

ZWISCHENBERICHT UND UNGEPRÜFTER ABSCHLUSS
SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE
30. SEPTEMBER 2019

THREADNEEDLE (LUX)

Inhalt

Informationen zur Gesellschaft	4	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	44
Shariah-Prüfbericht	5	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	46
Abschluss:		Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	48
Konsolidierte Jahresabschlüsse für Threadneedle (Lux)	7	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	49
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond*	8	Threadneedle (Lux) - European Select	51
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	9	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	53
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	11	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	54
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	12	Threadneedle (Lux) - Global Technology	55
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	14	Threadneedle (Lux) - UK Equities	56
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	15	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	58
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	16	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	60
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	17	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	61
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	18	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	62
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	19	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	64
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	20	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	66
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	21	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	67
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	22	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	69
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	23	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	70
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	24	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	71
Threadneedle (Lux) - Global Focus	26	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	73
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	27	Aufstellungen der Wertpapieranlage:	
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	28	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	74
Threadneedle (Lux) - Global Select	30	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	80
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	31	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	85
Threadneedle (Lux) - American	32	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	92
Threadneedle (Lux) - American Select	34	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	96
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	36	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	101
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	37	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	108
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	38	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	112
Threadneedle (Lux) - Asian Focus*	39	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	117
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	40	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	122
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	42		
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	43		

Inhalt

(Fortsetzung)

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	131	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	199
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	134	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	200
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	135	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	201
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	138	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	202
Threadneedle (Lux) - Global Focus	146	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	204
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	148	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	205
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	151	Erläuterungen zum Jahresabschluss	207
Threadneedle (Lux) - Global Select	153	Informationen für Anteilinhaber	297
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	155	Informationen für Anleger in der Schweiz	298
Threadneedle (Lux) - American	157	Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte	299
Threadneedle (Lux) - American Select	158	Verzeichnis	301
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	159		
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	160		
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	162		
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	164		
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	165		
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	167		
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	169		
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	171		
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	172		
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	174		
Threadneedle (Lux) - European Select	176		
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	177		
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	179		
Threadneedle (Lux) - Global Technology	181		
Threadneedle (Lux) - UK Equities	183		
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	184		
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	185		
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	186		
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	187		
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	193		

*Siehe Erläuterung 1.

Informationen zur Gesellschaft

Gesellschaft

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

Eingetragener Sitz

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

Verwaltungsgesellschaft

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

Verwaltungsrat

Jon Allen
Leitender Angestellter der Region Asien-Pazifik
Columbia Threadneedle Investments
Singapur

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini
Unabhängiger Direktor
Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Claude Kremer
Unabhängiger Direktor
Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Michelle Scrimgeour (am 26. April 2019 als Verwaltungsratsmitglied zurückgetreten)
Chief Executive Officer, EMEA
Columbia Threadneedle Investments
London
Vereinigtes Königreich

Julie Griffiths (am 12. April 2019 zum Verwaltungsratsmitglied berufen)
Chief Risk Officer, EMEA und Region Asien-Pazifik
Columbia Threadneedle Investments
London
Vereinigtes Königreich



GATEHOUSE BANK



Shariah-Prüfbericht

Der Verwaltungsrat
Verwaltungsgesellschaft
74, Mühlenweg
L-2155 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Sehr geehrte Damen und Herren,

As-salaamu Alaikum,

wir sind gemäß einem am 30. März 2017 abgeschlossenen Shariah-Beratungsvertrag zwischen Threadneedle Management Luxembourg S.A. in seiner Eigenschaft als Verwaltungsgesellschaft von Threadneedle (Lux) (die **Verwaltungsgesellschaft** bzw. die **SICAV**) und Gatehouse Bank Plc (der **Shariah-Berater**) in Bezug auf den Threadneedle (Lux) – Gatehouse Shariah Global Equity (der „**Shariah-Teilfonds**“) zur Vorlage dieses Shariah-Prüfberichts verpflichtet.

Die im Shariah-Beratungsvertrag definierten Begriffe haben in diesem Bericht dieselbe Bedeutung.

Wir haben eine Shariah-Prüfung durchgeführt und in diesem Zusammenhang die Anlagen untersucht, die während des Berichtszeitraums vom **1. April 2019 bis 30. Juni 2019** vom Shariah-Teilfonds getätigt wurden (die „**Shariah-Prüfung**“). Das Gremium hat bestätigt, dass die Anlagen und die Berechnung der zu reinigenden Erträge innerhalb der vereinbarten Shariah-Richtlinien und -Parameter liegen.

Nach der Shariah-Prüfung empfiehlt der Shariah-Berater dem Shariah-Teilfonds die Reinigung eines Betrags von 180,77 USD in Bezug auf die im obigen Berichtszeitraum erhaltenen Dividenden und eine Spende für wohltätige Zwecke, die mit dem Shariah-Aufsichtsgremium abzustimmen ist. Es wird nicht erwartet, dass der Shariah-Teilfonds während dieses Berichtszeitraums eine Reinigung der Kapitalgewinne vornehmen wird.

Und Allah weiß es am besten.

Datum: 8. September 2019

Unterzeichnet für und im Namen des Shariah-Beraters

.....
Abdirahman Sh. Osman Ali

GATEHOUSE BANK PLC | 14 GROSVENOR STREET | LONDON | W1K 4PS

T +44 (0) 20 7070 6000 W www.gatehousebank.com



GATEHOUSE BANK



Shariah-Prüfbericht

Der Verwaltungsrat
Verwaltungsgesellschaft
74, Mühlenweg
L-2155 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Sehr geehrte Damen und Herren,

As-salaamu Alaikum,

wir sind gemäß einem am 30. März 2017 abgeschlossenen Shariah-Beratungsvertrag zwischen Threadneedle Management Luxembourg S.A. in seiner Eigenschaft als Verwaltungsgesellschaft von Threadneedle (Lux) (die **Verwaltungsgesellschaft** bzw. die **SICAV**) und Gatehouse Bank Plc (der **Shariah-Berater**) in Bezug auf den Threadneedle (Lux) – Gatehouse Shariah Global Equity (der „**Shariah-Teilfonds**“) zur Vorlage dieses Shariah-Prüfberichts verpflichtet.

Die im Shariah-Beratungsvertrag definierten Begriffe haben in diesem Bericht dieselbe Bedeutung.

Wir haben eine Shariah-Prüfung durchgeführt und in diesem Zusammenhang die Anlagen untersucht, die während des Berichtszeitraums vom **1. Juli 2019 bis 30. September 2019** vom Shariah-Teilfonds getätigt wurden (die „**Shariah-Prüfung**“). Das Gremium hat bestätigt, dass die Anlagen und die Berechnung der zu reinigenden Erträge innerhalb der vereinbarten Shariah-Richtlinien und -Parameter liegen.

Nach der Shariah-Prüfung empfiehlt der Shariah-Berater dem Shariah-Teilfonds die Reinigung eines Betrags von 209,32 USD in Bezug auf die im obigen Berichtszeitraum erhaltenen Dividenden und eine Spende für wohltätige Zwecke, die mit dem Shariah-Aufsichtsgremium abzustimmen ist. Es wird nicht erwartet, dass der Shariah-Teilfonds während dieses Berichtszeitraums eine Reinigung der Kapitalgewinne vornehmen wird.

Und Allah weiß es am besten.

Datum: 28. Oktober 2019

Unterzeichnet für und im Namen des Shariah-Beraters

.....
Abdirahman Sh. Osman Ali

GATEHOUSE BANK PLC | 14 GROSVENOR STREET | LONDON | W1K 4PS
T +44 (0) 20 7070 6000 W www.gatehousebank.com

Konsolidierte Jahresabschlüsse für Threadneedle (Lux)

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2, 18	16.000.324.446
Zum Marktwert gekaufte Optionen	2, 12	964.500
Bankguthaben	2	226.515.596
Termineinlagen	2, 19	232.513.111
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		68.866.219
Forderungen aus Zeichnungen		32.740.751
Erhaltene Vermögensverwaltungsgebühr	2	70.642
Zinsforderungen aus Swaps	2	1.325.658
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		48.849.816
Vorauszahlung aus Swapgeschäften	2	2.485.107
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	1.933.086
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	5.784.681
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2, 11	799.400
Sonstige Vermögenswerte		10.640.472
Summe Aktiva		16.633.813.485
Passiva		
Überziehungskredite		(3.285.114)
Zum Marktwert verkaufte Optionen	2, 12	(205.188)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(109.994.368)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(49.421.805)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(4.736.931)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(490.864)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swapgeschäften	2	(1.418.437)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(23.119.092)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(32.295.362)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(495.887)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(13.204.747)
Verbindlichkeiten aus Performance-Gebühren	8	(763.324)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(2.211.317)
Andere Verbindlichkeiten		(2.477.990)
Summe Passiva		(244.120.426)
Nettovermögen insgesamt		16.389.693.059

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		16.714.710.010
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	145.056.552
Zinsen aus Anleihen, netto	2	74.751.749
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.876.828
Zinsen aus Swaps		2.291.354
Zinsen aus Futures		130.895
Vermögensverwaltungsgebühr	2	140.287
Andere Erträge		187.609
Erträge insgesamt		225.435.274
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(82.493.127)
Performance-Gebühren	8	(435.863)
Bankspesen		(407.362)
Dividendenaufwand aus Swaps		(2.003.100)
Zinsaufwand aus Swaps		(13.729.393)
Zinsaufwand aus Futures		(377.854)
Sonstige Betriebskosten	5	(14.737.802)
Sonstige Gebühren	4	(29.651)
Aufwendungen insgesamt		(114.214.152)
Nettoertrag aus Anlagen		111.221.122
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		315.332.276
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(22.174.990)
Realisierter Netto(verlust) aus Optionen		(4.251.239)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(53.395.865)
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(57.335.818)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(1.514.238)
Realisierter Netto(verlust) aus Kapitalertragsteuer		(7.813)
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderung		(900)
Realisierter Nettogewinn		176.651.413
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		347.273.791
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		7.905.123
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Optionen		815.840
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(10.846.529)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		16.667.352
Nettoveränderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragsteuer		(1.174.506)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		360.641.071
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		648.513.606
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		3.354.375.350
Anteilrücknahmen		(3.985.803.625)
Dividendenausschüttung	7	(31.414.995)
Kapitalbewegungen insgesamt		(662.843.270)
Wechselkursdifferenzen	2	(298.825.984)
Änderung der Überkreuzbeteiligungen in Portfolios	18	(11.861.303)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		16.389.693.059

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond*

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	8. Mai 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEH [#]	–	13,00 ¹	13,80 ¹
Klasse AU [#]	–	24,84	25,56
Klasse DEC [#]	–	7,60 ¹	8,40 ¹
Klasse DEH [#]	–	10,13 ¹	10,81 ¹
Klasse DU [#]	–	26,93	27,82
Klasse W [#]	–	53,51	54,96

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.
[#]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG
DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 8. Mai 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		2.899.620
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	5.576
Zinsen aus Bankguthaben	2	424
Erträge insgesamt		6.000
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(2.893)
Bankspesen		(6)
Zinsaufwand aus Futures		(207)
Sonstige Betriebskosten	5	(861)
Aufwendungen insgesamt		(3.967)
Nettoertrag aus Anlagen		2.033
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		27.353
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(33.297)
Realisierter Nettogewinn aus Futures		8.957
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		453
Realisierter Nettogewinn		3.466
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(24.826)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		20.542
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Futures		(16.657)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(20.941)
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(15.442)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Anteilrücknahmen		(2.884.110)
Dividendenausschüttung	7	(68)
Kapitalbewegungen insgesamt		(2.884.178)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		–

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	8. Mai 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	–	2.899.620	17.837.206

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	210.639.791
Bankguthaben	2	6.825.470
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		2.028.936
Forderungen aus Zeichnungen		436.921
Zinsforderungen aus Swaps	2	999
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.703.996
Vorauszahlung aus Swapgeschäften	2	681.534
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2, 11	5.186
Summe Aktiva		222.322.833
Passiva		
Überziehungskredite		(589.240)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.328.236)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(13.968)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(20.154)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swapgeschäften	2	(40.531)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(1.885.134)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(700.626)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(43.855)
Andere Verbindlichkeiten		(27.064)
Summe Passiva		(5.648.808)
Nettovermögen insgesamt		216.674.025

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	84.353,903
Klasse AEH	16.125,079
Klasse AKH	163,000
Klasse AU	54.777,842
Klasse AUP	7.308,851
Klasse DEC	100,000
Klasse DEH	8.666,842
Klasse DU	25.266,176
Klasse DUP	100,000
Klasse IEC	100,000
Klasse IEH	581.739,239
Klasse IEP	100,000
Klasse IGC	100,000
Klasse IGH	3.856.692,096
Klasse IKH	163,000
Klasse IU	176.250,000
Klasse IUP	100,000
Klasse NEC	100,000
Klasse NEH	33.011,495
Klasse NGC	1.294.472,722
Klasse NGH	666.885,855
Klasse NU	2.413.838,044
Klasse NUP	100,000
Klasse XGH	6.820.960,436
Klasse ZEH	40.070,342
Klasse ZGH	25.099,527
Klasse ZU	334.397,030

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		185.075.332
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	3.038.258
Zinsen aus Bankguthaben	2	61.747
Zinsen aus Swaps		35.091
Zinsen aus Futures		21.855
Erträge insgesamt		3.156.951
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(340.997)
Bankspesen		(14.898)
Zinsaufwand aus Swaps		(374.154)
Zinsaufwand aus Futures		(7.101)
Sonstige Betriebskosten	5	(154.808)
Aufwendungen insgesamt		(891.958)
Nettoertrag aus Anlagen		2.264.993
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		2.273.491
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(491.206)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(5.780.178)
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(2.041.732)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(393.335)
Realisierter Netto(verlust)		(6.432.960)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		6.529.520
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		252.125
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		449.968
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		411.420
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		7.643.033
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		3.475.066
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		110.493.002
Anteilrücknahmen		(82.148.584)
Dividendenausschüttung	7	(220.791)
Kapitalbewegungen insgesamt		28.123.627
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		216.674.025

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	216.674.025	185.075.332	143.415.226

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEC	10,6783 ¹	10,26 ¹	10,48 ¹
Klasse AEH	11,4071 ¹	10,81 ¹	10,69 ¹
Klasse AKH	114,0423 ²	107,96 ²	106,71 ²
Klasse AU	12,5374	11,71	11,24
Klasse AUP	11,8260	11,22	10,99
Klasse DEC	9,8842 ¹	9,56 ¹	9,87 ¹
Klasse DEH	11,0821 ¹	10,54 ¹	10,50 ¹
Klasse DU	11,0880	10,40	10,05
Klasse DUP	10,6893	10,18	10,11
Klasse IEC	10,4559 ¹	10,06 ¹	–
Klasse IEH	11,6728 ¹	11,06 ¹	10,92 ¹
Klasse IEP	11,7810 ¹	10,84 ¹	–
Klasse IGC	10,6081 ³	10,15 ³	–
Klasse IGH	12,2723 ³	11,55 ³	11,27 ³
Klasse IKH	116,4273 ²	110,17 ²	108,80 ²
Klasse IU	12,8115	11,95	11,45
Klasse IUP	10,9244	10,34	–
Klasse NEC	10,4957 ¹	10,08 ¹	–
Klasse NEH	10,5668 ¹	10,00 ¹	9,85 ¹
Klasse NGC	10,3116 ³	9,84 ³	9,84 ³
Klasse NGH	10,7708 ³	10,13 ³	9,86 ³
Klasse NU	11,0990	10,34	9,88
Klasse NUP	10,9708	10,38	–
Klasse XGH [#]	10,5581 ³	–	–
Klasse ZEH	10,6921 ¹	10,13 ¹	9,99 ¹
Klasse ZGH	12,2163 ³	11,50 ³	11,21 ³
Klasse ZU	12,7737	11,91	11,40

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

[#]Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	134.332.774
Bankguthaben	2	2.101.376
Forderungen aus Zeichnungen		30.599
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		904.033
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2, 11	31.891
Sonstige Vermögenswerte		8.395
Summe Aktiva		137.409.068
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.549.570)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(247)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(11.611)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(66.247)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(942.144)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(44.775)
Andere Verbindlichkeiten		(11.231)
Summe Passiva		(2.625.825)
Nettovermögen insgesamt		134.783.243

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	6.689,764
Klasse IE	925.976,269
Klasse ZE	100,000
Klasse 1E	7.558.637,103
Klasse 1G	246.155,581
Klasse 2E	6.779.946,643
Klasse 2G	100,000
Klasse 3G	1.054.979,987
Klasse 4G	2.910.334,724
Klasse 8E	2.528.268,004
Klasse 8G	130.062,845
Klasse 9G	100,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ^f	31. März 2019
Klasse AE	10,5449	10,19
Klasse IE	10,6054	10,22
Klasse ZE	10,5944	10,22
Klasse 1E	1,4380	1,39
Klasse 1G	1,1709 ¹	1,10 ¹
Klasse 2E	10,6119	10,23
Klasse 2G	10,4492 ¹	9,81 ¹
Klasse 3G	1,3024 ¹	1,22 ¹
Klasse 4G ^f	10,7797 ¹	–
Klasse 8E	1,7796	1,72
Klasse 8G	1,5761 ¹	1,48 ¹
Klasse 9G	10,4420 ¹	9,81 ¹

¹Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.^fSiehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		125.657.326
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.110.471
Zinsen aus Bankguthaben	2	748
Zinsen aus Swaps		6.194
Zinsen aus Futures		3.220
Andere Erträge		720
Erträge insgesamt		1.121.353
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(306.777)
Bankspesen		(5.660)
Zinsaufwand aus Swaps		(196.667)
Zinsaufwand aus Futures		(1.192)
Sonstige Betriebskosten	5	(67.416)
Sonstige Gebühren	4	(4)
Aufwendungen insgesamt		(577.716)
Nettoertrag aus Anlagen		543.637
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.823.611
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		219.932
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		25.489
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(883.079)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(6.093)
Realisierter Nettogewinn		1.179.860
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		3.273.621
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(284.732)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(80.651)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		232.770
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		3.141.008
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		4.864.505
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		42.784.052
Anteilrücknahmen		(38.522.640)
Kapitalbewegungen insgesamt		4.261.412
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		134.783.243

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019
EUR	134.783.243	125.657.326

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	472.867.529
Bankguthaben	2	6.548.125
Termineinlagen	2, 19	7.497.300
Forderungen aus Zeichnungen		131.882
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		6.620.920
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2, 11	5.652
Summe Aktiva		493.671.408
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(3.055.164)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.708.969)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(469.532)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(399.996)
Andere Verbindlichkeiten		(64.794)
Summe Passiva		(6.698.455)
Nettovermögen insgesamt		486.972.953

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IE	143.967,174
Klasse IEP	100,000
Klasse XE	100,000
Klasse ZE	27.950,000
Klasse ZEP	100,000
Klasse 1E	28.994.826,588
Klasse 1EP	1.101.559,381
Klasse 1G	380.678,766
Klasse 1GP	89.197,461
Klasse 1UT	395.670,256
Klasse 2E	52.838,675
Klasse 2EP	100,000
Klasse 2FH	13.851,346
Klasse 2G	175,971
Klasse 2GP	100,000
Klasse 3E	1.738.853,743
Klasse 3EP	1.113.245,864
Klasse 3FC	13.083,825
Klasse 3FH	64.810,068
Klasse 3G	1.336.296,249
Klasse 3GP	93.144,796
Klasse 4E	161.932,265
Klasse 4G	100,000
Klasse 4GP	1.910.650,409
Klasse 8E	2.305.012,313
Klasse 8EP	5.581.133,654
Klasse 8FH	8.377,550
Klasse 8G	25.043,218
Klasse 8GP	5.275,145
Klasse 9E	659.158,862
Klasse 9EP	18.215,055
Klasse 9FC	12.240,092
Klasse 9FH	2.323,914
Klasse 9G	100,000
Klasse 9GP	100,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		542.502.367
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.308
Zinsen aus Anleihen, netto	2	10.733.874
Zinsen aus Bankguthaben	2	10.252
Erträge insgesamt		10.748.434
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(2.532.235)
Bankspesen		(14.469)
Zinsaufwand aus Futures		(4.232)
Sonstige Betriebskosten	5	(410.163)
Aufwendungen insgesamt		(2.961.099)
Nettoertrag aus Anlagen		7.787.335
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(932.208)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		2.644.865
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(520.993)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(179.555)
Realisierter Nettogewinn		1.012.109
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		7.737.006
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(1.207.855)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		147.231
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		6.676.382
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		15.475.826
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		38.081.176
Anteilrücknahmen		(109.004.147)
Dividendenausschüttung	7	(82.269)
Kapitalbewegungen insgesamt		(71.005.240)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		486.972.953

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019
EUR	486.972.953	542.502.367

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019
Klasse IE	10,5289	10,20
Klasse IEP	10,2447	9,93
Klasse XE [#]	10,0880	–
Klasse ZE	10,5191	10,19
Klasse ZEP	10,2431	9,93
Klasse 1E	10,4686	10,16
Klasse 1EP	10,2017	9,90
Klasse 1G	10,2931 ¹	9,73 ¹
Klasse 1GP	10,0531 ¹	9,51 ¹
Klasse 1UT	10,3263 ²	10,09 ²
Klasse 2E	10,5316	10,20
Klasse 2EP	10,2700	9,94
Klasse 2FH	10,4783 ³	10,17 ³
Klasse 2G	10,3616 ¹	9,77 ¹
Klasse 2GP	10,0987 ¹	9,52 ¹
Klasse 3E	10,5400	10,20
Klasse 3EP	10,3366	10,00
Klasse 3FC	10,2260 ³	9,92 ³
Klasse 3FH	10,4833 ³	10,17 ³
Klasse 3G	10,3625 ¹	9,77 ¹
Klasse 3GP	10,0399 ¹	9,47 ¹
Klasse 4E	10,6191	10,24
Klasse 4G	10,6781 ¹	10,03 ¹
Klasse 4GP	10,2113 ¹	9,59 ¹
Klasse 8E	10,5267	10,19
Klasse 8EP	10,2956	9,97
Klasse 8FH	10,4704 ³	10,16 ³
Klasse 8G	10,3524 ¹	9,76 ¹
Klasse 8GP	10,1203 ¹	9,55 ¹
Klasse 9E	10,5416	10,20
Klasse 9EP	10,3433	10,01
Klasse 9FC	10,2956 ³	9,99 ³
Klasse 9FH	10,4914 ³	10,18 ³
Klasse 9G	10,3675 ¹	9,77 ¹
Klasse 9GP	10,1049 ¹	9,53 ¹

¹Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

[#]Siehe Erläuterung 1.

