall Quay
Dublin 1
Irland

1 Agierten im Berichtszeitraum in einer unabhängigen, nicht geschäftsführenden Funktion.

2 Thomas M. Rampulla schied am 9. Juni 2017 als Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und des Managers aus.

3 Sean P. Hagerty wurde am 9. Juni 2017 zum Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und des Managers bestellt.

4 Tara Doyle wurde am 3. Oktober 2017 zum Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und des Managers bestellt.



Brown Brothers Harriman
Fund Administration Services
(Ireland) Limited
30 Herbert Street
Dublin 2
Irland

Treten Sie in Kontakt mit Vanguard® > vanguard.com

Informationen und Betreuung der Anleger (Irland)

Fax: +353-1-612-3067
Telefon: +353-1-612-3226

World Wide Web

<http://global.vanguard.com>

Dieser Bericht richtet sich an die Anteilhaber der Fonds. Er darf interessierten Anlegern nur dann ausgehändigt werden, wenn ihm der aktuelle Prospekt der Gesellschaft beiliegt oder dieser vorab erhalten wurde.

Wenn nicht anderweitig vermerkt, stammen alle vergleichenden Daten zu offenen Investmentfonds von Lipper, eine Thomson Reuters-Gesellschaft, oder Morningstar Inc.

Zu den Unternehmen der London Stock Exchange Group gehören FTSE International Limited („FTSE“), Frank Russell Company („Russell“), MTS Next Limited („MTS“) und FTSE TMX Global Debt Capital Markets Inc. („FTSE TMX“). Alle Rechte vorbehalten. „FTSE®“, „Russell®“, „MTS®“, „FTSE TMX®“ und „FTSE Russell“ und andere Dienstleistungsmarken und Handelsmarken in Zusammenhang mit dem FTSE- oder Russell-Index sind Marken der Unternehmen der London Stock Exchange Group und werden von FTSE, MTS, FTSE TMX und Russell unter Lizenz verwendet. Alle Informationen werden ausschliesslich zu Informationszwecken bereitgestellt. Die Unternehmen der London Stock Exchange Group und deren Lizenzgeber können keine Verantwortung oder Haftung für Fehler oder aus der Verwendung dieser Veröffentlichung entstehende Verluste übernehmen. Die Gesellschaften der London Stock Exchange Group und ihre Lizenzgeber geben keinerlei Behauptungen, Prognosen, Zusicherungen oder Stellungnahmen, weder ausdrücklich noch implizit zu den Ergebnissen ab, die durch die Nutzung des FTSE Developed Index oder des FTSE Developed Europe Index erzielbar sind, oder zur Tauglichkeit oder Eignung des FTSE Developed Index oder des FTSE Developed Europe Index für einen bestimmten Zweck, für den sie genutzt werden können.

Die hierin genannten Fonds oder Wertpapiere werden von MSCI weder gesponsert noch unterstützt oder gefördert. MSCI übernimmt zudem keine Haftung in Bezug auf solche Fonds oder Wertpapiere. Der Prospekt oder die Zusatzinformationen beinhalten eine detailliertere Beschreibung der begrenzten Beziehung, die MSCI mit Vanguard und den betreffenden Fonds unterhält.

Der S&P 500 Index ist ein Produkt von S&P Dow Jones Indices LLC („SPDJ“) und wurde zur Verwendung durch Vanguard lizenziert. Standard & Poor's® und S&P® sind eingetragene Marken von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“); Dow Jones® ist eine eingetragene Marke von Dow Jones Trademark Holdings LLC („Dow Jones“); S&P® und S&P 500® sind Marken von S&P, und diese Marken wurden von den Scharia-Fonds für die Verwendung von SPDJI lizenziert und für bestimmte Zwecke von Vanguard unterlizenziert. Das Produkt von Vanguard wird von SPDJI, Dow Jones, S&P oder deren jeweiligen verbundenen Unternehmen nicht gesponsert, befürwortet, verkauft oder gefördert, und keine dieser Parteien macht Zusagen bezüglich der Ratsamkeit einer Anlage in ein solches Produkt oder haftet für Fehler, Unterlassungen oder Unterbrechungen des S&P 500 Index.