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

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	31.612.717
Bankguthaben	2	1.520.564
Termineinlagen	2, 19	4.499.419
Forderungen aus Zeichnungen		1.695
Zinsforderungen aus Swaps	2	1.986
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		377.767
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	90.685
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	103.882
Sonstige Vermögenswerte		472
Summe Aktiva		38.209.187
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(383.077)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(4.411)
Andere Verbindlichkeiten		(2.709)
Summe Passiva		(390.197)
Nettovermögen insgesamt		37.818.990

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	10,000
Klasse AEP	10,000
Klasse AKH	100,000
Klasse ANH	100,000
Klasse IE	300,538
Klasse IEP	10,000
Klasse IGC	79.640,243
Klasse IGH	10,000
Klasse XE	4.709,223
Klasse XGH	209.253,310
Klasse ZE	44.064,200

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

30. September 2019[#]

Klasse AE [#]	100,3950
Klasse AEP [#]	100,3950
Klasse AKH [#]	100,4298 ¹
Klasse ANH [#]	100,7301 ²
Klasse IE [#]	100,4684
Klasse IEP [#]	100,4690
Klasse IGC [#]	100,6488 ³
Klasse IGH [#]	100,6774 ³
Klasse XE [#]	100,5537
Klasse XGH [#]	100,7136 ³
Klasse ZE [#]	100,4688

¹Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.²Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.[#]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 17. Juli 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		–
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	169.989
Zinsen aus Swaps		18.597
Erträge insgesamt		188.586
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(10.463)
Bankspesen		(3.438)
Zinsaufwand aus Swaps		(6.222)
Sonstige Betriebskosten	5	(5.751)
Aufwendungen insgesamt		(25.874)
Nettoertrag aus Anlagen		162.712
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(1.799)
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(123.984)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		196.012
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		6.575
Realisierter Nettogewinn		76.804
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(48.897)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		103.882
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		90.685
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		145.670
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		385.186
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		37.817.330
Anteilrücknahmen		(383.526)
Kapitalbewegungen insgesamt		37.433.804
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		37.818.990

GESAMTNETTOINVENTARWERT

30. September 2019
EUR 37.818.990

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	67.267.406
Bankguthaben	2	2.074.090
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		343.493
Forderungen aus Zeichnungen		32.246
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		426.935
Sonstige Vermögenswerte		687
Summe Aktiva		70.144.857
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.410.554)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(107)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(206.039)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(22.191)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(18.870)
Andere Verbindlichkeiten		(5.588)
Summe Passiva		(1.663.349)
Nettovermögen insgesamt		68.481.508

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IE	573.722,550
Klasse IEP	1.984.421,175
Klasse IFH	327,000
Klasse IKH	100,000
Klasse LE	820.014,814
Klasse NEP	30.259,524
Klasse ZE	95.139,175
Klasse ZEP	45.075,410
Klasse ZFH	327,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse IE	10,6998	10,27	10,10
Klasse IEP	10,3473	10,01	9,98
Klasse IFH	10,4951 ¹	10,11 ¹	9,98 ¹
Klasse IKH [#]	99,9099 ²	–	–
Klasse LE	10,7233	10,30	10,11
Klasse NEP	1.041,9269	1.007,53	–
Klasse ZE	10,6809	10,26	10,09
Klasse ZEP [#]	10,3050	–	–
Klasse ZFH	10,4896 ¹	10,10 ¹	9,98 ¹

¹Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.[#]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		29.456.674
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	370.735
Zinsen aus Bankguthaben	2	546
Erträge insgesamt		371.281
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(91.997)
Bankspesen		(2.134)
Zinsaufwand aus Futures		(1.154)
Sonstige Betriebskosten	5	(26.811)
Aufwendungen insgesamt		(122.096)
Nettoertrag aus Anlagen		249.185
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		319.758
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		8.191
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(273.252)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		644
Realisierter Nettogewinn		55.341
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.979.907
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(112.192)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		8.250
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		1.875.965
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		2.180.491
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		46.289.899
Anteilrücknahmen		(9.073.396)
Dividendenausschüttung	7	(372.160)
Kapitalbewegungen insgesamt		36.844.343
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		68.481.508

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
EUR	68.481.508	29.456.674	15.439.685

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	131.047.131
Bankguthaben	2	4.132.156
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.396.024
Forderungen aus Zeichnungen		824.245
Zinsforderungen aus Swaps	2	421
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.253.768
Vorauszahlung aus Swapgeschäften	2	32.828
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2, 11	145.889
Sonstige Vermögenswerte		5.741
Summe Aktiva		138.838.203
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.663.822)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(947.820)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(35.558)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swapgeschäften	2	(17.350)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(212.731)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(1.887.046)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(88.149)
Andere Verbindlichkeiten		(24.131)
Summe Passiva		(5.876.607)
Nettovermögen insgesamt		132.961.596

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	1.850.894,288
Klasse AEP	372.605,617
Klasse AKH	100,000
Klasse AUH	100,000
Klasse DE	625.730,786
Klasse DEP	520.767,369
Klasse DUH	100,000
Klasse IE	1.676.115,759
Klasse W	1.580,192

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AE	29,4199	28,63	28,21
Klasse AEP	15,1544	14,89	15,07
Klasse AKH [#]	99,9378 ¹	–	–
Klasse AUH	10,8215 ²	10,38 ²	–
Klasse DE	27,8028	27,13	26,88
Klasse DEP	11,4645	11,30	11,50
Klasse DUH	10,7420 ²	10,34 ²	–
Klasse IE	29,4688	28,59	28,00
Klasse W	62,3486	60,67	59,79

¹Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.²Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.[#]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		97.043.105
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.714.925
Zinsen aus Bankguthaben	2	7.154
Zinsen aus Swaps		65.069
Zinsen aus Futures		487
Erträge insgesamt		1.787.635
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(475.525)
Bankspesen		(14.399)
Zinsaufwand aus Swaps		(578.136)
Zinsaufwand aus Futures		(11.589)
Sonstige Betriebskosten	5	(125.174)
Aufwendungen insgesamt		(1.204.823)
Nettoertrag aus Anlagen		582.812
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.059.599
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		201.188
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(179.957)
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(2.430.983)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		31.393
Realisierter Netto(verlust)		(1.318.760)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		3.933.690
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(354.102)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(163.280)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		463.191
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		3.879.499
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		3.143.551
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		45.623.846
Anteilrücknahmen		(12.743.234)
Dividendenausschüttung	7	(105.672)
Kapitalbewegungen insgesamt		32.774.940
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		132.961.596

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
EUR	132.961.596	97.043.105	83.714.363

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	38.655.804
Bankguthaben	2	360.169
Termineinlagen	2, 19	805.418
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		506.594
Forderungen aus Zeichnungen		27.953
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		417.146
Summe Aktiva		40.773.084
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.099.644)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(47.156)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(469.526)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(35.642)
Andere Verbindlichkeiten		(8.579)
Summe Passiva		(1.660.547)
Nettovermögen insgesamt		39.112.537

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	391.659,836
Klasse AEH	232.983,337
Klasse AKH	100,000
Klasse ANH	1.000,000
Klasse ASH	2.972,051
Klasse AU	39.552,941
Klasse AUP	793.992,672
Klasse DEC	49.761,783
Klasse DEH	150.075,677
Klasse DU	161.580,423
Klasse IEH	428.316,115
Klasse IU	100,000
Klasse W	8.848,157
Klasse WEH	7.260,489
Klasse XUP	100,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEC	13,2869 ¹	13,23 ¹	13,85 ¹
Klasse AEH	21,5247 ¹	20,89 ¹	20,74 ¹
Klasse AKH [#]	101,0884 ²	–	–
Klasse ANH [#]	10,1512 ³	–	–
Klasse ASH	14,0137 ⁴	13,44 ⁴	13,08 ⁴
Klasse AU	22,1720	21,18	20,42
Klasse AUP	8,3212	8,16	8,29
Klasse BU	–	–	9,85
Klasse BUP	–	–	9,85
Klasse DEC	9,6471 ¹	9,61 ¹	10,07 ¹
Klasse DEH	16,5503 ¹	16,07 ¹	15,97 ¹
Klasse DU	17,3039	16,54	15,96
Klasse IEH	29,9693 ¹	28,96 ¹	28,54 ¹
Klasse IU	11,1388	10,61	–
Klasse W	30,1252	28,73	27,60
Klasse WEH	20,9202 ¹	20,26 ¹	20,05 ¹
Klasse XUP	11,4731	11,18	10,93

1Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

2Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

3Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

4Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

#Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		38.306.644
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	14.498
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.030.544
Zinsen aus Bankguthaben	2	22.075
Erträge insgesamt		1.067.117
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(216.527)
Bankspesen		(106)
Sonstige Betriebskosten	5	(51.683)
Aufwendungen insgesamt		(268.316)
Nettoertrag aus Anlagen		798.801
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		549.596
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.115.808)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(4.503)
Realisierter Netto(verlust)		(570.715)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		475.702
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(189.599)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		286.103
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		514.189
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		4.736.437
Anteilrücknahmen		(4.120.703)
Dividendenausschüttung	7	(324.030)
Kapitalbewegungen insgesamt		291.704
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		39.112.537

GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
	39.112.537	38.306.644	43.736.834

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	53.173.602
Bankguthaben	2	629.496
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		770.704
Forderungen aus Zeichnungen		25.115
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		622.011
Sonstige Vermögenswerte		76
Summe Aktiva		55.221.004
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(411.199)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(85.228)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(43.301)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(60.853)
Andere Verbindlichkeiten		(13.562)
Summe Passiva		(614.143)
Nettovermögen insgesamt		54.606.861

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	99.830,952
Klasse AEH	14.711,403
Klasse AKH	100,000
Klasse ANH	1.000,000
Klasse ASH	14.773,834
Klasse AU	65.945,657
Klasse AUP	3.780.033,602
Klasse DEH	23.407,204
Klasse DU	17.405,334
Klasse IEH	24.417,958
Klasse IU	2.796,032
Klasse SU	1.285,798
Klasse SUP	61.705,825
Klasse W	12.392,111
Klasse XUP	100,000
Klasse ZU	200,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ¹	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEC	9,7792 ¹	9,97 ¹	10,87 ¹
Klasse AEH	26,3600 ¹	26,10 ¹	26,85 ¹
Klasse AKH ²	99,0669 ²	–	–
Klasse ANH ²	9,9468 ³	–	–
Klasse ASH	12,1736 ⁴	11,91 ⁴	12,01 ⁴
Klasse AU	75,7676	73,87	73,66
Klasse AUP	11,7056	11,75	12,41
Klasse DEH	19,6240 ¹	19,44 ¹	20,03 ¹
Klasse DU	53,9625	52,64	52,54
Klasse IEH	28,4966 ¹	28,11 ¹	28,69 ¹
Klasse IU ⁵	10,2884	–	–
Klasse SU	30,4963	29,75	29,72
Klasse SUP	11,2772	11,32	11,98
Klasse W	62,7328	61,05	60,66
Klasse XUP	10,9927	10,96	11,14
Klasse ZU	11,9995	11,65	11,54

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		57.760.204
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	17.161
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.653.576
Zinsen aus Bankguthaben	2	24.745
Andere Erträge		1.072
Erträge insgesamt		1.696.554
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(384.276)
Bankspesen		(642)
Sonstige Betriebskosten	5	(85.667)
Sonstige Gebühren	4	(4.256)
Aufwendungen insgesamt		(474.841)
Nettoertrag aus Anlagen		1.221.713
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(574.227)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		56.100
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		6.192
Realisierter Netto(verlust)		(511.935)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		789.658
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(168.726)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		620.932
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		1.330.710
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		1.482.264
Anteilrücknahmen		(4.580.166)
Dividendenausschüttung	7	(1.386.151)
Kapitalbewegungen insgesamt		(4.484.053)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		54.606.861

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	54.606.861	57.760.204	81.487.718

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	119.904.727
Bankguthaben	2	12.082.439
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.980.069
Forderungen aus Zeichnungen		74.770
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.640.458
Sonstige Vermögenswerte		10
Summe Aktiva		135.682.473
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(4.080.735)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(68.651)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(721.854)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(5.273)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(93.367)
Andere Verbindlichkeiten		(27.327)
Summe Passiva		(4.997.207)
Nettovermögen insgesamt		130.685.266

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	1.090.220,884
Klasse AEH	230.577,725
Klasse AKH	100,000
Klasse ANH	1.000,000
Klasse ASC	55.164,388
Klasse ASH	86.163,964
Klasse AU	1.649.044,484
Klasse AUP	4.392.135,190
Klasse DEH	266.061,138
Klasse DU	160.575,666
Klasse IEH	920.320,675
Klasse XU	2.171.974,165
Klasse XUP	627.011,100
Klasse ZEH	1.010.590,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ¹	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEC	5,6654 ¹	5,86 ¹	6,30 ¹
Klasse AEH	15,0495 ¹	15,12 ¹	15,36 ¹
Klasse AKH ²	98,5114 ²	–	–
Klasse ANH ²	9,8908 ³	–	–
Klasse ASC	7,5566 ⁴	7,72 ⁴	8,14 ⁴
Klasse ASH	11,0383 ⁴	10,96 ⁴	10,91 ⁴
Klasse AU	17,7981	17,60	17,34
Klasse AUP	5,8649	5,97	6,23
Klasse BU	–	–	9,93
Klasse BUP	–	–	9,93
Klasse DEH	11,7532 ¹	11,82 ¹	12,02 ¹
Klasse DU	13,8841	13,75	13,56
Klasse IEH	16,9947 ¹	17,01 ¹	17,15 ¹
Klasse W	–	–	20,27
Klasse XU	10,6553	10,46	–
Klasse XUP	9,8877	10,00	–
Klasse ZEH	10,9241 ¹	10,94 ¹	11,03 ¹

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

*Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		123.851.972
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	3.598.311
Zinsen aus Bankguthaben	2	78.205
Zinsen aus Futures		518
Andere Erträge		1.702
Erträge insgesamt		3.678.736
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(637.505)
Bankspesen		(262)
Sonstige Betriebskosten	5	(173.751)
Aufwendungen insgesamt		(811.518)
Nettoertrag aus Anlagen		2.867.218
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(2.577.509)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.526.633)
Realisierter Nettogewinn aus Futures		210.370
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(24.843)
Realisierter Netto(verlust)		(3.918.615)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.010.376
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(459.160)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Futures		(38.804)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		512.412
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(538.985)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		46.932.810
Anteilrücknahmen		(38.394.761)
Dividendenausschüttung	7	(1.165.770)
Kapitalbewegungen insgesamt		7.372.279
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		130.685.266

GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
	130.685.266	123.851.972	131.853.551

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	206.081.660
Bankguthaben	2	7.647.924
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		30.710
Forderungen aus Zeichnungen		33.358
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		3.000.991
Summe Aktiva		216.794.643
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.944.036)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.405.503)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(2.425.491)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(106.468)
Andere Verbindlichkeiten		(20.401)
Summe Passiva		(6.901.899)
Nettovermögen insgesamt		209.892.744

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	69.479,656
Klasse AEH	25.362,136
Klasse ASH	36.167,146
Klasse AU	155.770,320
Klasse AUP	323.445,799
Klasse DEC	37.514,389
Klasse DEH	34.287,344
Klasse DU	59.806,779
Klasse IEC	13.820,000
Klasse IEH	4.309.703,772
Klasse IU	4.640.444,919
Klasse TEH	18.205,515
Klasse XUP	100,000
Klasse ZFH	100,000
Klasse ZGH	100,000
Klasse ZU	17.281,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ¹	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEC	12,9169 ¹	12,86 ¹	13,34 ¹
Klasse AEH	31,2238 ¹	30,28 ¹	29,77 ¹
Klasse ASH	14,3525 ²	13,76 ²	13,25 ²
Klasse AU	35,6492	34,04	32,47
Klasse AUP	13,4686	13,20	13,28
Klasse BU	–	–	9,72
Klasse BUP	–	–	9,59
Klasse DEC	9,7757 ¹	9,74 ¹	10,13 ¹
Klasse DEH	22,5582 ¹	21,90 ¹	21,57 ¹
Klasse DU	25,7134	24,57	23,49
Klasse IEC	9,3199 ¹	9,24 ¹	9,49 ¹
Klasse IEH	30,6060 ¹	29,55 ¹	28,78 ¹
Klasse IU	10,9048	10,36	–
Klasse TEH	10,9233 ¹	10,54 ¹	10,27 ¹
Klasse XUP	10,9158	10,65	10,17
Klasse ZFH	10,5297 ³	10,20 ³	–
Klasse ZGH	11,4649 ⁴	11,02 ⁴	10,64 ⁴
Klasse ZU	12,7840	12,17	11,53

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁵Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		218.412.478
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	6.184.397
Zinsen aus Bankguthaben	2	76.630
Zinsen aus Swaps		18.333
Erträge insgesamt		6.279.360
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(655.557)
Bankspesen		(1.110)
Sonstige Betriebskosten	5	(125.181)
Aufwendungen insgesamt		(781.848)
Nettoertrag aus Anlagen		5.497.512
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		31.720
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		294.556
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(5.820.946)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		2.248
Realisierter Netto(verlust)		(5.492.422)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		5.022.282
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(266.394)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(969.495)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		3.786.393
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		3.791.483
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		17.180.409
Anteilrücknahmen		(29.321.218)
Dividendenausschüttung	7	(170.408)
Kapitalbewegungen insgesamt		(12.311.217)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		209.892.744

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	209.892.744	218.412.478	296.403.063

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	41.345.166
Bankguthaben	2	218.877
Termineinlagen	2, 19	1.301.142
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		200.018
Forderungen aus Zeichnungen		87.385
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		521.382
Summe Aktiva		43.673.970
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(697.805)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(122.529)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus		
Devisenterminkontrakten	2, 9	(3.310)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(4.579)
Andere Verbindlichkeiten		(5.975)
Summe Passiva		(834.198)
Nettovermögen insgesamt		42.839.772

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	36.155,522
Klasse AKH	100,000
Klasse AS	101.469,352
Klasse ASC	21.081,685
Klasse ASH	132.655,199
Klasse AU	92.517,439
Klasse AUP	6.057,443
Klasse AVC	100,000
Klasse AVH	100,000
Klasse DEH	16.271,944
Klasse IEH	250,000
Klasse IGH	200,000
Klasse ISH	250,000
Klasse IU	250,000
Klasse XU	3.114.861,022
Klasse ZU	250,000
Klasse ZUP	100,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ^f	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEH	11,7129 ¹	11,22 ¹	11,09 ¹
Klasse AKH ²	100,4316 ²	–	–
Klasse AS	11,4428 ³	10,57 ³	9,81 ³
Klasse ASC	11,0751 ³	10,70 ³	10,78 ³
Klasse ASH	12,6225 ³	11,96 ³	11,58 ³
Klasse AU	12,8255	12,10	11,60
Klasse AUP	11,4901	11,06	10,96
Klasse AVC	10,6766 ⁴	10,34 ⁴	10,31 ⁴
Klasse AVH	11,2527 ⁴	10,69 ⁴	10,31 ⁴
Klasse DEH	11,4496 ¹	10,98 ¹	10,87 ¹
Klasse IEH	12,0793 ¹	11,53 ¹	11,31 ¹
Klasse IGH	12,6653 ⁵	12,02 ⁵	11,65 ⁵
Klasse ISH	13,0723 ³	12,34 ³	11,85 ³
Klasse IU	13,2627	12,46	11,87
Klasse XU	12,4181	11,63	11,00
Klasse ZU	13,2940	12,50	11,91
Klasse ZUP	10,9402	10,50	–

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf AUD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁵Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.^fSiehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		38.976.738
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	969.783
Zinsen aus Bankguthaben	2	22.125
Erträge insgesamt		991.908
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(110.543)
Bankspesen		(105)
Zinsaufwand aus Swaps		(19.459)
Sonstige Betriebskosten	5	(44.711)
Sonstige Gebühren	4	(22.448)
Aufwendungen insgesamt		(197.266)
Nettoertrag aus Anlagen		794.642
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.084.414
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(215.222)
Realisierter Netto(verlust) aus		
Devisenterminkontrakten		(242.290)
Realisierter Netto(verlust) aus		
Devisengeschäften		(44.255)
Realisierter Nettogewinn		582.647
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus		
Anlagen		953.441
Änderung des nicht realisierten		
Nettogewinns aus Swaps		196.459
Änderung des nicht realisierten		
Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		8.369
Nettoänderung bei nicht realisiertem		1.158.269
Nettogewinn		1.158.269
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus		2.535.558
Geschäftstätigkeit		
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		37.788.394
Anteilrücknahmen		(36.457.919)
Dividendenausschüttung	7	(2.999)
Kapitalbewegungen insgesamt		1.327.476
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		42.839.772

GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
	42.839.772	38.976.738	48.999.177

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	21.622.557
Bankguthaben	2	449.474
Termineinlagen	2, 19	2.595.422
Forderungen aus Zeichnungen		35.719
Erhaltene Vermögensverwaltungsgebühren		6.067
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		13.465
Summe Aktiva		24.722.704
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(247.554)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(5)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(160.023)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(5.247)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(11.554)
Andere Verbindlichkeiten		(4.169)
Summe Passiva		(428.552)
Nettovermögen insgesamt		24.294.152

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	51.672,971
Klasse AEP	48.322,200
Klasse DE	50.297,244
Klasse IE	110.875,982
Klasse IEP	48.322,200
Klasse LE	1.891.659,886
Klasse LEP	48.322,200
Klasse ZE	48.322,200
Klasse ZEP	48.322,200

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019
Klasse AE	10,2473	10,03
Klasse AEP	10,1911	9,99
Klasse DE	10,1375	9,96
Klasse IE	10,3507	10,10
Klasse IEP	10,2934	10,05
Klasse LE	10,3740	10,11
Klasse LEP	10,3157	10,07
Klasse ZE	10,3211	10,08
Klasse ZEP	10,2648	10,03

[#]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		22.759.479
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	12.481
Zinsen aus Anleihen, netto	2	16.785
Zinsen aus Bankguthaben	2	184
Zinsen aus Futures		177
Vermögensverwaltungsgebühr	2	10.783
Andere Erträge		1.404
Erträge insgesamt		41.814
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(69.120)
Bankspesen		(8.332)
Zinsaufwand aus Futures		(569)
Sonstige Betriebskosten	5	(25.052)
Aufwendungen insgesamt		(103.073)
Netto(verlust) aus Anlagen		(61.259)
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(21.464)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		194.021
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(10.059)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(26.698)
Realisierter Nettogewinn		135.800
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		643.508
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(110.408)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Futures		(21.147)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		511.953
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		586.494
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		1.182.794
Anteilrücknahmen		(232.199)
Dividendenausschüttung	7	(2.416)
Kapitalbewegungen insgesamt		948.179
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		24.294.152

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019
EUR	24.294.152	22.759.479

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	47.767.385
Bankguthaben	2	3.938.060
Termineinlagen	2, 19	4.717.895
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		102.626
Forderungen aus Zeichnungen		39.913
Erhaltene Vermögensverwaltungsgebühr		7.862
Zinsforderungen aus Swaps	2	5.613
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		52.741
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2,10	476.249
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2, 11	276.652
Sonstige Vermögenswerte		11.029
Summe Aktiva		57.396.025
Passiva		
Überziehungskredite		(75)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(145.975)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(225.602)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(375.678)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(62.997)
Andere Verbindlichkeiten		(14.004)
Summe Passiva		(824.331)
Nettovermögen insgesamt		56.571.694

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	147.134,384
Klasse AEH	404.166,732
Klasse AKH	100,000
Klasse AU	421.210,527
Klasse AUP	496.194,214
Klasse DEH	118.539,064
Klasse DU	237.707,246
Klasse IEH	100,000
Klasse IGH	12.209,135
Klasse IU	358.658,010
Klasse W	26.123,425

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEC	12,8231 ¹	12,83 ¹	13,64 ¹
Klasse AEH	25,6731 ¹	25,52 ¹	26,78 ¹
Klasse AKH [#]	100,0973 ²	—	—
Klasse AU	37,5453	36,74	37,42
Klasse AUP	14,4604	14,24	14,70
Klasse BU	—	—	10,06
Klasse DEH	18,7168 ¹	18,66 ¹	19,72 ¹
Klasse DU	24,8486	24,40	25,01
Klasse IEH [#]	9,9642 ¹	—	—
Klasse IGH	25,7456 ³	25,36 ³	26,15 ³
Klasse IU	27,5485	26,86	27,17
Klasse W	61,9187	60,62	61,81

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.[#]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		59.178.404
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	152.612
Zinsen aus Anleihen, netto	2	189.524
Zinsen aus Bankguthaben	2	110.714
Zinsen aus Swaps		91.041
Zinsen aus Futures		12.931
Vermögensverwaltungsgebühr	2	12.946
Andere Erträge		15.848
Erträge insgesamt		585.616
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(399.282)
Bankspesen		(4.121)
Zinsaufwand aus Swaps		(8.614)
Zinsaufwand aus Futures		(1.646)
Sonstige Betriebskosten	5	(84.171)
Aufwendungen insgesamt		(497.834)
Nettoertrag aus Anlagen		87.782
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		418.722
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(222.590)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(473.032)
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(978.573)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(66.267)
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderung		(61)
Realisierter Netto(verlust)		(1.321.801)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.269.030
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		181.610
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(143.324)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		414.617
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		1.721.933
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		487.914
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		4.381.090
Anteilrücknahmen		(7.412.270)
Dividendenausüttung	7	(63.444)
Kapitalbewegungen insgesamt		(3.094.624)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		56.571.694

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	56.571.694	59.178.404	70.260.271

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	257.460.292
Bankguthaben	2	8.219.591
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		4.558.149
Forderungen aus Zeichnungen		592.210
Erhaltene Vermögensverwaltungsgebühr	2	56.166
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.833.412
Sonstige Vermögenswerte		22.918
Summe Aktiva		272.742.738
Passiva		
Überziehungskredite		(435.614)
Zum Marktwert verkaufte Optionen	2, 12	(205.188)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(4.737.993)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(411.999)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(1.963.946)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(334.299)
Andere Verbindlichkeiten		(66.447)
Summe Passiva		(8.155.486)
Nettovermögen insgesamt		264.587.252

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	93.219,102
Klasse AEC	9.902.685,611
Klasse AEH	1.654.455,707
Klasse AEP	1.844.353,436
Klasse AS	100,000
Klasse ASC	11.579,834
Klasse ASH	2.331,359
Klasse ASP	5.285,702
Klasse AU	885.638,110
Klasse AUM	100,000
Klasse AUP	1.060.606,973
Klasse DEC	6.106.242,131
Klasse DEH	649.080,494
Klasse DEP	606.325,771
Klasse DU	640.155,398
Klasse DUP	2.236.500,001
Klasse ZE	148.272,430
Klasse ZEC	100,000
Klasse ZEH	15.181,566
Klasse ZFH	100,000
Klasse ZU	118.062,457
Klasse ZUP	100,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		281.201.768
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.882.700
Zinsen aus Anleihen, netto	2	2.516.196
Zinsen aus Bankguthaben	2	37.049
Zinsen aus Futures		74.362
Vermögensverwaltungsgebühr	2	113.772
Andere Erträge		40
Erträge insgesamt		5.624.119
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(2.123.301)
Bankspesen		(64.780)
Zinsaufwand aus Futures		(6.068)
Sonstige Betriebskosten	5	(420.010)
Aufwendungen insgesamt		(2.614.159)
Nettoertrag aus Anlagen		3.009.960
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		607.326
Realisierter Netto(verlust) aus Optionen		(3.183.113)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(2.717.956)
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(36)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(49.202)
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderung		(839)
Realisierter Netto(verlust)		(5.343.820)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(63.477)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Optionen		92.959
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(811.455)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(781.973)
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(3.115.833)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		34.954.940
Anteilrücknahmen		(42.708.034)
Dividendenausschüttung	7	(5.745.589)
Kapitalbewegungen insgesamt		(13.498.683)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		264.587.252

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	264.587.252	281.201.768	298.226.164

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AE	11,0244 ¹	10,48 ¹	9,50 ¹
Klasse AEC	8,2890 ¹	8,48 ¹	9,22 ¹
Klasse AEH	16,9536 ¹	16,86 ¹	17,26 ¹
Klasse AEP	9,8996 ¹	9,68 ¹	9,32 ¹
Klasse AS	10,4903 ²	10,08 ²	–
Klasse ASC	9,5169 ²	9,62 ²	–
Klasse ASH	10,2376 ²	10,07 ²	–
Klasse ASP	9,6222 ²	9,49 ²	–
Klasse AU	18,7221	18,33	18,20
Klasse AUM [#]	10,0376	–	–
Klasse AUP	9,4857	9,55	10,07
Klasse DEC	7,9825 ¹	8,19 ¹	8,98 ¹
Klasse DEH	9,8363 ¹	9,82 ¹	10,13 ¹
Klasse DEP	9,4540 ¹	9,28 ¹	9,00 ¹
Klasse DU	11,7243	11,52	11,53
Klasse DUP	8,7677	8,86	9,42
Klasse ZE	11,1664 ¹	10,58 ¹	9,54 ¹
Klasse ZEC	9,0806 ¹	9,26 ¹	–
Klasse ZEH	10,1259 ¹	10,05 ¹	10,23 ¹
Klasse ZFH	10,0529 ³	9,99 ³	–
Klasse ZU	10,8336	10,58	10,45
Klasse ZUP	9,4551	9,50	–

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

[#]Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	822.714.242
Bankguthaben	2	21.991.605
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		11.040.076
Forderungen aus Zeichnungen		9.048.704
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		481.257
Sonstige Vermögenswerte		21.496
Summe Aktiva		865.297.380
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.195.027)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(23.432.103)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(663.705)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(763.265)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(1.401.035)
Andere Verbindlichkeiten		(196.039)
Summe Passiva		(28.651.174)
Nettovermögen insgesamt		836.646.206

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	751.836,086
Klasse AEP	184.686,588
Klasse AU	4.938.255,473
Klasse AUP	5.133,658
Klasse DEH	149.314,136
Klasse DU	445.100,245
Klasse IE	4.277.859,034
Klasse IEH	78.229,267
Klasse IU	7.781.417,322
Klasse IUP	100,000
Klasse W	18.014,468
Klasse XU	3.667.407,433
Klasse ZE	706.643,416
Klasse ZEP	2.001.127,446
Klasse ZG	635.684,042
Klasse ZU	8.694.557,796

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ¹	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEH	42,0539 ¹	39,72 ¹	37,45 ¹
Klasse AEP	14,8549 ¹	13,51 ¹	11,37 ¹
Klasse AU	68,8217	64,03	58,62
Klasse AUP	11,1324	10,43	–
Klasse BU	–	–	10,36
Klasse DEH	30,7011 ¹	29,11 ¹	27,65 ¹
Klasse DU	36,1780	33,79	31,16
Klasse IE	13,9025 ¹	12,50 ¹	10,36 ¹
Klasse IEH	11,1787 ¹	10,51 ¹	–
Klasse IU	13,8764	12,86	11,67
Klasse IUP	11,2494	10,49	–
Klasse W	105,0529	97,72	89,41
Klasse XU	15,9278	14,70	13,23
Klasse ZE	15,6999 ¹	14,13 ¹	11,72 ¹
Klasse ZEP	15,1030 ¹	13,68 ¹	11,49 ¹
Klasse ZG	16,2240 ²	14,22 ²	12,00 ²
Klasse ZU	16,8312	15,60	14,18

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		640.308.193
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.501.103
Zinsen aus Bankguthaben	2	161.981
Erträge insgesamt		4.663.084
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(4.103.978)
Bankspesen		(654)
Sonstige Betriebskosten	5	(1.099.396)
Aufwendungen insgesamt		(5.204.028)
Netto(verlust) aus Anlagen		(540.944)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		31.950.018
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.388.264)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(952.477)
Realisierter Netto(verlust) aus Kapitalertragsteuer		(4.946)
Realisierter Nettogewinn		29.604.331
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		24.698.195
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(359.656)
Nettoveränderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragsteuer		(784.293)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		23.554.246
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		52.617.633
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		649.926.164
Anteilrücknahmen		(505.968.207)
Dividendenausschüttung	7	(237.577)
Kapitalbewegungen insgesamt		143.720.380
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		836.646.206

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	836.646.206	640.308.193	449.478.043

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	93.918.751
Bankguthaben	2	1.220.609
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		221.017
Forderungen aus Zeichnungen		2.318
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		137.086
Sonstige Vermögenswerte		1.038
Summe Aktiva		95.500.819
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(8.572)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(18.146)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(77.057)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(100.831)
Andere Verbindlichkeiten		(13.761)
Summe Passiva		(218.367)
Nettovermögen insgesamt		95.282.452

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	2.822,346
Klasse AU	9.589,330
Klasse DEH	44.339,524
Klasse DU	71.318,908
Klasse IEH	659,367
Klasse IU	4.676.205,000
Klasse ZU	200,000
Klasse 1E	3.245.875,172
Klasse 1U	4.829.204,018
Klasse 2E	2.030.150,894
Klasse 2U	100,000
Klasse 8E	1.156.290,447
Klasse 8U	1.689.556,789

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ^f	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEH	28,3878 ¹	28,73 ¹	33,07 ¹
Klasse AU	44,5671	44,39	49,41
Klasse DEH	20,4599 ¹	20,77 ¹	24,09 ¹
Klasse DU	31,5375	31,53	35,36
Klasse IEH	16,8750 ¹	17,00 ¹	19,41 ¹
Klasse IU ^f	10,4806	–	–
Klasse ZU	10,0502	9,97	11,02
Klasse 1E	1,3201 ¹	1,28 ¹	–
Klasse 1U	1,4390	1,43	–
Klasse 2E	11,9492 ¹	11,51 ¹	–
Klasse 2U	11,4874	11,40	–
Klasse 8E	1,4301 ¹	1,38 ¹	–
Klasse 8U	1,5592	1,55	–

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.
^fSiehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		47.448.924
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	669.070
Zinsen aus Bankguthaben	2	16.101
Erträge insgesamt		685.171
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(382.509)
Bankspesen		(2.763)
Sonstige Betriebskosten	5	(59.582)
Aufwendungen insgesamt		(444.854)
Nettoertrag aus Anlagen		240.317
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		298.046
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(43.660)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(29.214)
Realisierter Netto(verlust) aus Kapitalertragsteuer		(387)
Realisierter Nettogewinn		224.785
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(2.146.683)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(6.898)
Nettoveränderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragsteuer		(73.528)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(2.227.109)
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(1.762.007)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		52.612.564
Anteilrücknahmen		(3.017.029)
Kapitalbewegungen insgesamt		49.595.535
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		95.282.452

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	95.282.452	47.448.924	4.616.973

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	572.209.487
Bankguthaben	2	267.294
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		2.943.791
Forderungen aus Zeichnungen		156.997
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.134.758
Sonstige Vermögenswerte		2
Summe Aktiva		576.712.329
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(7.248.896)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.076.652)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(61.154)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(469.150)
Andere Verbindlichkeiten		(68.832)
Summe Passiva		(9.924.684)
Nettovermögen insgesamt		566.787.645

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	100,000
Klasse AUP	100,000
Klasse DEC	100,000
Klasse DUP	100,000
Klasse IU	100,000
Klasse TE	100,000
Klasse ZU	100,000
Klasse 1E	2.609.888,741
Klasse 1EP	1.866.482,823
Klasse 1SC	649.685,886
Klasse 1SH	140.482,465
Klasse 1ST	323.473,107
Klasse 1U	889.902,658
Klasse 1UP	705.304,205
Klasse 1VT	10.329,191
Klasse 2E	1.420.944,570
Klasse 2EP	21.233.852,945
Klasse 2U	100,000
Klasse 2UP	5.279.389,571
Klasse 3E	294.798,654
Klasse 3EP	13.143.812,374
Klasse 3U	38.500,926
Klasse 3UP	35.975,730
Klasse 8E	146.340,590
Klasse 8EP	165,977
Klasse 8U	13.158,578
Klasse 8UP	71.308,213
Klasse 9E	100,000
Klasse 9EP	100,000
Klasse 9U	100,000
Klasse 9UP	100,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		896.154.687
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	12.720.748
Zinsen aus Bankguthaben	2	89.199
Erträge insgesamt		12.809.947
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(3.572.714)
Bankspesen		(6.402)
Sonstige Betriebskosten	5	(439.753)
Aufwendungen insgesamt		(4.018.869)
Nettoertrag aus Anlagen		8.791.078
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		32.387.374
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(191.593)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(181.497)
Realisierter Nettogewinn		32.014.284
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(18.069.354)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(62.527)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(18.131.881)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		22.673.481
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		90.505.698
Anteilrücknahmen		(430.164.144)
Dividendenausschüttung	7	(12.382.077)
Kapitalbewegungen insgesamt		(352.040.523)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		566.787.645

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019
USD	566.787.645	896.154.687

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019
Klasse AEC	9,9429 ¹	10,11 ¹
Klasse AUP	10,2622	10,27
Klasse DEC	9,9041 ¹	10,09 ¹
Klasse DUP	10,2050	10,24
Klasse IU	10,7278	10,45
Klasse TE	11,2727 ¹	10,66 ¹
Klasse ZU	10,7243	10,45
Klasse 1E	11,2089 ¹	10,64 ¹
Klasse 1EP	10,8233 ¹	10,51 ¹
Klasse 1SC	10,1907 ²	10,25 ²
Klasse 1SH	10,5675 ²	10,38 ²
Klasse 1ST	10,1940 ²	10,25 ²
Klasse 1U	10,6660	10,43
Klasse 1UP	10,2853	10,29
Klasse 1VT	10,1621 ³	10,24 ³
Klasse 2E	11,4806 ¹	10,86 ¹
Klasse 2EP	10,8868 ¹	10,54 ¹
Klasse 2U	10,7232	10,45
Klasse 2UP	10,3617	10,33
Klasse 3E	11,2878 ¹	10,67 ¹
Klasse 3EP	10,9003 ¹	10,54 ¹
Klasse 3U	10,7411	10,46
Klasse 3UP	10,3761	10,34
Klasse 8E	11,2641 ¹	10,66 ¹
Klasse 8EP	10,8529 ¹	10,51 ¹
Klasse 8U	10,7215	10,45
Klasse 8UP	10,3432	10,32
Klasse 9E	11,3025 ¹	10,68 ¹
Klasse 9EP	10,8931 ¹	10,52 ¹
Klasse 9U	10,7551	10,46
Klasse 9UP	10,3593	10,31

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf AUD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

[#]Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - Global Select

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	465.257.954
Bankguthaben	2	830.524
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		665.485
Forderungen aus Zeichnungen		231.988
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		259.284
Sonstige Vermögenswerte		25.951
Summe Aktiva		467.271.186
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.588.509)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(40.339)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(518.850)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(240.551)
Andere Verbindlichkeiten		(71.970)
Summe Passiva		(3.460.219)
Nettovermögen insgesamt		463.810.967

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IU	293.808,669
Klasse ZU	100,000
Klasse 1E	40.997.987,675
Klasse 1U	65.089.188,836
Klasse 2E	100,000
Klasse 2U	306.806,333
Klasse 3U	9.963.406,563
Klasse 8E	121.976,592
Klasse 8U	18.847.504,867
Klasse 9U	73.667,379

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019
Klasse IU	11,3223	10,66
Klasse ZU	11,3168	10,66
Klasse 1E	2,9065 ¹	2,67 ¹
Klasse 1U	3,1683	2,99
Klasse 2E	11,8332 ¹	10,82 ¹
Klasse 2U	11,3169	10,66
Klasse 3U	3,3159	3,12
Klasse 8E	4,2079 ¹	3,85 ¹
Klasse 8U	4,5867	4,32
Klasse 9U	11,3319	10,66

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.[#]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		441.869.956
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.753.276
Zinsen aus Bankguthaben	2	69.094
Erträge insgesamt		2.822.370
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(3.078.071)
Bankspesen		(368)
Sonstige Betriebskosten	5	(374.375)
Aufwendungen insgesamt		(3.452.814)
Netto(verlust) aus Anlagen		(630.444)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		12.317.438
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(7.229)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		12.170
Realisierter Netto(verlust) aus Kapitalertragsteuer		(1.076)
Realisierter Nettogewinn		12.321.303
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		14.829.867
Nettoveränderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragsteuer		(240.551)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		14.589.316
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		26.280.175
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		193.091.145
Anteilrücknahmen		(197.430.309)
Kapitalbewegungen insgesamt		(4.339.164)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		463.810.967

GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	30. September 2019	31. März 2019
	463.810.967	441.869.956

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	383.259.858
Bankguthaben	2	3.996.127
Forderungen aus Zeichnungen		8.407.440
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		134.400
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	2.462
Sonstige Vermögenswerte		30.172
Summe Aktiva		395.830.459
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(10.879.387)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(82.173)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(292.185)
Andere Verbindlichkeiten		(77.429)
Summe Passiva		(11.331.174)
Nettovermögen insgesamt		384.499.285

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	3.353.891,465
Klasse AEP	1.094.115,061
Klasse AUP	100,000
Klasse DE	482.159,004
Klasse IE	2.224.821,365
Klasse NE	2.124.611,000
Klasse XE	1.486.147,433
Klasse XG	100,000
Klasse XGH	100,000
Klasse ZE	813.728,998
Klasse ZFH	100,000
Klasse ZG	30.078,367
Klasse ZGH	12.465,876
Klasse ZU	9.529.771,575

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ^f	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AE	33,0552	29,93	26,62
Klasse AEP	11,1091	10,06	–
Klasse AGH	–	–	26,84 ¹
Klasse AUP	10,2823 ²	9,59 ²	–
Klasse DE	25,3967	23,05	20,61
Klasse IE	47,2701	42,61	37,58
Klasse IGH	–	–	36,65 ¹
Klasse NE ^f	10,3368	–	–
Klasse XE	11,8092	10,60	–
Klasse XG	11,8942 ¹	10,41 ¹	–
Klasse XGH	16,0343 ¹	14,34 ¹	12,44 ¹
Klasse ZE	11,6567	10,51	–
Klasse ZFH	11,5630 ³	10,45 ³	–
Klasse ZG	11,7524 ¹	10,32 ¹	–
Klasse ZGH	33,9390 ¹	30,48 ¹	26,67 ¹
Klasse ZU	10,7750 ²	10,01 ²	–

^fDie Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.²Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.⁴Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		196.527.339
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.695.719
Zinsen aus Bankguthaben	2	52.078
Erträge insgesamt		1.747.797
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.445.311)
Bankspesen		(4.714)
Sonstige Betriebskosten	5	(354.029)
Aufwendungen insgesamt		(1.804.054)
Netto(verlust) aus Anlagen		(56.257)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		11.251.142
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		11.121
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(142.718)
Realisierter Nettogewinn		11.119.545
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		13.713.009
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		4.764
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		13.717.773
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		24.781.061
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		265.053.404
Anteilrücknahmen		(101.862.519)
Kapitalbewegungen insgesamt		163.190.885
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		384.499.285

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
EUR	384.499.285	196.527.339	29.122.424

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	938.350.214
Bankguthaben	2	3.944.428
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		2.359.078
Forderungen aus Zeichnungen		538.167
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		583.323
Sonstige Vermögenswerte		592
Summe Aktiva		945.775.802
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.591.239)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(540.270)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(1.685.900)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(814.780)
Andere Verbindlichkeiten		(132.750)
Summe Passiva		(4.764.939)
Nettovermögen insgesamt		941.010.863

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	1.006.374,302
Klasse AU	375.263,144
Klasse DEH	73.804,221
Klasse DU	693.000,336
Klasse IEH	482.431,236
Klasse IU	6.234.323,093
Klasse W	2.042,035
Klasse ZE	34.695,509
Klasse ZEH	1.330.035,499
Klasse ZU	100,000
Klasse 1E	4.005.205,944
Klasse 1EH	623.480,254
Klasse 1EP	367.852,844
Klasse 1U	14.703.116,059
Klasse 2E	1.014.219,352
Klasse 2U	11.302.361,297
Klasse 3EH	10.625,846
Klasse 3U	607.294,559
Klasse 8E	1.645.931,955
Klasse 8U	5.255.284,955
Klasse 9EH	100.100,000
Klasse 9U	4.305.184,452

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		907.780.896
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	5.221.873
Zinsen aus Bankguthaben	2	41.814
Erträge insgesamt		5.263.687
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(4.968.341)
Bankspesen		(370)
Sonstige Betriebskosten	5	(803.092)
Aufwendungen insgesamt		(5.771.803)
Netto(verlust) aus Anlagen		(508.116)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		13.571.894
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(3.944.396)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		41.189
Realisierter Nettogewinn		9.668.687
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		44.426.608
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(750.104)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		43.676.504
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		52.837.075
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		78.954.116
Anteilrücknahmen		(98.561.224)
Kapitalbewegungen insgesamt		(19.607.108)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		941.010.863

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	941.010.863	907.780.896	229.967.862

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ¹	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEH	45,5493 ¹	43,59 ¹	42,33 ¹
Klasse AU	76,5685	72,16	68,00
Klasse BU	–	–	10,11
Klasse DEH	33,8877 ¹	32,49 ¹	31,68 ¹
Klasse DU	29,9407	28,27	26,73
Klasse IEH	48,4602 ¹	46,17 ¹	44,45 ¹
Klasse IU	51,5460	48,36	45,17
Klasse W	101,4178	95,43	89,67
Klasse ZE	11,4868 ¹	10,47 ¹	–
Klasse ZEH	10,3260 ¹	9,84 ¹	–
Klasse ZU	10,8238	10,16	–
Klasse 1E	11,1830 ¹	10,23 ¹	–
Klasse 1EH	10,2075 ¹	9,76 ¹	–
Klasse 1EP	11,1097 ¹	10,16 ¹	–
Klasse 1U	10,5292	9,92	–
Klasse 2E	11,2519 ¹	10,26 ¹	–
Klasse 2U	10,5924	9,95	–
Klasse 3EH	10,2825 ¹	9,80 ¹	–
Klasse 3U	10,6107	9,95	–
Klasse 8E	11,2464 ¹	10,25 ¹	–
Klasse 8U	10,5852	9,94	–
Klasse 9EH	10,2847 ¹	9,80 ¹	–
Klasse 9U	10,6103	9,95	–

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - American Select

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	339.478.629
Bankguthaben	2	11.358.248
Termineinlagen	2, 19	8.659.198
Forderungen aus Zeichnungen		112.766
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		94.929
Summe Aktiva		359.703.770
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(721.632)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(141.603)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(408.170)
Andere Verbindlichkeiten		(51.070)
Summe Passiva		(1.322.475)
Nettovermögen insgesamt		358.381.295

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AD	1.000,000
Klasse AEH	32.785,658
Klasse AN	1.000,000
Klasse AU	231.739,298
Klasse DEH	16.657,908
Klasse DU	169.477,537
Klasse ID	1.000,000
Klasse IE	100,000
Klasse IEH	163.700,081
Klasse IN	1.000,000
Klasse W	12.516,266
Klasse ZEH	100,000
Klasse ZU	32.640,000
Klasse 1E	16.068.963,231
Klasse 1EH	255.452,534
Klasse 1EP	576.583,035
Klasse 1U	46.013.460,475
Klasse 2EH	100,000
Klasse 2U	100,000
Klasse 3E	8.849.842,829
Klasse 3U	4.539.545,435
Klasse 8EH	216.213,855
Klasse 8U	3.650.723,618
Klasse 9E	100,000
Klasse 9U	100,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		363.379.073
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.150.370
Zinsen aus Bankguthaben	2	284.036
Erträge insgesamt		1.434.406
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(2.548.238)
Bankspesen		(62)
Sonstige Betriebskosten	5	(299.177)
Aufwendungen insgesamt		(2.847.477)
Netto(verlust) aus Anlagen		(1.413.071)
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(9.727)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(291.880)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		21.632
Realisierter Netto(verlust)		(279.975)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		14.843.077
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(81.967)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		14.761.110
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		13.068.064
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		48.896.050
Anteilrücknahmen		(66.961.892)
Kapitalbewegungen insgesamt		(18.065.842)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		358.381.295

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	358.381.295	363.379.073	9.353.783

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Select

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AD [#]	10,5381 ¹	–	–
Klasse AEH	28,7038 ²	28,15 ²	27,28 ²
Klasse AN [#]	10,8015 ³	–	–
Klasse AU	25,5491	24,67	23,20
Klasse DEH	19,8570 ²	19,54 ²	19,09 ²
Klasse DU	22,7811	22,08	20,92
Klasse ID [#]	10,5590 ¹	–	–
Klasse IE [#]	10,5695 ²	–	–
Klasse IEH	30,1036 ²	29,40 ²	28,27 ²
Klasse IN [#]	10,8207 ³	–	–
Klasse W	27,0008	26,07	24,50
Klasse ZEH	10,1591 ²	9,92 ²	–
Klasse ZU	10,6392	10,24	–
Klasse 1E	4,0158 ²	3,76 ²	–
Klasse 1EH	3,0368 ²	2,98 ²	–
Klasse 1EP	3,9933 ²	3,74 ²	–
Klasse 1U	4,3779	4,23	–
Klasse 2EH	10,4873 ²	10,24 ²	–
Klasse 2U	10,7856	10,38	–
Klasse 3E	3,2304 ²	3,01 ²	–
Klasse 3U	3,5217	3,38	–
Klasse 8EH	2,6387 ²	2,58 ²	–
Klasse 8U	4,9900	4,80	–
Klasse 9E	11,2616 ²	10,51 ²	–
Klasse 9U	10,8130	10,39	–

¹Die Klasse lautet auf DKK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

[#]Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	229.062.047
Bankguthaben	2	2.376.278
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.862.722
Forderungen aus Zeichnungen		121.352
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		264.424
Sonstige Vermögenswerte		15
Summe Aktiva		233.686.838
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(4.889.571)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(653.026)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(838)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(228.464)
Andere Verbindlichkeiten		(29.522)
Summe Passiva		(5.801.421)
Nettovermögen insgesamt		227.885.417

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	100,000
Klasse AU	100,000
Klasse DEH	100,000
Klasse DU	100,000
Klasse IE	100,000
Klasse IU	100,000
Klasse ZU	100,000
Klasse 1E	84.487,929
Klasse 1EP	934.889,176
Klasse 1U	10.016.194,933
Klasse 2U	2.142.934,358
Klasse 3EH	3.961,863
Klasse 3U	1.994.582,596
Klasse 8U	1.952.367,344
Klasse 9EH	100,000
Klasse 9U	3.569.216,396

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019
Klasse AEH	10,5576 ¹	10,53 ¹
Klasse AU	10,8846	10,69
Klasse DEH	10,5089 ¹	10,51 ¹
Klasse DU	10,8317	10,66
Klasse IE [#]	10,4605 ¹	–
Klasse IU	10,9705	10,72
Klasse ZU	10,9636	10,72
Klasse 1E	11,4699 ¹	10,92 ¹
Klasse 1EP	11,3847 ¹	10,84 ¹
Klasse 1U	10,9003	10,69
Klasse 2U	10,9633	10,72
Klasse 3EH	10,6455 ¹	10,57 ¹
Klasse 3U	10,9751	10,73
Klasse 8U	10,9643	10,72
Klasse 9EH	10,6642 ¹	10,58 ¹
Klasse 9U	10,9827	10,73

[#]Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.¹Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		256.158.593
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.085.401
Zinsen aus Bankguthaben	2	15.679
Erträge insgesamt		1.101.080
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.480.581)
Bankspesen		(93)
Sonstige Betriebskosten	5	(195.572)
Aufwendungen insgesamt		(1.676.246)
Netto(verlust) aus Anlagen		(575.166)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		22.271.744
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(2.301)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		956
Realisierter Nettogewinn		22.270.399
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(15.760.933)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(195)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(15.761.128)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		5.934.105
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		24.412.131
Anteilrücknahmen		(58.619.412)
Kapitalbewegungen insgesamt		(34.207.281)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		227.885.417

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019
USD	227.885.417	256.158.593

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	151.015.729
Bankguthaben	2	1.991.809
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		379.228
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		448.058
Sonstige Vermögenswerte		469
Summe Aktiva		153.835.293
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.294.254)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(6.848)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(2.794)
Andere Verbindlichkeiten		(19.437)
Summe Passiva		(1.323.333)
Nettovermögen insgesamt		152.511.960

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	3.968,881
Klasse AF	100,000
Klasse AS	100,000
Klasse ASH	53.750,078
Klasse AU	24.443,604
Klasse DE	5.985,104
Klasse IE	7.158,196
Klasse IF	100,000
Klasse ISH	630,000
Klasse IU	13.458,969
Klasse XU	3.644.224,576
Klasse XUP	9.775.558,080
Klasse ZE	107.643,000
Klasse ZEH	360,000
Klasse ZF	100,000
Klasse ZG	100,000
Klasse ZU	50.135,906

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AE	13,3272 ¹	13,82 ¹	13,78 ¹
Klasse AF	13,3548 ²	14,25 ²	14,97 ²
Klasse AS	9,9395 ³	10,41 ³	11,02 ³
Klasse ASH	12,2935 ³	13,21 ³	14,60 ³
Klasse AU	12,6814	13,55	14,80
Klasse DE	12,8531 ¹	13,38 ¹	13,44 ¹
Klasse IE	13,7416 ¹	14,19 ¹	14,03 ¹
Klasse IF	13,7594 ²	14,62 ²	15,23 ²
Klasse ISH	12,8315 ³	13,72 ³	15,05 ³
Klasse IU	13,2033	14,04	15,21
Klasse XU [#]	9,8720	–	–
Klasse XUP	11,5628	12,51	13,80
Klasse ZE	13,7313 ¹	14,19 ¹	14,05 ¹
Klasse ZEH	12,0199 ¹	13,00 ¹	14,55 ¹
Klasse ZF	13,7639 ²	14,63 ²	15,25 ²
Klasse ZG	9,0871 ⁴	9,14 ⁴	–
Klasse ZU	13,1884	14,03	15,21

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.[#]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		185.676.126
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	3.127.828
Zinsen aus Bankguthaben	2	33.202
Erträge insgesamt		3.161.030
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(96.229)
Bankspesen		(522)
Sonstige Betriebskosten	5	(137.817)
Aufwendungen insgesamt		(234.568)
Nettoertrag aus Anlagen		2.926.462
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(3.368.545)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(9.683)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(50.643)
Realisierter Netto(verlust)		(3.428.871)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(9.274.002)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(6.375)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(9.280.377)
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(9.782.786)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		51.111.889
Anteilrücknahmen		(72.063.788)
Dividendenausschüttung	7	(2.429.481)
Kapitalbewegungen insgesamt		(23.381.380)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		152.511.960

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	152.511.960	185.676.126	190.906.857

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	224.580.539
Bankguthaben	2	670.443
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.100.382
Forderungen aus Zeichnungen		30.160
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		477.232
Sonstige Vermögenswerte		77
Summe Aktiva		226.858.833
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(196.962)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(219.501)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(244.902)
Andere Verbindlichkeiten		(24.850)
Summe Passiva		(686.215)
Nettovermögen insgesamt		226.172.618

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IE	106,867
Klasse IU	24.310,282
Klasse ZU	100,000
Klasse 1E	1.511.538,600
Klasse 1U	26.513.812,432
Klasse 2E	9.145.394,551
Klasse 2U	2.017.261,816
Klasse 3U	1.384.513,010
Klasse 8E	474,483
Klasse 8U	2.159.495,185
Klasse 9U	93.303,441

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019
Klasse IE [#]	10,4363 ¹	-
Klasse IU	10,6920	10,72
Klasse ZU	10,6881	10,72
Klasse 1E	2,6606 ¹	2,60 ¹
Klasse 1U	2,9004	2,92
Klasse 2E	11,1771 ¹	10,88 ¹
Klasse 2U	10,6907	10,72
Klasse 3U	2,5671	2,57
Klasse 8E	3,0018 ¹	2,92 ¹
Klasse 8U	3,2719	3,28
Klasse 9U	10,7037	10,72

[#]Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.¹Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		235.034.331
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.052.445
Zinsen aus Bankguthaben	2	33.097
Vermögensverwaltungsgebühr	2	1.813
Erträge insgesamt		4.087.355
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.369.205)
Bankspesen		(410)
Sonstige Betriebskosten	5	(155.046)
Aufwendungen insgesamt		(1.524.661)
Nettoertrag aus Anlagen		2.562.694
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(838.608)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		21.935
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(16.408)
Realisierter Netto(verlust) aus Kapitalertragsteuer		(749)
Realisierter Netto(verlust)		(833.830)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(2.535.076)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragsteuer		(73.073)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(2.608.149)
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(879.285)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		2.903.479
Anteilrücknahmen		(10.885.907)
Kapitalbewegungen insgesamt		(7.982.428)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		226.172.618

GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	30. September 2019	31. März 2019
	226.172.618	235.034.331

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Focus*

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	27. Mai 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AE [#]	–	14,49 ¹	14,08 ¹
Klasse AF [#]	–	14,83 ²	15,18 ²
Klasse AS [#]	–	10,71 ³	11,05 ³
Klasse ASH [#]	–	13,88 ³	14,95 ³
Klasse AU [#]	–	14,16	15,06
Klasse DE [#]	–	14,03 ¹	13,74 ¹
Klasse DEH [#]	–	12,54 ¹	13,89 ¹
Klasse IE [#]	–	14,87 ¹	14,33 ¹
Klasse IF [#]	–	15,22 ²	15,45 ²
Klasse ISH [#]	–	14,41 ³	15,39 ³
Klasse IU [#]	–	14,71	15,52
Klasse XUP [#]	–	14,08	14,75
Klasse ZE [#]	–	14,88 ¹	14,35 ¹
Klasse ZEH [#]	–	13,62 ¹	14,86 ¹
Klasse ZF [#]	–	15,24 ²	15,47 ²
Klasse ZG [#]	–	9,40 ⁴	–
Klasse ZU [#]	–	14,68	15,51

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.[#]Siehe Erläuterung 1.ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG
DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 27. Mai 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		5.823.895
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	35.564
Zinsen aus Bankguthaben	2	1.123
Erträge insgesamt		36.687
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(7.141)
Sonstige Betriebskosten	5	(1.871)
Aufwendungen insgesamt		(9.012)
Nettoertrag aus Anlagen		27.675
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		152.674
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(2.898)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(11)
Realisierter Nettogewinn		149.765
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(646.973)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		402
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(646.571)
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(469.131)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Anteilrücknahmen		(5.354.764)
Kapitalbewegungen insgesamt		(5.354.764)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		–

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	27. Mai 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	–	5.823.895	6.490.902

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	10.087.854
Bankguthaben	2	385.187
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		453.750
Forderungen aus Zeichnungen		1.674
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		54.877
Sonstige Vermögenswerte		212
Summe Aktiva		10.983.554
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(58.936)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(509.896)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(80.626)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(15.304)
Andere Verbindlichkeiten		(3.069)
Summe Passiva		(667.831)
Nettovermögen insgesamt		10.315.723

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	461,560
Klasse AEP	4.953,947
Klasse AF	100,000
Klasse AFP	100,000
Klasse ASC	966.659,229
Klasse ASH	67.161,674
Klasse ASP	100,000
Klasse AU	21.827,893
Klasse AUP	124.029,295
Klasse AVC	99.888,013
Klasse AVH	25.593,225
Klasse DE	665,397
Klasse IE	100,000
Klasse IEP	100,000
Klasse IF	100,000
Klasse IFP	100,000
Klasse ISH	630,000
Klasse IU	99,997
Klasse IUP	100,000
Klasse ZE	100,000
Klasse ZEH	360,281
Klasse ZEP	100,000
Klasse ZF	100,000
Klasse ZFP	100,000
Klasse ZU	4.115,700
Klasse ZUP	100,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		16.336.363
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	386.770
Zinsen aus Bankguthaben	2	5.475
Erträge insgesamt		392.245
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(110.320)
Bankspesen		(205)
Sonstige Betriebskosten	5	(22.113)
Aufwendungen insgesamt		(132.638)
Nettoertrag aus Anlagen		259.607
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(99.905)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(269.624)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(13.593)
Realisierter Netto(verlust)		(383.122)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(710.453)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(93.572)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(804.025)
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(927.540)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		1.425.962
Anteilrücknahmen		(6.348.576)
Dividendenausschüttung	7	(170.486)
Kapitalbewegungen insgesamt		(5.093.100)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		10.315.723

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	10.315.723	16.336.363	22.261.222

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ^f	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AE	13,290 ¹	13,53 ¹	13,00 ¹
Klasse AEP	12,574 ¹	13,18 ¹	13,00 ¹
Klasse AF	13,224 ²	13,85 ²	14,02 ²
Klasse AFP	12,382 ²	13,35 ²	14,02 ²
Klasse ASC	10,139 ³	10,85 ³	11,96 ³
Klasse ASH	12,194 ³	12,86 ³	13,70 ³
Klasse ASP	10,166 ³	10,61 ³	11,13 ³
Klasse AU	12,6572	13,27	13,97
Klasse AUP	10,5824	11,27	12,27
Klasse AVC	10,076 ⁴	10,81 ⁴	11,86 ⁴
Klasse AVH	11,677 ⁴	12,33 ⁴	13,11 ⁴
Klasse DE	12,8174 ¹	13,10 ¹	12,68 ¹
Klasse IE	13,692 ²	13,88 ¹	13,23 ¹
Klasse IEP	12,8168 ¹	13,37 ¹	13,23 ¹
Klasse IF	13,621 ²	14,20 ²	14,27 ²
Klasse IFP	12,600 ²	13,53 ²	14,27 ²
Klasse ISH	12,729 ³	13,36 ³	14,12 ³
Klasse IU	13,1916	13,78	14,39
Klasse IUP	12,5271	13,47	14,60
Klasse ZE	13,7037 ¹	13,89 ¹	13,25 ¹
Klasse ZEH	11,9271 ¹	12,65 ¹	13,65 ¹
Klasse ZEP	12,8290 ¹	13,39 ¹	13,25 ¹
Klasse ZF	13,6324 ²	14,22 ²	14,29 ²
Klasse ZFP	12,7639 ²	13,71 ²	14,29 ²
Klasse ZU	13,1825	13,77	14,39
Klasse ZUP	12,5344	13,48	14,62

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

⁴Die Klasse lautet auf AUD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

^fSiehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	648.337.839
Bankguthaben	2	17.009.566
Forderungen aus Zeichnungen		31.508
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		483.427
Sonstige Vermögenswerte		71
Summe Aktiva		665.862.411
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(90.437)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(732.127)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(2.127.794)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(268.531)
Andere Verbindlichkeiten		(127.416)
Summe Passiva		(3.346.305)
Nettovermögen insgesamt		662.516.106

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	7,843
Klasse AEH	16.300,933
Klasse AU	122.199,909
Klasse AUP	9.752,554
Klasse DU	3.760,142
Klasse IU	5.120.746,021
Klasse XS	100,000
Klasse XSH	26.917.011,761
Klasse ZEH	1.193.787,065
Klasse ZFH	200,000
Klasse ZGH	200,000
Klasse ZU	7.871.171,879

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ⁶	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEC	13,1455 ¹	12,75 ¹	12,75 ¹
Klasse AEH	20,9986 ¹	20,19 ¹	19,80 ¹
Klasse AU	37,3190	35,32	33,62
Klasse AUP	14,0354	13,41	13,03
Klasse DU	18,7656	17,81	17,04
Klasse IU	52,9859	49,95	47,16
Klasse XS	12,9188 ²	11,87 ²	10,75 ²
Klasse XSH	12,9852 ²	12,24 ²	11,57 ²
Klasse ZEH	13,4695 ¹	12,89 ¹	12,56 ¹
Klasse ZFH	13,2280 ³	12,68 ³	12,39 ³
Klasse ZGH	13,9813 ⁴	13,32 ⁴	12,83 ⁴
Klasse ZU	14,7073	13,87	13,10

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁶Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		607.510.212
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.467.686
Zinsen aus Bankguthaben	2	157.057
Andere Erträge		1.178
Erträge insgesamt		4.625.921
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.603.567)
Bankspesen		(690)
Sonstige Betriebskosten	5	(768.701)
Aufwendungen insgesamt		(2.372.958)
Nettoertrag aus Anlagen		2.252.963
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		12.439.007
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(5.169.847)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		36.196
Realisierter Nettogewinn		7.305.356
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		25.476.262
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(2.131.436)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		23.344.826
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		32.903.145
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		113.839.111
Anteilrücknahmen		(91.735.094)
Dividendenausüttung	7	(1.268)
Kapitalbewegungen insgesamt		22.102.749
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		662.516.106

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	662.516.106	607.510.212	999.062.916

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	6.193.054
Bankguthaben	2	50.859
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		7.185
Summe Aktiva		6.251.098
Passiva		
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(222)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(2.469)
Andere Verbindlichkeiten		(718)
Summe Passiva		(3.409)
Nettovermögen insgesamt		6.247.689

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	1.625,544
Klasse AEH	175,100
Klasse AU	99.600,000
Klasse AUP	99.600,000
Klasse DE	4.321,678
Klasse DEH	175,100
Klasse DU	100.615,963
Klasse IE	175,100
Klasse IEC	175,100
Klasse IEH	175,100
Klasse IFH	161,100
Klasse IG	100,000
Klasse IU	99.600,000
Klasse ZEH	175,100
Klasse ZFH	161,100
Klasse ZU	99.600,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AE	12,6874 ¹	12,11 ¹	10,25 ¹
Klasse AEH	11,6283 ¹	11,61 ¹	11,10 ¹
Klasse AU	12,4065	12,19	11,31
Klasse AUP	11,8522	11,77	11,15
Klasse DE	12,6238 ¹	12,06 ¹	10,24 ¹
Klasse DEH	11,5735 ¹	11,57 ¹	11,08 ¹
Klasse DU	12,3498	12,15	11,29
Klasse IE	12,7729 ¹	12,17 ¹	10,28 ¹
Klasse IEC	11,1829 ¹	11,26 ¹	10,97 ¹
Klasse IEH	11,7121 ¹	11,67 ¹	11,13 ¹
Klasse IFH	11,6417 ²	11,61 ²	11,10 ²
Klasse IG [#]	10,6481 ³	–	–
Klasse IU	12,5065	12,27	11,34
Klasse ZEH	11,6924 ¹	11,66 ¹	11,12 ¹
Klasse ZFH	11,6063 ²	11,58 ²	11,09 ²
Klasse ZU	12,4778	12,25	11,33

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.[#]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		6.080.103
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	45.532
Zinsen aus Bankguthaben	2	14
Erträge insgesamt		45.546
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(15.047)
Sonstige Betriebskosten	5	(4.386)
Aufwendungen insgesamt		(19.433)
Nettoertrag aus Anlagen		26.113
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		245.984
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(450)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		26
Realisierter Nettogewinn		245.560
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(162.796)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(136)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(162.932)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		108.741
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		72.929
Anteilrücknahmen		(2.210)
Dividendenausschüttung	7	(11.874)
Kapitalbewegungen insgesamt		58.845
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		6.247.689

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	6.247.689	6.080.103	5.642.560

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	202.648.197
Bankguthaben	2	778.544
Forderungen aus Zeichnungen		23.353
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		135.885
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	43.938
Sonstige Vermögenswerte		543.609
Summe Aktiva		204.173.526
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(236.256)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(160.624)
Andere Verbindlichkeiten		(25.138)
Summe Passiva		(422.018)
Nettovermögen insgesamt		203.751.508

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	163.782,883
Klasse ASH	303.715,860
Klasse AUH	39.182,058
Klasse DE	172.421,561
Klasse IE	97.449,062
Klasse W	42.378,438
Klasse XE	518.601,999
Klasse ZUH	200,000
Klasse 1E	3.654.136,074
Klasse 1EP	100,000
Klasse 1G	231.880,703
Klasse 1GP	100,000
Klasse 2E	8.157.529,177
Klasse 2G	556.244,084
Klasse 2U	100,000
Klasse 3E	587.202,673
Klasse 3G	374.343,692
Klasse 3GP	100,000
Klasse 4E	836.534,914
Klasse 4G	100,000
Klasse 8E	455.690,504
Klasse 8G	30.305,198
Klasse 8U	100,000
Klasse 9E	100,000
Klasse 9G	100,000
Klasse 9GP	100,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		196.368.240
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	3.665.537
Zinsen aus Bankguthaben	2	197
Erträge insgesamt		3.665.734
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.022.276)
Bankspesen		(3.935)
Sonstige Betriebskosten	5	(159.814)
Aufwendungen insgesamt		(1.186.025)
Nettoertrag aus Anlagen		2.479.709
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		33.444
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		112.423
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(30.172)
Realisierter Nettogewinn		115.695
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		10.695.123
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(8.449)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		10.686.674
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		13.282.078
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		18.133.212
Anteilrücknahmen		(24.032.022)
Kapitalbewegungen insgesamt		(5.898.810)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		203.751.508

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
EUR	203.751.508	196.368.240	64.667.911

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AE	63,3583	59,63	59,61
Klasse ASH	17,9107 ¹	16,69 ¹	16,39 ¹
Klasse AUH	21,2227 ²	19,69 ²	19,17 ²
Klasse BUH	–	–	9,43 ²
Klasse DE	22,9792	21,67	21,74
Klasse IE	44,1005	41,33	40,97
Klasse W	53,2230	50,08	50,04
Klasse XE	50,5823	47,21	46,43
Klasse ZUH	13,6799 ²	12,65 ²	12,23 ²
Klasse 1E	10,0776	9,48	–
Klasse 1EP	10,0669	9,47	–
Klasse 1G	9,9085 ³	9,08 ³	–
Klasse 1GP	9,9024 ³	9,08 ³	–
Klasse 2E	10,1505	9,52	–
Klasse 2G	9,9795 ³	9,12 ³	–
Klasse 2U	9,4721 ²	9,14 ²	–
Klasse 3E	10,1648	9,53	–
Klasse 3G	9,9939 ³	9,12 ³	–
Klasse 3GP	9,9896 ³	9,12 ³	–
Klasse 4E	10,2611	9,57	–
Klasse 4G	10,0942 ³	9,17 ³	–
Klasse 8E	10,1419	9,51	–
Klasse 8G	9,9757 ³	9,11 ³	–
Klasse 8U	9,4586 ²	9,14 ²	–
Klasse 9E	10,1808	9,53	–
Klasse 9G	10,0145 ³	9,13 ³	–
Klasse 9GP	10,0145 ³	9,13 ³	–

¹Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

[#]Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	55.980.365
Bankguthaben	2	175
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.294.915
Forderungen aus Zeichnungen		24.802
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		77.689
Sonstige Vermögenswerte		261.439
Summe Aktiva		57.639.385
Passiva		
Überziehungskredite		(1.093.926)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(39.005)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(56.286)
Andere Verbindlichkeiten		(8.039)
Summe Passiva		(1.197.256)
Nettovermögen insgesamt		56.442.129

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	100,000
Klasse AEP	100,000
Klasse AUP	100,000
Klasse DE	100,000
Klasse DEP	100,000
Klasse IE	100,000
Klasse IEP	3.375,528
Klasse ZE	35.037,221
Klasse ZEP	100,000
Klasse 1E	4.807.614,112
Klasse 1EP	13.414.561,808
Klasse 1G	195.066,385
Klasse 1GP	11.156.090,816
Klasse 2E	1.013.929,004
Klasse 2EP	4.702,261
Klasse 2G	100,000
Klasse 2GP	100,000
Klasse 3EP	71.668,476
Klasse 3G	139.778,239
Klasse 3GP	1.271.102,178
Klasse 4GP	3.117.488,519
Klasse 8E	345.499,001
Klasse 8EP	3.137.588,394
Klasse 8G	48.848,513
Klasse 8GP	433.897,645
Klasse 9EP	100,000
Klasse 9G	100,000
Klasse 9GP	100,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		59.715.336
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.490.042
Zinsen aus Bankguthaben	2	46
Erträge insgesamt		1.490.088
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(354.618)
Bankspesen		(1.520)
Sonstige Betriebskosten	5	(48.737)
Aufwendungen insgesamt		(404.875)
Nettoertrag aus Anlagen		1.085.213
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		646.066
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		40
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(14.482)
Realisierter Nettogewinn		631.624
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.081.146
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		1.081.146
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		2.797.983
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		1.088.292
Anteilrücknahmen		(6.005.011)
Dividendenausschüttung	7	(1.154.471)
Kapitalbewegungen insgesamt		(6.071.190)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		56.442.129

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019
EUR	56.442.129	59.715.336

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019
Klasse AE	10,6672	10,19
Klasse AEP	10,2435	10,09
Klasse AUP	10,1623 ¹	10,31 ¹
Klasse DE	10,6294	10,17
Klasse DEP	10,2076	10,07
Klasse IE	10,7506	10,23
Klasse IEP	10,3230	10,13
Klasse ZE	10,7459	10,23
Klasse ZEP	10,3196	10,13
Klasse 1E	1,7365	1,66
Klasse 1EP	1,0145	1,00
Klasse 1G	1,5361 ²	1,43 ²
Klasse 1GP	0,8980 ²	0,86 ²
Klasse 2E	10,7406	10,22
Klasse 2EP	10,3249	10,13
Klasse 2G	10,8010 ²	10,01 ²
Klasse 2GP	10,3742 ²	9,91 ²
Klasse 3EP	1,6269	1,60
Klasse 3G	1,4633 ²	1,36 ²
Klasse 3GP	1,4373 ²	1,38 ²
Klasse 4GP	1,2494 ²	1,19 ²
Klasse 8E	1,8929	1,80
Klasse 8EP	1,0910	1,07
Klasse 8G	1,6759 ²	1,55 ²
Klasse 8GP	0,9648 ²	0,92 ²
Klasse 9EP	10,3458	10,14
Klasse 9G	10,8165 ²	10,02 ²
Klasse 9GP	10,3909 ²	9,93 ²

¹Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

[#]Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	537.137.881
Bankguthaben	2	218.021
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		6.439.213
Forderungen aus Zeichnungen		432.175
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		245.902
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	132.332
Sonstige Vermögenswerte		390.016
Summe Aktiva		544.995.540
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(536.296)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(587.918)
Andere Verbindlichkeiten		(141.699)
Summe Passiva		(1.265.913)
Nettovermögen insgesamt		543.729.627

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	6.519.228,751
Klasse ASH	827.135,332
Klasse AUH	100,000
Klasse DE	1.344.857,561
Klasse DUH	100,000
Klasse IE	3.546.144,446
Klasse W	9.506,605
Klasse ZE	3.857.402,233
Klasse ZFH	100,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ¹	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AE	40,2656	37,96	37,79
Klasse ASH	27,1332 ¹	25,32 ¹	24,75 ¹
Klasse AUH	10,3296 ²	9,61 ²	–
Klasse DE	36,7991	34,85	35,01
Klasse DUH	10,2118 ²	9,54 ²	–
Klasse IE	50,0264	46,99	46,42
Klasse W	67,4052	63,57	63,31
Klasse ZE	10,0610	9,45	–
Klasse ZFH	9,7363 ³	9,16 ³	–

¹Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.²Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

*Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		561.444.617
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	7.936.009
Zinsen aus Bankguthaben	2	192
Andere Erträge		100
Erträge insgesamt		7.936.301
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(3.725.153)
Bankspesen		(11.167)
Sonstige Betriebskosten	5	(897.876)
Aufwendungen insgesamt		(4.634.196)
Nettoertrag aus Anlagen		3.302.105
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		36.517.566
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		302.890
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		36.435
Realisierter Nettogewinn		36.856.891
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(6.668.850)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(17.379)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(6.686.229)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		33.472.767
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		76.761.953
Anteilrücknahmen		(127.949.710)
Kapitalbewegungen insgesamt		(51.187.757)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		543.729.627

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
EUR	543.729.627	561.444.617	526.856.473

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.156.736.469
Bankguthaben	2	1.102.031
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.723.845
Forderungen aus Zeichnungen		1.376.618
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.209.020
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	630.810
Sonstige Vermögenswerte		2.383.736
Summe Aktiva		1.165.162.529
Passiva		
Überziehungskredite		(414.918)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.377.089)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(949.927)
Andere Verbindlichkeiten		(146.095)
Summe Passiva		(3.888.029)
Nettovermögen insgesamt		1.161.274.500

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IE	4.275,248
Klasse ZE	349.076,415
Klasse 1E	36.701.691,556
Klasse 1EP	424.898,832
Klasse 1FH	206.470,124
Klasse 1G	948.261,489
Klasse 1UH	3.035.579,812
Klasse 2E	13.562.974,913
Klasse 2G	100,000
Klasse 3E	22.111.481,605
Klasse 3EP	1.423.259,157
Klasse 3FH	135.331,170
Klasse 3G	2.103.419,815
Klasse 3GP	19.641,729
Klasse 3UH	884.093,268
Klasse 4E	6.999.894,927
Klasse 4G	2.893.984,671
Klasse 8E	11.193.326,037
Klasse 8G	537.101,748
Klasse 9E	12.463.143,035
Klasse 9EP	100,000
Klasse 9FH	3.889,660
Klasse 9G	937.321,566
Klasse 9GP	100,000
Klasse 9UH	127.960,456

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		1.381.828.793
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	18.038.756
Zinsen aus Bankguthaben	2	553
Erträge insgesamt		18.039.309
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(6.228.115)
Bankspesen		(10.351)
Sonstige Betriebskosten	5	(960.500)
Aufwendungen insgesamt		(7.198.966)
Nettoertrag aus Anlagen		10.840.343
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		15.511.525
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.697.094
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(34.910)
Realisierter Nettogewinn		17.173.709
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		45.210.852
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		109.881
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		45.320.733
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		73.334.785
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		98.539.096
Anteilrücknahmen		(392.428.174)
Kapitalbewegungen insgesamt		(293.889.078)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		1.161.274.500

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019
EUR	1.161.274.500	1.381.828.793

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019
Klasse IE [#]	10,1018	–
Klasse ZE	9,8428	9,32
Klasse 1E	9,7795	9,29
Klasse 1EP	9,7424	9,26
Klasse 1FH	9,7446 ¹	9,27 ¹
Klasse 1G	9,6131 ²	8,90 ²
Klasse 1UH	10,0760 ³	9,44 ³
Klasse 2E	9,8467	9,33
Klasse 2G	9,6813 ²	8,93 ²
Klasse 3E	9,8653	9,34
Klasse 3EP	9,8272	9,30
Klasse 3FH	9,8320 ¹	9,31 ¹
Klasse 3G	9,6965 ²	8,94 ²
Klasse 3GP	9,6594 ²	8,91 ²
Klasse 3UH	10,1612 ³	9,48 ³
Klasse 4E	9,9557	9,38
Klasse 4G	10,9521 ²	10,05 ²
Klasse 8E	9,8444	9,32
Klasse 8G	9,6769 ²	8,93 ²
Klasse 9E	9,8708	9,34
Klasse 9EP	9,8252	9,29
Klasse 9FH	9,8364 ¹	9,32 ¹
Klasse 9G	9,7041 ²	8,94 ²
Klasse 9GP	9,6631 ²	8,90 ²
Klasse 9UH	10,1720 ³	9,49 ³

¹Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

³Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

[#]Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - European Select

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.418.899.604
Bankguthaben	2	1.776.285
Termineinlagen	2, 19	10.499.115
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		8.422.034
Forderungen aus Zeichnungen		671.917
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		39.842
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	287.410
Sonstige Vermögenswerte		3.062.482
Summe Aktiva		1.443.658.689
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(4.591.398)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(768.726)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(1.522.452)
Andere Verbindlichkeiten		(159.240)
Summe Passiva		(7.041.816)
Nettovermögen insgesamt		1.436.616.873

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	58.532,559
Klasse AGH	375,528
Klasse AUH	25.036,224
Klasse DUH	100,000
Klasse IE	1.023.194,682
Klasse ZG	6.920,125
Klasse ZGH	388.731,845
Klasse 1E	81.756.165,295
Klasse 1EP	462.173,201
Klasse 1SH	2.435.438,004
Klasse 1U	54.326,613
Klasse 1UH	300.610,517
Klasse 2E	11.740.824,990
Klasse 2EP	100,000
Klasse 3E	6.309.686,610
Klasse 3U	549.188,760
Klasse 8E	5.413.392,175
Klasse 8EP	140.549,551
Klasse 9E	12.844.217,081
Klasse 9U	100,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		1.440.832.024
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	20.278.136
Zinsen aus Bankguthaben	2	7.435
Erträge insgesamt		20.285.571
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(9.452.669)
Bankspesen		(24.647)
Sonstige Betriebskosten	5	(1.002.648)
Aufwendungen insgesamt		(10.479.964)
Nettoertrag aus Anlagen		9.805.607
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		39.942.884
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		101.130
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		139.942
Realisierter Nettogewinn		40.183.956
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		71.467.776
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		141.544
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		71.609.320
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		121.598.883
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		93.438.731
Anteilrücknahmen		(219.252.765)
Kapitalbewegungen insgesamt		(125.814.034)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		1.436.616.873

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
EUR	1.436.616.873	1.440.832.024	32.938.607

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Select

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AE	24,0568	22,18	21,54
Klasse AGH	25,5959 ¹	23,48 ¹	22,60 ¹
Klasse AUH	26,4269 ²	24,02 ²	22,72 ²
Klasse DUH	11,1857 ²	10,20 ²	–
Klasse IE	34,2256	31,41	30,26
Klasse ZG	11,9778 ¹	10,71 ¹	10,51 ¹
Klasse ZGH	25,9501 ¹	23,71 ¹	22,67 ¹
Klasse 1E	11,4377	10,53	–
Klasse 1EP	11,4016	10,50	–
Klasse 1SH	11,6557 ³	10,63 ³	–
Klasse 1U	10,7681 ²	10,21 ²	–
Klasse 1UH	11,7639 ²	10,68 ²	–
Klasse 2E	11,5017	10,56	–
Klasse 2EP	11,4615	10,52	–
Klasse 3E	11,5218	10,57	–
Klasse 3U	10,8456 ²	10,25 ²	–
Klasse 8E	11,4978	10,56	–
Klasse 8EP	11,4722	10,54	–
Klasse 9E	11,5254	10,57	–
Klasse 9U	10,8511 ²	10,25 ²	–

¹Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

³Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

[#]Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.790.446.869
Bankguthaben	2	171.297
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		2.858.031
Forderungen aus Zeichnungen		668.341
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		829.377
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	13.716
Sonstige Vermögenswerte		2.906.473
Summe Aktiva		1.797.894.104
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.778.989)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(1.897.870)
Andere Verbindlichkeiten		(282.358)
Summe Passiva		(3.959.217)
Nettovermögen insgesamt		1.793.934.887

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IE	100,000
Klasse ZE	392.308,582
Klasse 1E	108.607.442,607
Klasse 1EP	515.766,642
Klasse 1FH	43.999,998
Klasse 2E	11.901.077,451
Klasse 3E	13.311.834,446
Klasse 3EP	2.404.942,565
Klasse 3FH	174.748,981
Klasse 8E	9.285.155,912
Klasse 9E	15.694.767,222
Klasse 9EP	175.197,000
Klasse 9FH	145,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ^f	31. März 2019
Klasse IE ^f	9,9283	–
Klasse ZE	11,0804	10,64
Klasse 1E	11,0174	10,61
Klasse 1EP	11,0029	10,60
Klasse 1FH	10,9937 ¹	10,60 ¹
Klasse 2E	11,0864	10,64
Klasse 3E	11,0745	10,62
Klasse 3EP	11,0766	10,62
Klasse 3FH	11,0781 ¹	10,64 ¹
Klasse 8E	11,0843	10,64
Klasse 9E	11,1028	10,65
Klasse 9EP	11,0824	10,63
Klasse 9FH	11,0749 ¹	10,64 ¹

^fDie Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.¹Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		1.875.264.870
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	24.714.433
Zinsen aus Bankguthaben	2	2
Erträge insgesamt		24.714.435
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(12.025.143)
Bankspesen		(17.604)
Sonstige Betriebskosten	5	(1.791.541)
Aufwendungen insgesamt		(13.834.288)
Nettoertrag aus Anlagen		10.880.147
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		30.916.691
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		78.327
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(5.331)
Realisierter Nettogewinn		30.989.687
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		31.920.950
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(17.932)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		31.903.018
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		73.772.852
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		123.238.556
Anteilrücknahmen		(278.341.391)
Kapitalbewegungen insgesamt		(155.102.835)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		1.793.934.887

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019
EUR	1.793.934.887	1.875.264.870

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	57.569.087
Bankguthaben	2	969.751
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		2.720
Forderungen aus Zeichnungen		326
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		276.443
Summe Aktiva		58.818.327
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(451.795)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(75)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(13.769)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(17.009)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(44.219)
Andere Verbindlichkeiten		(9.086)
Summe Passiva		(535.953)
Nettovermögen insgesamt		58.282.374

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	8.801,763
Klasse AU	100.359,164
Klasse AUP	668,517
Klasse DEH	14.362,204
Klasse DU	20.579,144
Klasse DUP	357,406
Klasse IEP	15.100,000
Klasse W	27.803,117
Klasse XU	3.428.082,516
Klasse XUP	823.502,728
Klasse ZG	100,000
Klasse ZGH	6.891,198
Klasse ZGP	100,000
Klasse ZUP	140.941,795

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEH	34,4986 ¹	35,16 ¹	38,19 ¹
Klasse AU	83,7577	84,02	88,46
Klasse AUP	10,8011	11,18	12,29
Klasse DEH	24,8120 ¹	25,38 ¹	27,78 ¹
Klasse DU	41,2362	41,52	44,05
Klasse DUP	10,6735	11,09	12,18
Klasse IEP	11,1660 ¹	11,17 ¹	10,99 ¹
Klasse W	62,2124	62,47	65,90
Klasse XU [#]	10,3833	–	–
Klasse XUP	10,7975	11,08	–
Klasse ZG	10,6642 ²	10,08 ²	–
Klasse ZGH	19,2395 ²	19,44 ²	20,74 ²
Klasse ZGP	10,2233 ²	9,97 ²	–
Klasse ZUP	12,2835	12,66	13,69

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.[#]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		60.801.683
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.678.440
Zinsen aus Bankguthaben	2	13.252
Erträge insgesamt		1.691.692
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(240.500)
Sonstige Betriebskosten	5	(71.548)
Aufwendungen insgesamt		(312.048)
Nettoertrag aus Anlagen		1.379.644
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(238.222)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(43.998)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(8.324)
Realisierter Netto(verlust) aus Kapitalertragsteuer		(37)
Realisierter Netto(verlust)		(290.581)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(1.194.655)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(2.081)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Kapitalertragsteuer		27.434
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(1.169.302)
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(80.239)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		44.537.317
Anteilrücknahmen		(46.639.477)
Dividendenausschüttung	7	(336.910)
Kapitalbewegungen insgesamt		(2.439.070)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		58.282.374

GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
	58.282.374	60.801.683	52.527.052

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	256.471.241
Bankguthaben	2	4.869.590
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.744.469
Forderungen aus Zeichnungen		750.728
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		189.636
Sonstige Vermögenswerte		278
Summe Aktiva		264.025.942
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(188.713)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(236.368)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(524.752)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(330.297)
Andere Verbindlichkeiten		(64.014)
Summe Passiva		(1.344.144)
Nettovermögen insgesamt		262.681.798

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	493.021,441
Klasse AS	86.569,829
Klasse AU	3.113.189,724
Klasse AUP	3.686,000
Klasse BU	61.975,919
Klasse DEH	9.920,199
Klasse DU	428.720,558
Klasse IEH	771.583,488
Klasse IG	100,000
Klasse ZEH	35.803,212
Klasse ZFH	17.600,000
Klasse ZG	100,000
Klasse ZU	2.056.212,178

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEH	37,7599 ¹	35,64 ¹	34,92 ¹
Klasse AS	12,9262 ²	11,77 ²	10,82 ²
Klasse AU	48,4838	45,07	42,79
Klasse AUP	10,8614	10,10	–
Klasse BU	61,8166	57,58	54,88
Klasse DEH	10,9240 ¹	10,33 ¹	–
Klasse DU	71,7239	66,79	63,63
Klasse IEH	12,5571 ¹	11,80 ¹	11,45 ¹
Klasse IG	11,9678 ³	10,47 ³	–
Klasse ZEH	10,4351 ¹	9,81 ¹	–
Klasse ZFH	12,2316 ⁴	11,50 ⁴	11,21 ⁴
Klasse ZG	11,9595 ³	10,47 ³	–
Klasse ZU	21,7439	20,13	18,96

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

*Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		240.513.696
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	852.174
Zinsen aus Bankguthaben	2	59.990
Erträge insgesamt		912.164
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.933.979)
Bankspesen		(1.893)
Sonstige Betriebskosten	5	(370.926)
Aufwendungen insgesamt		(2.306.798)
Netto(verlust) aus Anlagen		(1.394.634)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		12.868.895
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.267.694)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(46.971)
Realisierter Nettogewinn		11.554.230
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		6.616.992
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(206.161)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		6.410.831
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		16.570.427
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		53.434.582
Anteilrücknahmen		(47.836.907)
Kapitalbewegungen insgesamt		5.597.675
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		262.681.798

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	262.681.798	240.513.696	204.409.810

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 GBP
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	264.071.288
Bankguthaben	2	80
Forderungen aus Zeichnungen		826.280
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		587.866
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	89.376
Sonstige Vermögenswerte		80
Summe Aktiva		265.574.970
Passiva		
Überziehungskredite		(499.264)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(214.685)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(165.485)
Andere Verbindlichkeiten		(37.364)
Summe Passiva		(916.798)
Nettovermögen insgesamt		264.658.172

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	64.500,584
Klasse AFH	100,000
Klasse AG	212.243,313
Klasse AGP	481.114,528
Klasse DEH	100,000
Klasse DG	100,000
Klasse IEH	37.176,816
Klasse IG	1.161.021,689
Klasse IGP	1.928.633,425
Klasse ZEH	62.905,176
Klasse ZFH	2.850,000
Klasse ZG	624.950,087
Klasse ZGP	1.155.205,087
Klasse ZUH	4.081,367
Klasse 3EH	1.296.547,669
Klasse 3FH	770,000
Klasse 3UH	975.869,546
Klasse 9EH	1.578.388,550
Klasse 9EP	1.986.463,979
Klasse 9FH	722.713,165
Klasse 9G	4.630.526,073
Klasse 9UH	1.637.228,506

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 GBP
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		213.779.407
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.924.418
Zinsen aus Bankguthaben	2	7.069
Erträge insgesamt		4.931.487
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(903.035)
Bankspesen		(1.207)
Sonstige Betriebskosten	5	(220.929)
Aufwendungen insgesamt		(1.125.171)
Nettoertrag aus Anlagen		3.806.316
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.210.012
Realisierter Nettogewinn aus		
Devisenterminkontrakten		2.398.475
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(14.537)
Realisierter Nettogewinn		3.593.950
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		5.245.311
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(579.766)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		4.665.545
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		12.065.811
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		82.867.834
Anteilrücknahmen		(41.856.609)
Dividendenausschüttung	7	(2.198.271)
Kapitalbewegungen insgesamt		38.812.954
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		264.658.172

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
GBP	264.658.172	213.779.407	145.324.124

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEH	20,6071 ¹	19,80 ¹	19,65 ¹
Klasse AFH	10,0566 ²	9,68 ²	9,65 ²
Klasse AG	28,5584	27,27	26,70
Klasse AGP	22,5184	21,99	22,39
Klasse DEH	9,9058 ¹	9,56 ¹	9,57 ¹
Klasse DG	10,1757	9,75	9,63
Klasse IEH	30,4788 ¹	29,15 ¹	28,64 ¹
Klasse IG	40,7718	38,74	37,57
Klasse IGP	32,4856	31,51	31,71
Klasse ZEH	12,5448 ¹	12,01 ¹	11,83 ¹
Klasse ZFH	12,1669 ²	11,66 ²	11,53 ²
Klasse ZG	27,1650	25,84	25,11
Klasse ZGP	11,7021	11,37	11,46
Klasse ZUH	13,3851 ³	12,63 ³	12,09 ³
Klasse 3EH	1,7805 ¹	1,70 ¹	–
Klasse 3EP [#]	–	1,63 ¹	–
Klasse 3FH	1,8733 ²	1,79 ²	–
Klasse 3UH	2,1275 ³	2,01 ³	–
Klasse 9EH	10,6701 ¹	10,20 ¹	–
Klasse 9EP	10,2771 ¹	10,25 ¹	–
Klasse 9FH	10,6440 ²	10,19 ²	–
Klasse 9G [#]	10,1124	–	–
Klasse 9UH	10,9525 ³	10,32 ³	–

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

³Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

[#]Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 GBP
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	176.001.365
Bankguthaben	2	859.973
Forderungen aus Zeichnungen		133.751
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		504.420
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	15.808
Summe Aktiva		177.515.317
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(145.600)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(108.790)
Andere Verbindlichkeiten		(29.888)
Summe Passiva		(284.278)
Nettovermögen insgesamt		177.231.039

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	2.870.183,079
Klasse AEC	704,895
Klasse AEH	114,600
Klasse AG	240.399,700
Klasse ASC	175,600
Klasse AUC	128,700
Klasse DE	2.683,293
Klasse DEC	114,600
Klasse DEH	114,600
Klasse DG	9.198,589
Klasse DGP	100,000
Klasse IE	837.206,515
Klasse IEH	225.627,976
Klasse IG	1.485.881,220
Klasse IGP	1.116.316,838
Klasse IU	133.733,416
Klasse IUH	100,000
Klasse LG	1.223.755,183
Klasse LGP	6.789.844,865
Klasse ZE	22.184,822
Klasse ZEH	888,103
Klasse ZFH	12.494,172
Klasse ZG	32.607,700
Klasse ZGP	4.812,000
Klasse ZUH	14.532,155
Klasse 1EH	66.196,311
Klasse 1FH	39.381,059
Klasse 1UH	68.246,735
Klasse 3EH	126.644,394
Klasse 3FH	26.371,201
Klasse 3UH	275.662,070
Klasse 9EH	3.580,888
Klasse 9FH	100,000
Klasse 9G	1.751.079,452
Klasse 9UH	100,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 GBP
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		139.659.238
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	3.826.195
Zinsen aus Bankguthaben	2	12.091
Erträge insgesamt		3.838.286
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(604.958)
Bankspesen		(130)
Sonstige Betriebskosten	5	(172.349)
Aufwendungen insgesamt		(777.437)
Nettoertrag aus Anlagen		3.060.849
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		106.523
Realisierter Nettogewinn aus		
Devisenterminkontrakten		368.642
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(25.971)
Realisierter Nettogewinn		449.194
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		4.182.582
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(89.174)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		4.093.408
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		7.603.451
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		58.924.820
Anteilrücknahmen		(27.210.162)
Dividendenausschüttung	7	(1.746.308)
Kapitalbewegungen insgesamt		29.968.350
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		177.231.039

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
GBP	177.231.039	139.659.238	78.477.578

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AE	10,8947 ¹	10,70 ¹	10,03 ¹
Klasse AEC	9,5277 ¹	9,40 ¹	9,61 ¹
Klasse AEH	10,5651 ¹	10,18 ¹	9,82 ¹
Klasse AG	10,9594	10,49	9,99
Klasse ASC	9,7746 ²	9,54 ²	9,91 ²
Klasse AUC	10,1112 ³	9,83 ³	9,94 ³
Klasse DE	10,6548 ¹	10,51 ¹	9,91 ¹
Klasse DEC	9,3022 ¹	9,22 ¹	9,50 ¹
Klasse DEH	10,3241 ¹	9,98 ¹	9,71 ¹
Klasse DG	10,7213	10,30	9,89
Klasse DGP	10,0436	9,88	9,89
Klasse IE	11,2033 ¹	10,95 ¹	10,16 ¹
Klasse IEH	10,8672 ¹	10,42 ¹	9,96 ¹
Klasse IG	11,2928	10,76	10,15
Klasse IGP	10,1706	9,92	9,74
Klasse IU	10,9036 ³	10,98 ³	11,16 ³
Klasse IUH	11,1385 ³	10,52 ³	9,78 ³
Klasse LG	11,3382	10,79	10,17
Klasse LGP	10,1894	9,92	9,73
Klasse ZE	11,1431 ¹	10,91 ¹	10,14 ¹
Klasse ZEH	10,8075 ¹	10,37 ¹	9,93 ¹
Klasse ZFH	10,6846 ⁴	10,27 ⁴	9,87 ⁴
Klasse ZG	11,2161	10,69	10,11
Klasse ZGP	10,6244	10,35	10,11
Klasse ZUH	11,6004 ³	10,97 ³	10,23 ³
Klasse 1EH	10,4296 ¹	10,04 ¹	–
Klasse 1FH	10,4047 ⁴	10,03 ⁴	–
Klasse 1UH	10,7247 ³	10,18 ³	–
Klasse 3EH	10,5059 ¹	10,07 ¹	–
Klasse 3FH	10,4784 ⁴	10,06 ⁴	–
Klasse 3UH	10,8025 ³	10,21 ³	–
Klasse 9EH	10,5040 ¹	10,08 ¹	–
Klasse 9FH	10,4748 ⁴	10,06 ⁴	–
Klasse 9G [#]	10,0914	–	–
Klasse 9UH	10,8021 ³	10,21 ³	–

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

³Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

⁴Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

[#]Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	7.505.345
Bankguthaben	2	217.763
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		29.453
Summe Aktiva		7.752.561
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(46.582)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(18.347)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(7.832)
Andere Verbindlichkeiten		(2.193)
Summe Passiva		(74.954)
Nettovermögen insgesamt		7.677.607

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IU	1.927.928,431
Klasse ZU	49.407,602

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019*	31. März 2019	31. März 2018
Klasse IU	3,8828	3,87	4,55
Klasse ZU	3,8833	3,87	4,55

*Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		7.921.925
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	268.843
Zinsen aus Bankguthaben	2	1.557
Erträge insgesamt		270.400
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(49.296)
Bankspesen		(49)
Sonstige Betriebskosten	5	(13.803)
Aufwendungen insgesamt		(63.148)
Nettoertrag aus Anlagen		207.252
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(139.695)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(171)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(9.769)
Realisierter Netto(verlust) aus Kapitalertragsteuer		(39)
Realisierter Netto(verlust)		(149.674)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(75.045)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Kapitalertragssteuer		39.350
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(35.695)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		21.883
Entwicklung des Fondsvermögens		
Anteilrücknahmen		(266.201)
Kapitalbewegungen insgesamt		(266.201)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		7.677.607

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	7.677.607	7.921.925	9.735.411

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	102.809.409
Optionen (gekaufte Optionen) zum Marktwert	2, 12	964.500
Bankguthaben	2	5.690.256
Termineinlagen	2, 19	77.699.589
Forderungen aus Zeichnungen		68.995
Zinsforderungen aus Swaps	2	127.796
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		31.335
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	80.450
Summe Aktiva		187.472.330
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(81.723)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(145.576)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(2.026.874)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(447.725)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(18.619)
Verbindlichkeiten aus Performance-Gebühren	8	(9)
Andere Verbindlichkeiten		(81.875)
Summe Passiva		(2.802.401)
Nettovermögen insgesamt		184.669.929

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	69.815,533
Klasse AFH	5.890,000
Klasse AGH	2.766,812
Klasse AU	315.370,276
Klasse DEH	20.003,907
Klasse DU	121.790,684
Klasse IEH	93.442,777
Klasse IGH	92.448,862
Klasse IU	229.461,632
Klasse XGH	13.186.584,007
Klasse ZE	100,000
Klasse ZEH	100,000
Klasse ZGH	12.604,066
Klasse ZU	100,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ¹	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEH	15,4972 ¹	15,94 ¹	16,26 ¹
Klasse AFH	14,1691 ²	14,60 ²	14,95 ²
Klasse AGH	16,3852 ³	16,75 ³	16,89 ³
Klasse AU	17,0437	17,25	17,10
Klasse DEH	12,0985 ¹	12,47 ¹	12,79 ¹
Klasse DU	13,2089	13,40	13,35
Klasse IEH	22,1708 ¹	22,70 ¹	22,96 ¹
Klasse IGH	23,2719 ³	23,69 ³	23,69 ³
Klasse IU	24,1405	24,33	23,97
Klasse XGH	10,1787 ³	10,32 ³	10,23 ³
Klasse ZE	10,6113 ¹	10,40 ¹	–
Klasse ZEH	9,6885 ¹	9,92 ¹	–
Klasse ZGH	15,9628 ³	16,26 ³	16,27 ³
Klasse ZU	10,0720	10,16	–

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		197.738.046
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	398.375
Zinsen aus Bankguthaben	2	930.546
Zinsen aus Swaps		433.815
Zinsen aus Futures		14.395
Erträge insgesamt		1.777.131
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(493.318)
Performance-Gebühren	8	(2)
Bankspesen		(4.761)
Dividendenaufwand aus Swaps		(244.092)
Zinsaufwand aus Swaps		(173.888)
Sonstige Betriebskosten	5	(193.020)
Aufwendungen insgesamt		(1.109.081)
Nettoertrag aus Anlagen		668.050
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.914.932
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(1.713.478)
Realisierter Netto(verlust) aus Optionen		(1.068.126)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(13.183.540)
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(4.002.412)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(30.214)
Realisierter Netto(verlust)		(18.082.838)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(652.165)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		181.606
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Optionen		722.881
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		1.590.413
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		2.813.625
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		4.656.360
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(12.758.428)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		115.437.744
Anteilrücknahmen		(115.747.433)
Kapitalbewegungen insgesamt		(309.689)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		184.669.929

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	184.669.929	197.738.046	222.720.376

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.595.695.703
Bankguthaben	2	53.884.829
Termineinlagen	2, 19	87.216.067
Forderungen aus Zeichnungen		456.997
Zinsforderungen aus Swaps	2	27.396
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		16.893.615
Vorauszahlung aus Swapgeschäften	2	1.356.514
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2, 11	237.880
Sonstige Vermögenswerte		482
Summe Aktiva		1.755.769.483
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(25.643.522)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(5.202.972)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(511.144)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swapgeschäften	2	(1.165.610)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(4.928.324)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(23.004.047)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(795.471)
Andere Verbindlichkeiten		(128.779)
Summe Passiva		(61.379.869)
Nettovermögen insgesamt		1.694.389.614

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse ZE	554.039,009
Klasse 1E	22.403.793,932
Klasse 1EP	151.358,872
Klasse 1GH	275.841,999
Klasse 1UH	781.856,625
Klasse 2E	76.987.357,771
Klasse 2EP	100,000
Klasse 2GC	100,000
Klasse 2GH	16.213,398
Klasse 4GH	242.133,138
Klasse 8E	48.964.146,339
Klasse 8EP	5.104.154,630
Klasse 8GC	93.416,782
Klasse 8GH	11.655.737,632

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		1.710.173.003
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	237.960
Zinsen aus Anleihen, netto	2	29.303.052
Zinsen aus Bankguthaben	2	36.694
Zinsen aus Swaps		715.875
Zinsen aus Futures		9
Erträge insgesamt		30.293.590
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(4.924.065)
Bankspesen		(115.586)
Zinsaufwand aus Swaps		(9.378.714)
Zinsaufwand aus Futures		(300.382)
Sonstige Betriebskosten	5	(801.015)
Aufwendungen insgesamt		(15.519.762)
Nettoertrag aus Anlagen		14.773.828
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		8.784.983
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(6.278.766)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(7.404.768)
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(40.279.769)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		446.806
Realisierter Netto(verlust)		(44.731.514)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		29.728.182
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		4.892.417
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(5.621.746)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		10.728.194
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		39.727.047
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		9.769.361
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		253.257.674
Anteilrücknahmen		(278.810.424)
Kapitalbewegungen insgesamt		(25.552.750)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		1.694.389.614

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019
EUR	1.694.389.614	1.710.173.003

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [¶]	31. März 2019
Klasse ZE	10,0168	9,95
Klasse 1E	9,9797	9,93
Klasse 1EP	9,7781	9,73
Klasse 1GH	10,0944 ¹	9,99 ¹
Klasse 1UH	10,2834 ²	10,08 ²
Klasse 2E	10,0468	9,96
Klasse 2EP	9,8148	9,73
Klasse 2GC	9,9193 ¹	9,78 ¹
Klasse 2GH	10,1617 ¹	10,02 ¹
Klasse 4GH	10,2187 ¹	10,05 ¹
Klasse 8E	10,0384	9,96
Klasse 8EP	9,8702	9,79
Klasse 8GC	9,9703 ¹	9,83 ¹
Klasse 8GH	10,1587 ¹	10,02 ¹

¹Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

[¶]Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	84.542.596
Bankguthaben	2	4.100.211
Termineinlagen	2, 19	4.798.756
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		132.064
Forderungen aus Zeichnungen		16.384
Zinsforderungen aus Swaps	2	2.699
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		617.175
Vorauszahlung aus Swapgeschäften	2	265.008
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	95.756
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2, 11	53.428
Sonstige Vermögenswerte		4.863
Summe Aktiva		94.628.940
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(5.436.398)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(61.416)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(21.703)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swapgeschäften	2	(80.942)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(1.145.224)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(21.444)
Verbindlichkeiten aus Performance-Gebühren	8	(11)
Andere Verbindlichkeiten		(14.382)
Summe Passiva		(6.781.520)
Nettovermögen insgesamt		87.847.420

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	100,002
Klasse AFH	189,200
Klasse AKH	100,000
Klasse ANH	1.000,000
Klasse AUH	100,000
Klasse DE	602,715
Klasse IE	373.830,623
Klasse IEP	99,999
Klasse IGH	3.909.765,778
Klasse IU	100,000
Klasse IUH	868.047,595
Klasse JE	99,997
Klasse JGH	140,800
Klasse JUH	100,000
Klasse LE	2.726.079,001
Klasse LEP	256.627,320
Klasse LGH	140,800
Klasse YE	100,001
Klasse YGH	140,800
Klasse YUH	100,000
Klasse ZE	99,997
Klasse ZFH	20.189,200
Klasse ZGH	140,800
Klasse ZUH	100,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		50.389.420
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	866.002
Zinsen aus Bankguthaben	2	6.254
Zinsen aus Swaps		36.844
Erträge insgesamt		909.100
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(117.381)
Performance-Gebühren	8	(6)
Bankspesen		(14.923)
Zinsaufwand aus Swaps		(241.563)
Zinsaufwand aus Futures		(12.202)
Sonstige Betriebskosten	5	(76.436)
Aufwendungen insgesamt		(462.511)
Nettoertrag aus Anlagen		446.589
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		419.593
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		958.818
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.636.341)
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(1.969.862)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		25.870
Realisierter Netto(verlust)		(2.201.922)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.820.302
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(1.114.409)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		396.679
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		393.673
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		1.496.245
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(259.088)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		42.786.107
Anteilrücknahmen		(5.038.468)
Dividendenausschüttung	7	(30.551)
Kapitalbewegungen insgesamt		37.717.088
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		87.847.420

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
EUR	87.847.420	50.389.420	4.029.085

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AE	10,0139	9,96	10,00
Klasse AFH	9,9459 ¹	9,92 ¹	10,00 ¹
Klasse AKH [#]	99,7459 ²	–	–
Klasse ANH [#]	10,0135 ³	–	–
Klasse AUH	10,4428 ⁴	10,24 ⁴	9,99 ⁴
Klasse DE	9,9215	9,90	10,00
Klasse IE	10,1066	10,02	10,00
Klasse IEP	9,6836	9,72	10,00
Klasse IGH	10,2642 ⁵	10,12 ⁵	10,00 ⁵
Klasse IU [#]	9,7720 ⁴	–	–
Klasse IUH	10,5270 ⁴	10,29 ⁴	9,99 ⁴
Klasse JE	10,1147	10,03	10,00
Klasse JGH	10,2780 ⁵	10,14 ⁵	10,00 ⁵
Klasse JUH	10,5023 ⁴	10,29 ⁴	9,99 ⁴
Klasse LE	10,1298	10,03	10,00
Klasse LEP	9,7395	9,77	10,00
Klasse LGH	10,2910 ⁵	10,14 ⁵	10,00 ⁵
Klasse YE	10,0970	10,02	10,00
Klasse YGH	10,2532 ⁵	10,12 ⁵	10,00 ⁵
Klasse YUH	10,4831 ⁴	10,27 ⁴	9,99 ⁴
Klasse ZE	10,0847	10,01	10,00
Klasse ZFH	10,0114 ¹	9,96 ¹	10,00 ¹
Klasse ZGH	10,2573 ⁵	10,12 ⁵	10,00 ⁵
Klasse ZUH	10,5154 ⁴	10,28 ⁴	9,99 ⁴

¹Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

³Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

⁴Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

⁵Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

[#]Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	104.268.590
Bankguthaben	2	4.667.526
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		5.721.488
Forderungen aus Zeichnungen		1.397.152
Zinsforderungen aus Swaps	2	883.711
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		59.009
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	357.146
Sonstige Vermögenswerte		70.458
Summe Aktiva		117.425.080
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(9.341.544)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(44.115)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(3.672.796)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(160.517)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(379.144)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(25.698)
Verbindlichkeiten aus Performance-Gebühren	8	(266.559)
Andere Verbindlichkeiten		(14.923)
Summe Passiva		(13.905.296)
Nettovermögen insgesamt		103.519.784

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	592.604,950
Klasse AEP	200,000
Klasse AUH	200,000
Klasse DE	432.229,385
Klasse IE	794.587,788
Klasse IGH	96.568,577
Klasse LE	510.988,591
Klasse XGH	4.909.146,621
Klasse ZE	111.772,903
Klasse ZF	100,000
Klasse ZFH	100,000
Klasse ZGH	200,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ^f	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AE	11,8163	10,93	9,94
Klasse AEP	12,1228	11,06	9,93
Klasse AUH	12,3849 ¹	11,38 ¹	10,20 ¹
Klasse DE	11,6372	10,78	9,86
Klasse IE	12,1162	11,08	10,07
Klasse IGH	12,2846 ²	11,27 ²	10,17 ²
Klasse LE	12,2085	11,23	10,11
Klasse XGH	13,1407 ²	11,81 ²	10,33 ²
Klasse ZE	12,1082	11,14	10,05
Klasse ZF	11,6499 ³	11,04 ³	10,49 ³
Klasse ZFH	11,5473 ³	10,72 ³	–
Klasse ZGH	12,2082 ²	11,24 ²	10,15 ²

^fDie Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.²Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.⁴Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		62.685.309
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	940.385
Zinsen aus Bankguthaben	2	1.551
Zinsen aus Swaps		75.744
Zinsen aus Futures		45
Andere Erträge		22.459
Erträge insgesamt		1.040.184
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(109.133)
Performance-Gebühren	8	(139.663)
Bankspesen		(8.029)
Dividendenaufwand aus Swaps		(1.248.085)
Zinsaufwand aus Swaps		(137.793)
Zinsaufwand aus Futures		(45)
Sonstige Betriebskosten	5	(76.251)
Sonstige Gebühren	4	(1.687)
Aufwendungen insgesamt		(1.720.686)
Nettoertrag aus Anlagen		(680.502)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		9.927.038
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(237.413)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(2.126.338)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		36.297
Realisierter Nettogewinn		7.599.584
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(609.514)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(611.290)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		924.415
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(296.389)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		6.622.693
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		41.523.593
Anteilrücknahmen		(7.311.811)
Kapitalbewegungen insgesamt		34.211.782
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		103.519.784

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
EUR	103.519.784	62.685.309	45.413.612

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 GBP
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	8.310.855
Bankguthaben	2	520.074
Termineinlagen	2, 19	1.102.187
Forderungen aus Zeichnungen		6
Zinsforderungen aus Swaps	2	7.983
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		7.418
Summe Aktiva		9.948.523
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(900)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(20.704)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(18.591)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(14.780)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(33.464)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(33.518)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(10.530)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(10.143)
Verbindlichkeiten aus Performance-Gebühren	8	(52)
Andere Verbindlichkeiten		(1.314)
Summe Passiva		(143.996)
Nettovermögen insgesamt		9.804.527

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	100,000
Klasse AG	100,000
Klasse DEH	100,000
Klasse DG	100,000
Klasse IG	100,000
Klasse ZG	100,000
Klasse 1E	1.702.675,251
Klasse 1EH	1.906.472,632
Klasse 2E	100,000
Klasse 2EH	100,000
Klasse 3EH	156.563,216
Klasse 3FH	69.876,000
Klasse 8E	872.395,163
Klasse 8EH	2.894.288,864
Klasse 9EH	100,000
Klasse 9FH	100,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 GBP
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		15.636.041
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	149.971
Zinsen aus Anleihen, netto	2	9.726
Zinsen aus Bankguthaben	2	7.615
Zinsen aus Swaps		9.606
Zinsen aus Futures		172
Erträge insgesamt		177.090
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(76.134)
Performance-Gebühren	8	(9.723)
Bankspesen		(154)
Dividendenaufwand aus Swaps		(51.909)
Zinsaufwand aus Swaps		(5.725)
Sonstige Betriebskosten	5	(8.674)
Aufwendungen insgesamt		(152.319)
Nettoertrag aus Anlagen		24.771
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		373.661
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		32.356
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		433.533
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(125.791)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		43.245
Realisierter Nettogewinn		757.004
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(16.911)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(50.759)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(172.920)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		42.931
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(197.659)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		584.116
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		122.244
Anteilrücknahmen		(6.537.874)
Kapitalbewegungen insgesamt		(6.415.630)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		9.804.527

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019
GBP	9.804.527	15.636.041

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ¹	31. März 2019
Klasse AEH	10,2632 ¹	10,14 ¹
Klasse AG	10,3443	10,17
Klasse DEH	10,2377 ¹	10,14 ¹
Klasse DG	10,3096	10,16
Klasse IG	10,3902	10,18
Klasse ZG	10,3880	10,18
Klasse 1E	1,5004 ¹	1,51 ¹
Klasse 1EH	1,3444 ¹	1,32 ¹
Klasse 2E	10,1707 ¹	10,22 ¹
Klasse 2EH	10,2984 ¹	10,14 ¹
Klasse 3EH	1,3294 ¹	1,30 ¹
Klasse 3FH	1,4164 ²	1,39 ²
Klasse 8E	1,5648 ¹	1,57 ¹
Klasse 8EH	1,4821 ¹	1,46 ¹
Klasse 9EH	10,3087 ¹	10,15 ¹
Klasse 9FH	10,2987 ²	10,15 ²

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

³Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	110.280.479
Bankguthaben	2	861.043
Termineinlagen	2, 19	911.907
Forderungen aus Zeichnungen		41.365
Zinsforderungen aus Swaps	2	66.346
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		34.022
Sonstige Vermögenswerte		106
Summe Aktiva		112.195.268
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(79.599)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(72.102)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(59.990)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(21.712)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(117.555)
Andere Verbindlichkeiten		(15.662)
Summe Passiva		(366.620)
Nettovermögen insgesamt		111.828.648

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	264,813
Klasse AU	100,000
Klasse DEH	100,000
Klasse DU	100,000
Klasse IU	135.740,000
Klasse ZU	100,000
Klasse 1E	5.338.504,954
Klasse 1EH	860.201,384
Klasse 1U	7.824.067,068
Klasse 2E	100,000
Klasse 2U	100,000
Klasse 3U	48.800,000
Klasse 8E	405.934,543
Klasse 8U	5.059.754,924
Klasse 9U	100,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019
Klasse AEH	10,5310 ¹	10,31 ¹
Klasse AU	10,7554	10,36
Klasse DEH	10,4940 ¹	10,30 ¹
Klasse DU	10,7126	10,35
Klasse IU	10,8237	10,38
Klasse ZU	10,8075	10,38
Klasse 1E	5,1074 ¹	4,77 ¹
Klasse 1EH	3,8266 ¹	3,74 ¹
Klasse 1U	5,5671	5,36
Klasse 2E	11,3195 ¹	10,54 ¹
Klasse 2U	10,8287	10,38
Klasse 3U	3,1076	2,98
Klasse 8E	5,5636 ¹	5,18 ¹
Klasse 8U	6,0998	5,82
Klasse 9U	10,8277	10,38

[#]Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.¹Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		130.515.247
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	392.326
Zinsen aus Bankguthaben	2	42.556
Zinsen aus Swaps		263.795
Zinsen aus Futures		2.329
Andere Erträge		140.859
Erträge insgesamt		841.865
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(755.590)
Bankspesen		(878)
Dividendenaufwand aus Swaps		(47.335)
Zinsaufwand aus Swaps		(400.302)
Zinsaufwand aus Futures		(1.578)
Sonstige Betriebskosten	5	(100.270)
Aufwendungen insgesamt		(1.305.953)
Netto(verlust) aus Anlagen		(464.088)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.199.983
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		1.111.313
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(157.346)
Realisierter Nettogewinn aus Futures		173.011
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(5.831)
Realisierter Nettogewinn		2.321.130
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		3.189.613
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		143.029
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(8.884)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		3.323.758
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		5.180.800
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		8.393.336
Anteilrücknahmen		(32.260.735)
Kapitalbewegungen insgesamt		(23.867.399)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		111.828.648

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019
USD	111.828.648	130.515.247

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	168.975.072
Bankguthaben	2	698.746
Termineinlagen	2, 19	9.390.690
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		5.029.124
Forderungen aus Zeichnungen		28.560
Zinsforderungen aus Swaps	2	116.212
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		137.680
Sonstige Vermögenswerte		7.314
Summe Aktiva		184.383.398
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.820.467)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(52.583)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(79.977)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(2.535)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(1.706.459)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(191.911)
Verbindlichkeiten aus Performance-Gebühren	8	(472.636)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(179.779)
Andere Verbindlichkeiten		(26.113)
Summe Passiva		(5.532.460)
Nettovermögen insgesamt		178.850.938

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	20.100,000
Klasse AU	8.977,627
Klasse DEH	100,000
Klasse DU	100,000
Klasse IU	322.519,673
Klasse ZU	100,000
Klasse 1E	27.914.035,745
Klasse 1U	1.595.566,604
Klasse 2E	44.054,110
Klasse 2U	3.771.720,924
Klasse 8E	987.231,815
Klasse 8U	288.092,740

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 ^f	31. März 2019
Klasse AEH	11,0805 ¹	10,74 ¹
Klasse AU	11,2930	10,79
Klasse DEH	11,1303 ¹	10,73 ¹
Klasse DU	11,3124	10,78
Klasse IU	11,3783	10,80
Klasse ZU	11,3928	10,80
Klasse 1E	3,8981 ¹	3,58 ¹
Klasse 1U	4,2504	4,02
Klasse 2E	11,8977 ¹	10,94 ¹
Klasse 2U	11,3900	10,78
Klasse 8E	4,2362 ¹	3,89 ¹
Klasse 8U	4,6351	4,37

^fDie Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.¹Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		170.492.979
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	977.591
Zinsen aus Bankguthaben	2	150.865
Zinsen aus Swaps		423.500
Erträge insgesamt		1.551.956
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.155.267)
Performance-Gebühren	8	(271.611)
Bankspesen		(146)
Dividendenaufwand aus Swaps		(287.044)
Zinsaufwand aus Swaps		(864.713)
Sonstige Betriebskosten	5	(144.719)
Aufwendungen insgesamt		(2.723.500)
Netto(verlust) aus Anlagen		(1.171.544)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		3.917.290
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		6.017.237
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(523)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		24.888
Realisierter Netto(verlust) aus Kapitalertragsteuer		(579)
Realisierter Nettogewinn		9.958.313
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		3.161.863
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(2.396.887)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(2.511)
Nettoveränderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragsteuer		(69.845)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		692.620
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		9.479.389
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		29.007.649
Anteilrücknahmen		(30.129.079)
Kapitalbewegungen insgesamt		(1.121.430)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		178.850.938

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019
USD	178.850.938	170.492.979

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	366.928.350
Bankguthaben	2	13.802.390
Forderungen aus Zeichnungen		3.232.098
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		32.891
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	5.114.731
Sonstige Vermögenswerte		3.712
Summe Aktiva		389.114.172
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(73.685)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(57.452)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(1.186.893)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(134.365)
Andere Verbindlichkeiten		(57.649)
Summe Passiva		(1.510.044)
Nettovermögen insgesamt		387.604.128

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	293.214,887
Klasse AFH	148.361,729
Klasse AGH	32.138,210
Klasse ASH	1.283.388,797
Klasse AU	886.890,671
Klasse DEH	282.176,846
Klasse DU	171.958,946
Klasse IEH	398.610,347
Klasse IFH	25.000,000
Klasse IG	100,000
Klasse IGH	5.526.477,175
Klasse IU	3.581.674,267
Klasse NG	3.820.539,918
Klasse XU	13.078.996,118
Klasse ZEH	65.450,000
Klasse ZFH	6.510,000
Klasse ZGH	86.247,631
Klasse ZU	51.245,074

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		446.269.011
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	7.273.186
Zinsen aus Bankguthaben	2	168.421
Zinsen aus Swaps		12.787
Erträge insgesamt		7.454.394
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(897.406)
Bankspesen		(14.787)
Zinsaufwand aus Swaps		(391.487)
Sonstige Betriebskosten	5	(381.813)
Aufwendungen insgesamt		(1.685.493)
Nettoertrag aus Anlagen		5.768.901
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		163.294
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(21.260.774)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(7.218.040)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(44.523)
Realisierter Netto(verlust)		(28.360.043)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(2.343.413)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		6.806.974
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		758.996
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		5.222.557
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(17.368.585)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		26.721.263
Anteilrücknahmen		(68.017.561)
Kapitalbewegungen insgesamt		(41.296.298)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		387.604.128

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	387.604.128	446.269.011	551.347.892

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AEH	8,0664 ¹	8,48 ¹	9,62 ¹
Klasse AFH	5,9791 ²	6,30 ²	7,17 ²
Klasse AGH	8,5932 ³	8,98 ³	10,07 ³
Klasse ASH	4,4606 ⁴	4,63 ⁴	5,15 ⁴
Klasse AU	9,2657	9,58	10,54
Klasse DEH	6,1703 ¹	6,50 ¹	7,42 ¹
Klasse DU	7,0894	7,35	8,13
Klasse IEH	11,6779 ¹	12,21 ¹	13,72 ¹
Klasse IFH	8,6480 ²	9,06 ²	10,21 ²
Klasse IG	10,2720 ³	10,00 ³	–
Klasse IGH	12,4152 ³	12,90 ³	14,32 ³
Klasse IKH	–	–	105,98 ⁵
Klasse IU	13,4020	13,79	15,01
Klasse NG	9,8144 ³	9,53 ³	–
Klasse XU	13,9801	14,32	15,46
Klasse ZEH	4,9368 ¹	5,16 ¹	5,81 ¹
Klasse ZFH	4,7956 ²	5,02 ²	5,66 ²
Klasse ZGH	7,1154 ³	7,40 ³	8,22 ³
Klasse ZU	5,5318	5,69	6,20

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

⁴Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

⁵Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

[#]Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	12.756.096
Bankguthaben	2	271.239
Forderungen aus Zeichnungen		55
Forderungen aus Dividenden, netto		14.949
Sonstige Vermögenswerte		3.835
Summe Aktiva		13.046.174
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(8.285)
Andere Verbindlichkeiten		(3.224)
Summe Passiva		(11.509)
Nettovermögen insgesamt		13.034.665

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AU	547.331,512
Klasse XU	500.000,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2019 [#]	31. März 2019	31. März 2018
Klasse AU	12,3060	11,56	11,53
Klasse XU	12,5985	11,74	11,52

*Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2019 bis 30. September 2019

	Erläuterungen	2019 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		12.383.414
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	95.168
Erträge insgesamt		95.168
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(50.170)
Sonstige Betriebskosten	5	(19.443)
Sonstige Gebühren	4	(1.104)
Aufwendungen insgesamt		(70.717)
Nettoertrag aus Anlagen		24.451
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		117.163
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		32
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(1.300)
Realisierter Nettogewinn		115.895
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		694.013
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		694.013
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		834.359
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		112.337
Anteilrücknahmen		(295.445)
Kapitalbewegungen insgesamt		(183.108)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		13.034.665

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2019	31. März 2019	31. März 2018
USD	13.034.665	12.383.414	11.522.282

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
AUSTRALIEN				FRANKREICH (Fortsetzung)					
USD	1.247.000	APT Pipelines Limited 4.20% 23/03/2025	1.324.365	0,61	EUR	1.000.000	HSBC France SA 0.10% 03/09/2027	1.079.587	0,50
EUR	640.000	Aurizon Network Pty Limited 3.13% 01/06/2026	809.883	0,37	EUR	2.000.000	Orange SA 0.00% 04/09/2026	2.151.179	1,00
USD	1.545.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	1.692.035	0,78	Summe Frankreich				
EUR	890.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	1.016.444	0,47	DEUTSCHLAND				
USD	1.415.000	SGSP Australia Assets Pty 3.50% 07/07/2027	1.485.602	0,69	EUR	1.000.000	ADLER Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	1.109.507	0,51
Summe Australien					EUR	400.000	ADLER Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	462.743	0,21
					EUR	1.000.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	1.079.767	0,50
BELGIEN					EUR	1.344.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	1.519.955	0,70
EUR	400.000	KBC Group NV Perp FRN	466.544	0,22	EUR	1.527.000	Deutsche Bank AG 1.13% 30/08/2023	1.717.865	0,79
Summe Belgien					EUR	1.100.000	Vier Gas Transport GmbH 0.50% 10/09/2034	1.176.798	0,54
					Summe Deutschland				
BERMUDAS									
USD	1.480.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	1.698.277	0,78	INDIEN				
Summe Bermudas					USD	430.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	400.063	0,18
					Summe Indien				
KAIMANINSELN									
USD	532.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	579.253	0,27	IRLAND				
USD	101.000	Noble Holding International Limited 8.95% 01/04/2045	51.636	0,02	EUR	1.155.000	AIB Group plc 2.25% 03/07/2025	1.353.526	0,62
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	214.680	0,10	USD	610.000	Bank of Ireland Group plc 4.50% 25/11/2023	640.302	0,30
GBP	534.000	Thames Water Utilities Cayman Finance Limited 2.38% 03/05/2023	665.593	0,31	EUR	499.000	ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	584.531	0,27
Summe Kaimaninseln					USD	2.125.000	GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	2.235.529	1,04
					EUR	790.000	Zurich Finance Ireland Designated Activity Company 1.63% 17/06/2039	968.936	0,45
FINNLAND					Summe Irland				
EUR	362.000	Sampo Oyj FRN 23/05/2049	446.305	0,21					
Summe Finnland									
					ITALIEN				
FRANKREICH					EUR	375.000	Assicurazioni Generali SpA 5.00% 08/06/2048	480.306	0,22
EUR	2.100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 08/06/2026	2.371.263	1,10	EUR	375.000	Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	416.189	0,19
EUR	1.900.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	2.209.740	1,03					
USD	903.000	Credit Agricole SA Perp FRN	975.631	0,45					
EUR	1.700.000	Credit Mutuel Arkea SA 1.13% 23/05/2029	1.969.019	0,92					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
ITALIEN (Fortsetzung)				NIEDERLANDE (Fortsetzung)					
EUR	951.000	Banco BPM SpA 2.00% 08/03/2022	1.064.043	0,49	EUR	563.000	TenneT Holding BV Perp FRN	657.093	0,31
EUR	808.000	FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	881.877	0,41	EUR	500.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	713.956	0,33
		Summe Italien	2.842.415	1,31			Summe Niederlande	10.119.979	4,68
JAPAN				NORWEGEN					
EUR	991.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.55% 06/11/2023	1.116.019	0,52	EUR	1.625.000	DNB Bank ASA 0.25% 09/04/2024	1.790.674	0,83
		Summe Japan	1.116.019	0,52			Summe Norwegen	1.790.674	0,83
LUXEMBURG				SPANIEN					
EUR	885.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	997.019	0,46	EUR	500.000	Abanca Corp Bancaria SA FRN 18/01/2029	588.301	0,27
EUR	1.727.000	Bevco Lux Sarl 1.75% 09/02/2023	1.969.569	0,91	EUR	700.000	Bankia SA FRN 15/02/2029	819.144	0,38
EUR	300.000	CPI Property Group SA 2.13% 04/10/2024	346.367	0,16	EUR	1.200.000	Caixabank SA 1.13% 17/05/2024	1.363.551	0,63
EUR	934.000	DH Europe Finance II Sarl 0.45% 18/03/2028	1.021.920	0,48	EUR	600.000	Caixabank SA FRN 17/04/2030	673.809	0,31
EUR	503.000	DH Europe Finance II Sarl 0.75% 18/09/2031	551.453	0,25	EUR	1.627.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	1.926.549	0,89
EUR	800.000	Grand City Properties SA 1.38% 03/08/2026	909.489	0,42			Summe Spanien	5.371.354	2,48
EUR	500.000	Grand City Properties SA 1.50% 17/04/2025	575.524	0,27			SCHWEDEN		
EUR	273.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.00% 02/07/2031	310.219	0,14	EUR	1.620.000	Akelius Residential Property AB 1.75% 07/02/2025	1.862.400	0,85
		Summe Luxemburg	6.681.560	3,09	EUR	1.297.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	1.483.262	0,69
							Summe Schweden	3.345.662	1,54
MEXIKO				SCHWEIZ					
EUR	438.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	480.412	0,22	USD	330.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	365.870	0,17
USD	536.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	558.627	0,26	USD	950.000	UBS Group Funding Perp FRN	892.406	0,41
		Summe Mexiko	1.039.039	0,48	USD	768.000	UBS Group Funding Perp FRN	818.112	0,38
							Summe Schweiz	2.076.388	0,96
NIEDERLANDE				VEREINIGTES KÖNIGREICH					
EUR	918.000	ABN Amro Bank NV 0.50% 15/04/2026	1.024.732	0,47	EUR	950.000	British Telecommunications plc 1.50% 23/06/2027	1.086.900	0,50
EUR	1.317.000	Enaxis Holding NV 0.75% 02/07/2031	1.489.977	0,69	GBP	497.550	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	752.690	0,35
GBP	1.882.000	Innogy Finance BV 6.25% 03/06/2030	3.234.601	1,50	GBP	1.185.000	Bunzl Finance plc 2.25% 11/06/2025	1.504.293	0,69
USD	2.302.000	Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	2.435.385	1,12	GBP	1.568.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	2.191.670	1,01
EUR	500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	564.235	0,26	EUR	1.056.000	Cadent Finance plc 0.63% 22/09/2024	1.175.617	0,54

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
GBP	873.000	Cadent Finance plc 2.13% 22/09/2028	1.104.811	0,51	GBP	422.000	Scottish Hydro Electric Transmission plc 2.25% 27/09/2035	523.752	0,24
EUR	2.624.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	2.826.509	1,31	GBP	600.000	Severn Trent Water 3.63% 16/01/2026	833.232	0,38
EUR	464.000	DS Smith plc 1.38% 26/07/2024	522.510	0,24	GBP	475.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	607.900	0,28
GBP	385.000	Eversholt Funding plc 3.53% 07/08/2042	510.251	0,24	GBP	129.398	Telereal Securitisation plc 4.97% 10/09/2027	183.435	0,08
GBP	840.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	1.173.482	0,54	GBP	881.751	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	1.594.475	0,74
EUR	621.000	G4S International Finance plc 1.88% 24/05/2025	707.287	0,33	GBP	703.304	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	1.130.305	0,52
GBP	708.000	GKN Holdings plc 4.63% 12/05/2032	889.561	0,41	GBP	510.593	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	813.443	0,38
GBP	425.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	569.072	0,26	GBP	729.000	Tsb Banking Group plc FRN 06/05/2026	911.663	0,42
EUR	37.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	46.071	0,02	GBP	610.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	806.322	0,37
EUR	424.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	527.949	0,24			Summe Vereinigtes Königreich	36.073.471	16,62
GBP	533.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	855.086	0,39	VEREINIGTE STAATEN				
USD	850.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	850.386	0,39	USD	879.000	AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	973.772	0,45
GBP	453.000	Imperial Brands Finance plc 5.50% 28/09/2026	675.523	0,31	USD	640.000	American International Group Inc. 3.90% 01/04/2026	682.894	0,32
GBP	400.000	Legal & General Group plc FRN 27/06/2064	577.231	0,27	USD	2.000.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	2.319.545	1,07
GBP	250.000	Legal & General Group plc FRN 14/11/2048	342.821	0,16	USD	939.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	1.191.105	0,55
GBP	750.000	Lloyds Bank Corporate Markets plc 1.75% 11/07/2024	929.999	0,43	USD	328.000	Appalachian Power Company 4.40% 15/05/2044	381.723	0,18
GBP	262.000	Lloyds Bank plc 6.50% 17/09/2040	552.405	0,25	USD	1.400.000	AT&T Inc. 4.85% 01/03/2039	1.590.750	0,73
GBP	400.000	Nationwide Building Society Perp FRN	504.597	0,23	USD	1.393.000	AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	1.585.097	0,73
EUR	927.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	1.005.468	0,46	USD	3.614.000	BAT Capital Corp. 3.22% 15/08/2024	3.657.070	1,69
GBP	1.009.000	Northumbrian Water Finance plc 1.63% 11/10/2026	1.252.183	0,58	USD	890.000	Bayer US Finance II LLC 4.63% 25/06/2038	962.212	0,44
GBP	805.000	Pennon Group plc Perp FRN	999.252	0,46	EUR	802.000	Becton Dickinson and Company 1.90% 15/12/2026	939.788	0,43
GBP	255.000	Pension Insurance Corp plc 5.63% 20/09/2030	326.569	0,15	GBP	1.398.000	Becton Dickinson and Company 3.02% 24/05/2025	1.839.439	0,85
EUR	1.149.000	Royal Bank of Scotland FRN 02/03/2026	1.309.638	0,60	USD	880.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 4.25% 15/01/2049	1.045.122	0,47
USD	1.150.000	Royal Bank of Scotland Group plc FRN 08/05/2030	1.233.313	0,57	USD	1.900.000	BP Capital Markets America Inc. 4.23% 06/11/2028	2.152.879	0,99
USD	1.100.000	Santander UK plc 2.88% 18/06/2024	1.118.081	0,52	USD	439.000	Broadcom Cayman Finance 3.00% 15/01/2022	443.437	0,20
GBP	275.000	Santander UK plc 10.06% 29/10/2049	547.719	0,25					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
USD	1.220.000	Cardinal Health Inc. 4.37% 15/06/2047	1.174.256	0,55	USD	808.000	Microsoft Corp. 4.10% 06/02/2037	959.550	0,44
USD	560.000	Charter Communications Operating LLC FRN 01/02/2024	572.771	0,26	USD	350.000	Nevada Power Company 6.65% 01/04/2036	497.700	0,23
USD	538.000	Cigna Corp 4.90% 15/12/2048	617.492	0,28	USD	1.687.000	NiSource Inc. 4.80% 15/02/2044	1.977.722	0,91
USD	865.000	Comcast Corp. 4.60% 15/10/2038	1.038.069	0,48	USD	1.280.000	NSTAR Electric Company 3.25% 15/05/2029	1.364.842	0,63
USD	250.000	Conagra Brands Inc. 5.40% 01/11/2048	297.583	0,14	USD	1.367.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	1.463.534	0,68
USD	1.045.000	CSX Corp 4.25% 15/03/2029	1.181.576	0,55	USD	183.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	195.923	0,09
USD	150.000	CSX Corp. 3.80% 01/11/2046	157.574	0,07	USD	1.008.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	984.020	0,45
USD	709.000	CVS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	808.342	0,37	USD	739.000	PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	865.429	0,40
EUR	2.549.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	3.067.457	1,41	USD	700.000	San Diego Gas & Electric Company 4.15% 15/05/2048	804.468	0,37
USD	1.176.000	Duke Energy Progress Inc. 4.20% 15/08/2045	1.359.699	0,63	USD	576.000	Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	627.853	0,29
EUR	917.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	1.071.494	0,49	USD	956.000	Southern Company 4.40% 01/07/2046	1.069.359	0,49
EUR	170.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	206.372	0,10	EUR	782.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	857.115	0,40
EUR	1.268.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	1.539.292	0,72	USD	1.520.000	United Technologies Corp 4.13% 16/11/2028	1.722.719	0,80
EUR	454.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	611.089	0,28	USD	1.342.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	1.532.480	0,71
EUR	443.000	Fiserv Inc. 1.13% 01/07/2027	503.071	0,23	USD	659.000	Virginia Electric & Power Company 4.60% 01/12/2048	809.531	0,37
EUR	1.130.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	1.327.432	0,61	USD	440.000	Voya Financial Inc. 3.13% 15/07/2024	454.379	0,21
USD	572.000	Ford Motor Company 5.29% 08/12/2046	530.503	0,24	USD	1.468.000	Williams Cos Inc. 4.30% 04/03/2024	1.561.022	0,72
EUR	302.000	General Electric Company 2.13% 17/05/2037	339.790	0,16	USD	626.000	Williams Cos Inc. 4.85% 01/03/2048	673.228	0,31
GBP	1.356.000	Goldman Sachs Group Inc. 3.13% 25/07/2029	1.821.783	0,84	Summe Vereinigte Staaten			63.544.247	29,29
USD	500.000	Indiana Michigan Power Company 3.75% 01/07/2047	544.333	0,25	BRITISCHE JUNGFERNINSELN				
USD	81.000	Indiana Michigan Power Company 6.05% 15/03/2037	109.704	0,05	EUR	800.000	Global Switch Holdings Limited 1.50% 31/01/2024	908.882	0,42
EUR	360.000	IQVIA Inc. 3.25% 15/03/2025	403.221	0,19	USD	1.356.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	1.348.179	0,62
USD	948.000	Johnson & Johnson 3.40% 15/01/2038	1.027.488	0,47	Summe Britische Jungfernseln			2.257.061	1,04
USD	1.250.000	JPMorgan Chase & Company FRN 24/07/2038	1.374.325	0,63	Summe Anleihen				
USD	1.209.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	1.318.808	0,61	170.714.427				78,78
USD	470.000	Kinder Morgan Inc. 4.30% 01/03/2028	510.445	0,24					
USD	1.500.000	Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	1.424.172	0,65					
USD	395.000	Kroger Company 4.65% 15/01/2048	420.399	0,19					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)						
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Kommunalbehörden, Schuldsinstrumente				Anleihen (Fortsetzung)						
KANADA				BERMUDAS						
CAD	1.530.000	Canada (Govt of) 2.25% 01/06/2025	1.210.295	0,56	USD	2.406.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	2.572.035	1,19	
Summe Kanada			1.210.295	0,56	Summe Bermudas			2.572.035	1,19	
DEUTSCHLAND				DÄNEMARK						
EUR	519.000	Germany (Govt of) 2.50% 15/08/2046	973.409	0,45	USD	1.000.000	Danske Bank A/S 2.70% 02/03/2022	1.005.363	0,46	
Summe Deutschland			973.409	0,45	Summe Dänemark			1.005.363	0,46	
VEREINIGTES KÖNIGREICH				FRANKREICH						
GBP	347.000	United Kingdom Gilt 1.50% 22/07/2047	481.684	0,22	USD	1.600.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.592.634	0,74	
Summe Vereinigtes Königreich			481.684	0,22	USD	630.000	Electricite de France 4.88% 22/01/2044	734.038	0,34	
VEREINIGTE STAATEN				FRANKREICH						
USD	9.180.000	United States Treasury N/B 2.75% 15/02/2028	9.969.623	4,60	USD	270.000	Electricite de France 4.88% 21/09/2038	316.410	0,15	
USD	5.539.000	United States Treasury N/B 2.75% 15/08/2047	6.275.514	2,90	Summe Frankreich			2.643.082	1,23	
USD	1.500.000	United States Treasury N/B 2.88% 15/08/2028	1.650.000	0,76	ITALIEN					
Summe Vereinigte Staaten			17.895.137	8,26	USD	300.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	299.962	0,14	
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldsinstrumente				20.560.525	9,49	Summe Italien			299.962	0,14
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				191.274.952	88,27	NIEDERLANDE				
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere				VEREINIGTE STAATEN						
Anleihen				USD	350.000	Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	402.662	0,19		
AUSTRALIEN				USD	212.000	Erac USA Finance LLC P.P. 144A 4.50% 15/02/2045	236.235	0,11		
USD	1.362.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	1.461.944	0,67	USD	917.000	Five Corners Funding P.P. 144A 4.42% 15/11/2023	991.161	0,45	
USD	1.500.000	Sydney Airport Finance Company Pty Limited 3.63% 28/04/2026	1.566.643	0,72	USD	573.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	732.524	0,34	
USD	1.765.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	1.920.361	0,89	USD	417.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	468.113	0,22	
Summe Australien			4.948.948	2,28	USD	400.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	468.675	0,22	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
----------	--------	------------------	---------------------------------------

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

Anleihen (Fortsetzung)

VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)

USD	402.000	Northwestern Mutual 3.85% 30/09/2047	430.769	0,20
USD	495.000	Peachtree Fund Trust 3.98% 15/02/2025	521.220	0,24
USD	572.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	653.996	0,30
		Summe Vereinigte Staaten	4.905.355	2,27
		Summe Anleihen	17.167.273	7,93

Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt **17.167.273** **7,93**

Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

Anleihen

PORTUGAL

EUR	200.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2020	45.521	0,02
		Summe Portugal	45.521	0,02

VEREINIGTE STAATEN

USD	1.950.000	Oncor Electric Delivery CompanyLLC 3.70% 15/11/2028	2.152.045	1,00
		Summe Vereinigte Staaten	2.152.045	1,00
		Summe Anleihen	2.197.566	1,02

Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente **2.197.566** **1,02**

Wert der Anlagen insgesamt **210.639.791** **97,22**

(Gesamtkosten: USD 202.576.255)

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
IRLAND				LUXEMBURG (Fortsetzung)			
EUR	860.000 AIB Group plc 2.25% 03/07/2025	924.436	0,69	EUR	204.000 Medtronic Global Holdings SCA 1.00% 02/07/2031	212.633	0,16
EUR	367.000 ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	394.337	0,29	EUR	1.106.000 Selp Finance Sarl 1.25% 25/10/2023	1.148.290	0,85
EUR	767.000 Zurich Finance Ireland Designated Activity Company 1.63% 17/06/2039	862.893	0,64		Summe Luxemburg	7.187.368	5,34
	Summe Irland	2.181.666	1,62		NIEDERLANDE		
ITALIEN				EUR	691.000 ABN Amro Bank NV 0.50% 15/04/2026	707.521	0,52
EUR	383.000 Assicurazioni Generali SpA 5.00% 08/06/2048	449.966	0,33	EUR	900.000 Bayer Capital Corp BV 1.50% 26/06/2026	956.760	0,71
EUR	420.000 Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 01/02/2027	407.955	0,30	EUR	400.000 Bayer Capital Corp. BV 2.13% 15/12/2029	441.488	0,33
EUR	571.000 FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	571.645	0,42	EUR	1.197.000 BMW Finance NV 0.13% 13/07/2022	1.201.429	0,90
EUR	459.000 FCA Bank SpA 0.63% 24/11/2022	464.005	0,34	EUR	3.500.000 Deutsche Telekom International Finance BV FRN 03/04/2020	3.505.622	2,60
	Summe Italien	1.893.571	1,39	EUR	935.000 Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	970.285	0,72
JAPAN				EUR	700.000 Enexis Holding NV 0.88% 28/04/2026	741.463	0,55
EUR	766.000 Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.55% 06/11/2023	791.262	0,59	EUR	500.000 Koninklijke KPN NV 3.25% 01/02/2021	523.118	0,39
	Summe Japan	791.262	0,59	EUR	575.000 Rabobank 1.38% 03/02/2027	632.110	0,47
JERSEY - KANALINSELN				EUR	961.000 Stedin Holding NV 1.38% 19/09/2028	1.046.675	0,78
EUR	912.000 Heathrow Funding Limited 1.88% 14/03/2034	989.918	0,73	EUR	984.000 Stedin Holding NV Perp FRN	1.041.326	0,77
	Summe Jersey - Kanalinseln	989.918	0,73	EUR	600.000 Syngenta Finance NV 1.25% 10/09/2027	588.707	0,44
LUXEMBURG				EUR	700.000 Telefonica Europe BV Perp FRN	724.572	0,54
EUR	1.255.000 Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	1.296.874	0,96	EUR	700.000 Telefonica Europe BV Perp FRN	771.849	0,57
EUR	1.395.000 Bevco Lux Sarl 1.75% 09/02/2023	1.459.308	1,09	EUR	298.000 TenneT Holding BV 0.88% 03/06/2030	313.371	0,23
EUR	540.000 CPI Property Group SA 2.13% 04/10/2024	571.877	0,42	EUR	553.000 TenneT Holding BV 2.13% 01/11/2020	566.665	0,42
EUR	640.000 DH Europe Finance II Sarl 0.45% 18/03/2028	642.309	0,48	EUR	900.000 Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	1.178.793	0,87
EUR	354.000 DH Europe Finance II Sarl 0.75% 18/09/2031	355.990	0,26		Summe Niederlande	15.911.754	11,81
EUR	300.000 Glencore Finance Europe Limited 3.75% 01/04/2026	349.102	0,26	NORWEGEN			
EUR	800.000 Grand City Properties SA 1.38% 03/08/2026	834.241	0,62	EUR	1.541.000 DNB Bank ASA 0.25% 09/04/2024	1.557.614	1,16
EUR	300.000 Grand City Properties SA 1.50% 17/04/2025	316.744	0,24	EUR	1.074.000 DNB Boligkreditt AS 0.38% 20/10/2020	1.083.228	0,80
					Summe Norwegen	2.640.842	1,96

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
SPANIEN				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
EUR	400.000	Abanca Corp Bancaria SA FRN 18/01/2029	431.701	0,32	GBP	850.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	1.089.205	0,82
EUR	400.000	Abertis Infraestructuras SA 3.00% 27/03/2031	453.068	0,34	EUR	1.125.000	G4S International Finance plc 1.50% 02/06/2024	1.160.034	0,86
EUR	500.000	Bankia SA FRN 15/02/2029	536.693	0,40	GBP	709.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	870.800	0,64
EUR	800.000	Caixabank SA 1.13% 17/05/2024	833.823	0,62	EUR	735.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	839.474	0,62
EUR	700.000	Caixabank SA FRN 17/04/2030	721.070	0,53	EUR	838.000	Imperial Brands Finance plc 1.13% 14/08/2023	856.678	0,64
EUR	1.154.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	1.253.407	0,93	EUR	778.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	879.038	0,65
	Summe Spanien	4.229.762	3,14	EUR	393.000	Lloyds Bank Corporate Markets plc 0.25% 04/10/2022	393.466	0,29	
				EUR	1.162.000	Motability Operations Group plc 0.38% 03/01/2026	1.166.648	0,87	
SCHWEDEN				EUR	649.000	National Express Group plc FRN 15/05/2020	648.619	0,48	
EUR	2.050.000	Akelius Residential Property AB 1.75% 07/02/2025	2.161.750	1,60	EUR	570.000	NatWest Markets plc FRN 27/09/2021	574.455	0,43
EUR	420.000	Essity AB 0.50% 26/05/2021	424.446	0,31	EUR	789.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	784.981	0,58
EUR	615.000	Nordea Bank AB 0.30% 30/06/2022	623.026	0,46	GBP	887.000	Pennon Group plc Perp FRN	1.009.942	0,74
EUR	1.026.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	1.076.265	0,81	EUR	545.000	Rolls-Royce plc 1.63% 09/05/2028	586.313	0,44
	Summe Schweden	4.285.487	3,18	EUR	1.857.000	Royal Bank of Scotland FRN 02/03/2026	1.941.499	1,44	
VEREINIGTES KÖNIGREICH				EUR	1.289.000	WellCome Trust Limited 1.13% 21/01/2027	1.396.746	1,03	
EUR	355.000	Aviva plc FRN 03/07/2044	389.768	0,29		Summe Vereinigtes Königreich	26.814.708	19,89	
EUR	380.000	Barclays plc FRN 07/02/2028	377.286	0,28	VEREINIGTE STAATEN				
EUR	820.000	Bat International Finance plc 2.75% 25/03/2025	903.133	0,67	EUR	653.000	American International Group Inc. 1.88% 21/06/2027	712.915	0,53
EUR	1.133.000	BP Capital Markets plc 0.83% 08/11/2027	1.176.312	0,87	EUR	810.000	AT&T Inc. 3.15% 04/09/2036	986.284	0,73
EUR	830.000	British Telecommunications plc 1.50% 23/06/2027	871.040	0,65	EUR	1.270.000	BAT Capital Corp. 1.13% 16/11/2023	1.300.641	0,96
EUR	1.978.000	Cadent Finance plc 0.63% 22/09/2024	2.019.863	1,50	EUR	863.000	Becton Dickinson and Company 1.90% 15/12/2026	927.598	0,69
GBP	1.085.962	Delamare Finance plc 5.55% 19/02/2029	1.433.442	1,06	EUR	885.000	Berkshire Hathaway Inc. 1.13% 16/03/2027	941.143	0,69
EUR	415.000	Diageo Finance plc 0.00% 17/11/2020	416.093	0,31	EUR	957.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	1.056.366	0,79
EUR	735.000	Diageo Finance plc 1.00% 22/04/2025	771.297	0,57	EUR	750.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	827.873	0,61
EUR	1.779.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	1.757.747	1,31	EUR	484.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	502.708	0,37
EUR	423.000	DS Smith plc 1.38% 26/07/2024	436.929	0,32	EUR	245.000	Equinix Inc. 2.88% 01/02/2026	255.771	0,19
EUR	500.000	ELM BV for RELX Finance BV 2.50% 24/09/2020	513.431	0,38					
EUR	698.000	Experian Finance plc 1.38% 25/06/2026	743.485	0,55					
EUR	360.000	Experian Finance plc 4.75% 04/02/2020	366.164	0,27					
EUR	440.000	FCE Bank plc 1.62% 11/05/2023	440.820	0,33					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				DEUTSCHLAND					
EUR	681.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	729.897	0,54	EUR	410.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2029	434.069	0,32
EUR	946.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	1.053.383	0,78	EUR	111.680	Germany (Govt of) 1.25% 15/08/2048	155.969	0,12
EUR	270.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	300.649	0,22			Summe Deutschland	590.038	0,44
EUR	160.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	197.543	0,15			Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	590.038	0,44
EUR	325.000	Fiserv Inc. 1.13% 01/07/2027	338.535	0,25			Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	125.894.741	93,41
EUR	610.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	657.291	0,49			Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere		
EUR	1.647.000	General Electric Company 2.13% 17/05/2037	1.699.772	1,26			Anleihen		
EUR	470.000	IQVIA Inc. 3.25% 15/03/2025	482.872	0,36			BERMUDAS		
EUR	351.000	JPMorgan Chase & Company FRN 25/07/2031	364.194	0,27	USD	840.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	823.672	0,61
EUR	419.000	JPMorgan Chase & Company FRN 12/06/2029	466.582	0,35			Summe Bermudas	823.672	0,61
EUR	1.155.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	1.231.664	0,91			FRANKREICH		
EUR	660.000	Metropolitan Life Global Funding I 0.38% 09/04/2024	669.781	0,50	USD	1.100.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.004.344	0,75
EUR	1.205.000	Molson Coors Brewing Company 1.25% 15/07/2024	1.251.732	0,93			Summe Frankreich	1.004.344	0,75
EUR	535.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	537.873	0,40			ITALIEN		
EUR	798.000	Verizon Communications Inc. 0.88% 08/04/2027	824.255	0,61	USD	500.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	458.574	0,34
EUR	424.000	Verizon Communications Inc. 2.88% 15/01/2038	526.857	0,39			Summe Italien	458.574	0,34
		Summe Vereinigte Staaten	18.844.179	13,97			NIEDERLANDE		
		BRITISCHE JUNGFERNINSELN			USD	1.150.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	1.137.231	0,84
EUR	671.000	Global Switch Holdings Limited 1.50% 31/01/2024	699.253	0,52			Summe Niederlande	1.137.231	0,84
EUR	350.000	Global Switch Holdings Limited 2.25% 31/05/2027	381.784	0,28			Summe Anleihen	3.423.821	2,54
		Summe Britische Jungferninseln	1.081.037	0,80			Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt	3.423.821	2,54
		Summe Anleihen	125.304.703	92,97					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
Anleihen				
PORTUGAL				
EUR	600.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2020	125.265	0,09
		Summe Portugal	125.265	0,09
VEREINIGTES KÖNIGREICH				
GBP	300.000	Cattles Limited 7.13% 05/07/2047	1.558	0,00
EUR	350.000	Lehman Brothers UK Capital Funding III LP 3.88% 22/02/2167*	0	0,00
		Summe Vereinigtes Königreich	1.558	0,00
		Summe Anleihen	126.823	0,09
		Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	126.823	0,09
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren				
Fonds				
IRLAND				
	48.999	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	4.887.389	3,63
		Summe Irland	4.887.389	3,63
		Summe Fonds	4.887.389	3,63
		Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	4.887.389	3,63
		Wert der Anlagen insgesamt	134.332.774	99,67
		(Gesamtkosten: EUR 128.461.335)		

*Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
BELGIEN				FRANKREICH (Fortsetzung)					
EUR	3.100.000	Belfius Bank SA Perp FRN	3.290.649	0,68	EUR	480.000	CMA CGM SA 5.25% 15/01/2025	343.650	0,07
EUR	1.449.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	1.486.960	0,31	EUR	931.000	Credit Agricole SA Perp FRN	1.007.769	0,21
EUR	200.000	Solvay SA Perp FRN	220.980	0,05	EUR	2.601.000	Crown European Holdings 2.63% 30/09/2024	2.808.480	0,58
		Summe Belgien	4.998.589	1,04	EUR	750.000	Crown European Holdings 3.38% 15/05/2025	833.924	0,17
					EUR	1.403.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	1.526.406	0,31
KANADA					EUR	1.500.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	1.500.256	0,31
EUR	1.570.000	Bausch Health Cos Inc. 4.50% 15/05/2023	1.590.410	0,33	EUR	500.000	Elis SA 1.63% 03/04/2028	500.543	0,10
EUR	2.524.000	Cott Corp. 5.50% 01/07/2024	2.635.672	0,54	EUR	2.500.000	Elis SA 1.75% 11/04/2024	2.595.199	0,53
		Summe Kanada	4.226.082	0,87	EUR	1.900.000	Elis SA 2.88% 15/02/2026	2.087.277	0,43
					EUR	677.000	Faurecia SE 3.13% 15/06/2026	719.737	0,15
KAIMANINSELN					EUR	232.000	Getlink SE 3.63% 01/10/2023	242.552	0,05
GBP	878.000	Petrobras International Finance Company 6.25% 14/12/2026	1.177.083	0,24	EUR	1.362.000	La Financiere Atalian 4.00% 15/05/2024	1.006.133	0,21
EUR	135.000	UPCB Finance IV Limited 4.00% 15/01/2027	142.893	0,03	EUR	632.000	La Financiere Atalian 5.13% 15/05/2025	465.052	0,10
EUR	1.421.000	UPCB Finance VII 3.63% 15/06/2029	1.511.370	0,31	EUR	1.118.000	Louvre Bidco SAS FRN 30/09/2024	1.136.307	0,23
		Summe Kaimaninseln	2.831.346	0,58	EUR	2.324.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	2.397.797	0,49
					EUR	1.155.000	Loxam SAS 3.75% 15/07/2026	1.199.226	0,25
FINNLAND					EUR	900.000	Orange SA Perp FRN	944.409	0,19
EUR	932.000	Nokia Oyj 2.00% 11/03/2026	982.305	0,20	EUR	183.000	Orange SA Perp FRN	197.087	0,04
		Summe Finnland	982.305	0,20	EUR	1.121.000	Orange SA Perp FRN	1.368.332	0,28
					GBP	425.000	Orange SA Perp FRN	523.932	0,11
FRANKREICH					EUR	500.000	Orano SA 3.13% 20/03/2023	539.420	0,11
EUR	934.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	949.566	0,19	EUR	600.000	Orano SA 3.38% 23/04/2026	646.996	0,13
EUR	1.660.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	1.689.852	0,35	EUR	1.400.000	Orano SA 3.50% 22/03/2021	1.463.666	0,31
EUR	987.000	Altice France SA 5.63% 15/05/2024	1.018.831	0,21	EUR	150.000	Orano SA 4.88% 23/09/2024	174.920	0,04
EUR	5.072.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	5.627.536	1,16	EUR	2.322.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	2.185.286	0,45
EUR	1.900.000	Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	1.760.431	0,36	EUR	404.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2025	413.561	0,08
EUR	1.800.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.05% 05/08/2026	1.580.875	0,33	EUR	125.000	Rexel SA 2.63% 15/06/2024	127.992	0,03
EUR	800.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.56% 25/01/2023	765.225	0,16	EUR	1.134.000	Rexel SA 2.75% 15/06/2026	1.186.915	0,24
EUR	1.500.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.56% 25/01/2023	1.434.796	0,29	EUR	986.000	Solvay Finance SA Perp FRN	1.063.070	0,22
EUR	800.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.98% 26/05/2021	823.895	0,17	EUR	2.880.000	Solvay Finance SA Perp FRN	3.410.856	0,69
EUR	1.100.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	1.029.515	0,21	EUR	2.033.000	SPCM SA 2.88% 15/06/2023	2.056.446	0,42
					EUR	2.600.000	SPIE SA 2.63% 18/06/2026	2.710.953	0,56
							Summe Frankreich	56.064.671	11,52
FRANKREICH					DEUTSCHLAND				
EUR	1.503.000	Adler Real Estate AG 1.50% 06/12/2021	1.528.698	0,31	EUR	1.920.000	Adler Real Estate AG 2.13% 06/02/2024	1.974.000	0,41
EUR	2.600.000	ADLER Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	2.646.046	0,54					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
JAPAN				LUXEMBURG (Fortsetzung)					
EUR	1.302.000	SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	1.397.959	0,29	EUR	1.649.000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 4.75% 15/07/2022	1.851.740	0,38
EUR	5.574.000	SoftBank Group Corp 5.00% 15/04/2028	6.214.870	1,29	EUR	1.564.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.50% 01/08/2022	1.494.558	0,31
		Summe Japan	7.612.829	1,58	GBP	1.659.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 8.50% 01/11/2022	1.769.822	0,36
JERSEY - KANALINSELN				LUXEMBURG (Fortsetzung)					
EUR	2.506.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	2.682.533	0,55	EUR	2.900.000	Gestamp Fund Lux 3.50% 15/05/2023	1.227.317	0,25
EUR	3.841.008	Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	4.008.241	0,82	EUR	2.900.000	Grand City Properties SA Perp FRN	3.101.236	0,64
		Summe Jersey - Kanalinseln	6.690.774	1,37	EUR	857.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	828.849	0,17
LUXEMBURG				LUXEMBURG (Fortsetzung)					
USD	607.000	Altice Financing SA 6.63% 15/02/2023	572.194	0,12	EUR	3.204.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	3.597.039	0,73
USD	1.926.000	Altice Finco SA 8.13% 15/01/2024	1.827.535	0,38	EUR	1.711.000	Holcim Finance Luxembourg SA Perp FRN	1.801.050	0,37
EUR	694.000	Altice Finco SA 9.00% 15/06/2023	722.122	0,15	EUR	3.092.000	Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/02/2022	3.168.475	0,65
EUR	1.284.000	Altice Luxembourg SA 6.25% 15/02/2025	1.344.210	0,28	EUR	650.000	Ineos Group Holdings SA 5.38% 01/08/2024	667.378	0,14
EUR	1.035.831	Altice Luxembourg SA 7.25% 15/05/2022	1.058.316	0,22	EUR	1.502.000	Intralot Capital Lux 5.25% 15/09/2024	725.804	0,15
EUR	4.995.000	Altice Luxembourg SA 8.00% 15/05/2027	5.500.108	1,14	EUR	1.125.000	Leonardo SpA 4.50% 19/01/2021	1.188.467	0,24
EUR	1.243.000	Aramark International Finance 3.13% 01/04/2025	1.285.038	0,26	EUR	1.204.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	1.246.459	0,26
EUR	920.000	ARD Finance SA 6.63% 15/09/2023	953.346	0,20	EUR	470.000	LSF10 Wolverine Investments SCA FRN 15/03/2024	473.413	0,10
EUR	100.000	Arena Luxembourg Finance Sarl FRN 01/11/2023	101.051	0,02	EUR	1.148.000	LSF10 Wolverine Investments SCA 5.00% 15/03/2024	1.182.253	0,24
EUR	904.000	Arena Luxembourg Finance Sarl 2.88% 01/11/2024	943.752	0,19	EUR	1.610.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	1.645.937	0,34
EUR	550.000	BMBG Bond Finance SCA 3.00% 15/06/2021	553.755	0,11	EUR	530.000	Picard Bondco SA 5.50% 30/11/2024	516.610	0,11
EUR	607.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	640.859	0,13	EUR	1.318.000	Swissport Financing Sarl 5.25% 15/08/2024	1.369.372	0,27
EUR	1.339.000	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	1.426.769	0,29	EUR	649.000	Swissport Financing Sarl 9.00% 15/02/2025	672.446	0,14
EUR	738.000	Codere Finance 2 Luxembourg SA 6.75% 01/11/2021	730.858	0,15	EUR	536.000	Takko Luxembourg 2 SCA 5.38% 15/11/2023	511.514	0,11
EUR	940.000	CPI Property Group SA Perp FRN	964.023	0,20	EUR	1.218.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	1.815.062	0,37
EUR	1.003.000	CPI Property Group SA Perp FRN	1.050.081	0,22	EUR	1.500.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	1.618.112	0,33
EUR	2.335.000	Crystal Almond Sarl 10.00% 01/11/2021	2.415.962	0,50	EUR	1.628.900	Telenet Finance VI Luxembourg SCA 4.88% 15/07/2027	1.806.806	0,37
						Summe Luxemburg	56.369.698	11,59	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
MEXIKO					NIEDERLANDE (Fortsetzung)				
EUR	1.000.000	Cemex SAB de CV 2.75% 05/12/2024	1.030.998	0,21	EUR	1.052.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.25% 15/04/2022	980.567	0,20
USD	726.000	Cemex SAB de CV 7.75% 16/04/2026	724.618	0,15	EUR	300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	255.935	0,05
		Summe Mexiko	1.755.616	0,36	EUR	855.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	906.361	0,19
NIEDERLANDE					EUR	1.376.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	1.439.943	0,30
EUR	905.000	Constellium NV 4.25% 15/02/2026	937.006	0,19	EUR	1.098.000	UPC Holding BV 3.88% 15/06/2029	1.157.469	0,24
EUR	2.298.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	2.445.144	0,51	EUR	1.589.000	Ziggo Bond Finance BV FRN 15/01/2025	1.638.975	0,33
EUR	1.176.000	Dufry One BV 2.50% 15/10/2024	1.211.830	0,25	EUR	447.000	Ziggo BV 3.75% 15/01/2025	458.928	0,09
EUR	1.550.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.75% 29/03/2024	1.745.958	0,36	EUR	1.604.000	Ziggo BV 4.25% 15/01/2027	1.735.152	0,36
GBP	2.547.000	Intergen NV 7.50% 30/06/2021	2.856.116	0,58			Summe Niederlande	61.936.242	12,71
EUR	2.850.000	Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	3.007.901	0,62	SPANIEN				
EUR	4.168.000	InterXion Holding NV 4.75% 15/06/2025	4.527.513	0,93	EUR	2.500.000	Cellnex Telecom SA 2.38% 16/01/2024	2.682.386	0,55
GBP	1.448.000	Koninklijke KPN NV FRN 14/03/2023	1.674.650	0,34	EUR	800.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	883.783	0,18
EUR	2.579.000	LKQ Euro Holdings BV 3.63% 01/04/2026	2.708.824	0,55	EUR	1.000.000	Distribuidora Internacional de Alimentacion 1.00% 28/04/2021	780.625	0,16
EUR	189.000	OI European Group BV 4.88% 31/03/2021	202.071	0,04	EUR	2.611.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	2.690.058	0,55
EUR	2.222.000	Petrobras Global Finance BV 4.75% 14/01/2025	2.609.562	0,54	EUR	1.445.000	Tasty Bondco 1 SA 6.25% 15/05/2026	1.525.844	0,31
GBP	739.000	Petrobras Global Finance BV 6.63% 16/01/2034	995.561	0,20			Summe Spanien	8.562.696	1,75
EUR	100.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	104.995	0,02	SUPRANATIONAL				
EUR	1.436.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2025	1.656.086	0,34	EUR	705.000	Ardagh Packaging Finance plc 2.13% 15/08/2026	724.892	0,15
EUR	1.101.635	Summer BidCo BV 9.00% 17/11/2025	1.162.509	0,24			Summe Supranational	724.892	0,15
EUR	300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	310.531	0,06	SCHWEDEN				
EUR	2.600.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	2.866.868	0,59	EUR	3.356.000	Akelius Residential AB FRN 05/10/2028	3.606.865	0,74
EUR	3.900.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	4.134.600	0,85	EUR	2.276.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	2.319.841	0,48
EUR	4.900.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	5.270.767	1,08	EUR	505.000	Volvo Car AB 2.00% 24/01/2025	524.855	0,11
EUR	1.700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.973.714	0,41	EUR	1.571.000	Volvo Car AB 2.13% 02/04/2024	1.639.919	0,34
GBP	2.000.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	2.392.738	0,49			Summe Schweden	8.091.480	1,67
EUR	3.285.000	TenneT Holding BV Perp FRN	3.516.801	0,72					
EUR	3.966.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.13% 15/10/2024	2.987.773	0,62					
EUR	2.455.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/03/2023	2.063.394	0,42					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
SCHWEIZ				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
USD	2.370.000 Credit Suisse AG 6.50% 08/08/2023	2.425.761	0,50	EUR	220.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	187.976	0,04
USD	859.000 Credit Suisse Group AG Perp FRN	873.573	0,18	GBP	1.022.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 2.75% 24/01/2021	1.090.918	0,22
EUR	2.038.000 UBS Group AG Perp FRN	2.237.045	0,46	GBP	465.000 Lloyds TSB Bank plc FRN 29/01/2049	929.278	0,19
	Summe Schweiz	5.536.379	1,14	EUR	2.450.000 Merlin Entertainments plc 2.75% 15/03/2022	2.606.698	0,54
VEREINIGTES KÖNIGREICH				GBP	100.000 Miller Homes 5.50% 15/10/2024	115.688	0,02
EUR	1.287.000 Algeco Global Finance plc 6.50% 15/02/2023	1.298.422	0,27	USD	641.000 Neptune Energy Bondco plc 6.63% 15/05/2025	604.546	0,12
GBP	2.116.000 Ardonagh Midco 3 Plc 8.38% 15/07/2023	2.303.772	0,47	EUR	370.000 OTE plc 0.88% 24/09/2026	369.877	0,08
GBP	1.757.000 Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	2.125.328	0,44	EUR	1.521.000 OTE plc 3.50% 09/07/2020	1.560.634	0,32
GBP	3.398.000 Arrow Global Finance 5.13% 15/09/2024	3.833.015	0,79	GBP	1.704.000 Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	2.055.598	0,42
EUR	628.000 Boparan Finance 4.38% 15/07/2021	392.500	0,08	USD	1.339.000 Royal Bank of Scotland 8.63% Perp	1.316.769	0,27
GBP	510.000 Boparan Finance plc 5.50% 15/07/2021	358.811	0,07	GBP	1.633.000 Santander UK plc 10.06% 29/10/2049	2.983.355	0,61
GBP	1.466.000 Co-operative Group FRN 08/07/2026	1.884.576	0,39	GBP	1.621.000 Shop Direct 7.75% 15/11/2022	1.626.450	0,33
GBP	821.000 Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	978.616	0,20	GBP	1.702.000 Stonegate Pub Company Financing plc FRN 15/03/2022	1.947.022	0,40
GBP	464.000 Drax Finco plc 4.25% 01/05/2022	534.028	0,11	EUR	2.076.000 Synlab Unsecured Bondco plc 8.25% 01/07/2023	2.171.630	0,45
EUR	843.000 EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	853.691	0,18	GBP	560.000 Tesco Corporate Treasury Services plc 2.50% 02/05/2025	644.791	0,13
GBP	1.120.000 EI Group plc 6.88% 15/02/2021	1.305.026	0,27	GBP	231.000 Tesco plc 5.50% 13/01/2033	336.113	0,07
GBP	1.216.000 EI Group plc 7.50% 15/03/2024	1.475.395	0,30	GBP	324.000 Tesco plc 6.13% 24/02/2022	407.806	0,08
USD	3.395.670 Enquest plc 7.00% 15/04/2022	2.573.539	0,53	GBP	2.010.951 Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	3.335.544	0,69
GBP	1.040.000 GKN Holdings plc 4.63% 12/05/2032	1.198.588	0,25	GBP	672.347 Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	991.151	0,20
GBP	500.000 Heathrow Finance plc 3.88% 01/03/2027	566.080	0,12	GBP	507.647 Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	741.837	0,15
EUR	100.000 Ineos Finance plc 2.13% 15/11/2025	97.725	0,02	GBP	995.000 Travis Perkins 4.50% 07/09/2023	1.190.526	0,25
EUR	2.150.000 Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	2.129.560	0,44	EUR	1.693.000 Victoria plc 5.25% 15/07/2024	1.745.786	0,36
EUR	1.511.000 International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	1.512.877	0,31	EUR	1.615.000 Virgin Media Finance plc 4.50% 15/01/2025	1.669.257	0,34
EUR	816.000 International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	883.086	0,18	GBP	1.483.000 Virgin Media Secured Finance plc 4.88% 15/01/2027	1.747.471	0,36
EUR	1.297.000 International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	1.381.776	0,28	GBP	1.190.000 Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	1.419.208	0,29
EUR	870.000 International Game Technology plc 4.75% 15/02/2023	962.651	0,20	GBP	1.847.000 Virgin Media Secured Finance plc 5.13% 15/01/2025	2.163.066	0,44
GBP	3.623.000 Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	4.123.127	0,85	GBP	1.168.000 Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	1.420.215	0,29
GBP	2.926.000 Jaguar Land Rover 3.88% 01/03/2023	2.917.372	0,60	EUR	2.676.000 Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	2.837.519	0,58
				EUR	910.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	1.039.897	0,21

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen					
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN					
GBP	436.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	524.494	0,11	USD	275.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 5.00% 15/07/2027	262.180	0,05
USD	2.135.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	2.118.033	0,43	USD	691.000	Cott Holdings Inc. 5.50% 01/04/2025	658.140	0,14
USD	1.403.000	Vodafone Group plc FRN 04/04/2079	1.483.471	0,30			Summe Vereinigte Staaten	920.320	0,19
GBP	605.000	William Hill plc 4.75% 01/05/2026	709.458	0,15			Summe Anleihen	920.320	0,19
GBP	1.932.000	William Hill plc 4.88% 07/09/2023	2.344.521	0,48			Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt	920.320	0,19
		Summe Vereinigtes Königreich	84.126.164	17,27					
VEREINIGTE STAATEN				Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
EUR	4.031.000	Avantor Inc. 4.75% 01/10/2024	4.316.951	0,89	Anleihen				
EUR	604.000	Ball Corp 3.50% 15/12/2020	629.925	0,13	NIEDERLANDE				
EUR	1.352.000	Ball Corp. 4.38% 15/12/2023	1.576.235	0,32	EUR	2.866.497	Boats Investments Netherlands BV 11.00% 23/09/2099	967.443	0,20
EUR	2.597.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 4.75% 15/12/2024	2.682.576	0,55	USD	111.070	OSX 3 Leasing BV 0.00% 31/12/2050	0	0,00
EUR	1.473.000	Cemex Finance LLC 4.63% 15/06/2024	1.550.214	0,32	USD	111.070	OSX 3 Leasing BV 0.00% 31/12/2050	0	0,00
EUR	1.386.000	Colfax Corp. 3.25% 15/05/2025	1.428.797	0,29	USD	3.068.649	OSX 3 Leasing BV 13.00% 20/03/2027	731.837	0,15
EUR	3.403.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	3.534.538	0,73			Summe Niederlande	1.699.280	0,35
EUR	4.532.000	Equinix Inc. 2.88% 01/02/2026	4.731.242	0,96	PORTUGAL				
USD	1.064.000	Equinix Inc. 5.38% 15/05/2027	1.052.825	0,22	EUR	1.000.000	Banco Espirito Santo SA 2.63% 31/12/2049	257.685	0,05
EUR	2.696.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	2.752.532	0,57	EUR	6.900.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2020	1.440.548	0,30
EUR	4.941.000	IQVIA Inc. 3.25% 15/03/2025	5.076.322	1,04	EUR	1.400.000	Banco Espirito Santo SA 4.75% 15/01/2020	378.651	0,08
EUR	3.836.000	IQVIA Inc. 3.50% 15/10/2024	3.916.189	0,80			Summe Portugal	2.076.884	0,43
EUR	647.000	Iron Mountain Inc. 3.00% 15/01/2025	664.575	0,14	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
EUR	1.658.000	Kronos International 3.75% 15/09/2025	1.661.109	0,34	GBP	1.464.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	1.690.678	0,35
EUR	4.379.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	4.657.394	0,95			Summe Vereinigtes Königreich	1.690.678	0,35
EUR	2.708.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	2.878.929	0,59			Summe Anleihen	5.466.842	1,13
EUR	3.278.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	3.653.375	0,75					
EUR	2.684.000	Refinitiv US Holdings Inc. 4.50% 15/05/2026	2.897.210	0,59					
EUR	2.057.000	Refinitiv US Holdings Inc. 6.88% 15/11/2026	2.307.879	0,47					
EUR	2.503.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	2.571.664	0,53					
EUR	3.655.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	3.865.276	0,79					
EUR	2.031.000	UGI International LLC 3.25% 01/11/2025	2.154.274	0,44					
		Summe Vereinigte Staaten	60.560.031	12,41					
Summe Anleihen			450.607.167	92,52					
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			450.607.167	92,52					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)			
Aktien			
VEREINIGTES KÖNIGREICH			
434	Nv Profit Share Limited	0	0,00
	Summe Vereinigtes Königreich	0	0,00
	Summe Aktien	0	0,00
	Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	5.466.842	1,13
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
IRLAND			
4.003.918	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	4.525.801	0,93
113.763	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	11.347.399	2,33
	Summe Irland	15.873.200	3,26
	Summe Fonds	15.873.200	3,26
	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	15.873.200	3,26
	Wert der Anlagen insgesamt	472.867.529	97,10
(Gesamtkosten: EUR 462.095.676)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts				
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)							
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)							
ÖSTERREICH				DEUTSCHLAND							
EUR	100.000	Sappi Papier Holding GmbH 4.00% 01/04/2023	102.081	0,27	EUR	100.000	Adler Real Estate AG 1.50% 06/12/2021	101.710	0,27		
		Summe Österreich	102.081	0,27	EUR	200.000	Adler Real Estate AG 1.50% 17/04/2022	201.946	0,53		
KANADA				EUR				400.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	407.084	1,08
EUR	320.000	Bausch Health Cos Inc. 4.50% 15/05/2023	324.159	0,86	EUR	220.000	Demire Deutsche Mittelstand Real Estate AG 2.88% 15/07/2022	223.376	0,59		
EUR	100.000	Bombardier Inc. 6.13% 15/05/2021	106.500	0,28	EUR	480.000	Douglas GmbH 6.25% 15/07/2022	481.846	1,27		
EUR	200.000	Cott Corp. 5.50% 01/07/2024	208.849	0,55	EUR	200.000	Platin 1426 GmbH 5.38% 15/06/2023	188.457	0,50		
		Summe Kanada	639.508	1,69	EUR	180.000	Safari Verwaltungs GmbH 5.38% 30/11/2022	116.435	0,31		
KAIMANINSELN				EUR				220.000	Thyssenkrupp AG 1.38% 03/03/2022	219.495	0,58
EUR	280.000	Petrobras International Finance Company 5.88% 07/03/2022	318.298	0,84	EUR	91.000	Thyssenkrupp AG 1.88% 06/03/2023	91.095	0,24		
		Summe Kaimaninseln	318.298	0,84	EUR	133.000	Thyssenkrupp AG 2.75% 08/03/2021	136.342	0,36		
DÄNEMARK				EUR				190.000	Wepa Hygieneprodukte GmbH 3.75% 15/05/2024	193.973	0,51
EUR	340.000	TDC A/S 5.00% 02/03/2022	375.979	0,99			Summe Deutschland	2.361.759	6,24		
		Summe Dänemark	375.979	0,99	IRLAND						
FINNLAND				EUR				580.000	Ardagh Packaging Finance plc 4.13% 15/05/2023	593.347	1,57
EUR	420.000	Nokia Oyj 1.00% 15/03/2021	425.840	1,13	EUR	100.000	Smurfit Kappa Acquisitions 2.38% 01/02/2024	108.181	0,29		
		Summe Finnland	425.840	1,13	EUR	200.000	Smurfit Kappa Acquisitions 4.13% 30/01/2020	202.976	0,53		
FRANKREICH				EUR				100.000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 3.25% 01/06/2021	104.637	0,28
EUR	124.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	126.067	0,33	GBP	630.000	Virgin Media Receivables Financing Notes II DAC 5.75% 15/04/2023	732.022	1,94		
EUR	270.000	Altice France SA 5.63% 15/05/2024	278.708	0,74			Summe Irland	1.741.163	4,61		
EUR	300.000	Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	277.963	0,73	ISLE OF MAN						
EUR	100.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.98% 26/05/2021	102.987	0,27	EUR	210.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	219.576	0,58		
EUR	350.000	Crown European Holdings 4.00% 15/07/2022	382.797	1,01			Summe Isle of Man	219.576	0,58		
EUR	100.000	Crown European Holdings SA 2.25% 01/02/2023	105.650	0,28							
EUR	400.000	Elis SA 1.88% 15/02/2023	415.347	1,10							
EUR	220.000	Faurecia SE 3.63% 15/06/2023	224.348	0,59							
EUR	410.000	Getlink SE 3.63% 01/10/2023	428.648	1,14							
EUR	150.000	La Financiere Atalian SAS 4.00% 15/05/2024	110.808	0,29							
EUR	200.000	Loxam SAS 3.50% 15/04/2022	203.990	0,54							
EUR	100.000	Loxam SAS 3.50% 03/05/2023	101.961	0,27							
EUR	310.000	Rexel SA 2.63% 15/06/2024	317.420	0,84							
EUR	200.000	Spie SA 3.13% 22/03/2024	215.774	0,57							
		Summe Frankreich	3.292.468	8,70							

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
ITALIEN				LUXEMBURG (Fortsetzung)					
EUR	200.000	International Game Technology plc 4.75% 05/03/2020	204.085	0,54	EUR	160.000	Dufry Finance SCA 4.50% 01/08/2023	164.318	0,43
EUR	250.000	Lqj Italia Bondco SpA 3.88% 01/04/2024	283.385	0,75	EUR	125.000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 4.75% 22/03/2021	133.500	0,35
EUR	261.000	Nexi Capital SpA 4.13% 01/11/2023	268.822	0,71	EUR	320.000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 6.75% 14/10/2019	320.690	0,85
EUR	577.000	Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	607.654	1,61	EUR	220.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.50% 01/08/2022	210.232	0,56
		Summe Italien	1.363.946	3,61	EUR	160.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	154.744	0,41
					EUR	185.000	Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/02/2022	189.576	0,50
JAPAN					EUR	250.000	Leonardo SpA 5.25% 21/01/2022	279.065	0,74
EUR	430.000	SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	461.691	1,22	GBP	300.000	Leonardo SpA 8.00% 16/12/2019	343.635	0,91
EUR	125.000	Softbank Group Corp. 4.00% 30/07/2022	134.733	0,36	EUR	250.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	259.327	0,69
		Summe Japan	596.424	1,58	EUR	200.000	Swissport Financing Sarl 5.25% 15/08/2024	207.796	0,55
					EUR	100.000	Takko Luxembourg 2 SCA 5.38% 15/11/2023	95.432	0,25
JERSEY - KANALINSELN							Summe Luxemburg	4.469.299	11,82
EUR	399.570	Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	416.967	1,10					
		Summe Jersey - Kanalinseln	416.967	1,10					
LUXEMBURG				NIEDERLANDE					
EUR	190.000	Altice Financing SA 5.25% 15/02/2023	196.019	0,52	EUR	150.000	Hertz Holdings Netherlands BV 5.50% 30/03/2023	157.344	0,42
USD	200.000	Altice Finco SA 8.13% 15/01/2024	189.775	0,50	GBP	200.000	Intergen NV 7.50% 30/06/2021	224.273	0,59
EUR	248.771	Altice Luxembourg SA 7.25% 15/05/2022	254.171	0,67	EUR	350.000	OI European Group BV 4.88% 31/03/2021	374.205	0,99
EUR	100.000	ARD Finance SA 6.63% 15/09/2023	103.625	0,27	EUR	175.000	OI European Group BV 6.75% 15/09/2020	185.821	0,49
GBP	150.000	B&M European Value Retail SA 4.13% 01/02/2022	172.714	0,46	EUR	160.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 0.38% 25/07/2020	156.116	0,41
EUR	270.000	BMBG Bond Finance SCA 3.00% 15/06/2021	271.843	0,72	EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/03/2023	84.049	0,22
EUR	100.000	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	106.555	0,28	EUR	200.000	United Group BV 4.38% 01/07/2022	204.737	0,54
EUR	200.000	Codere Finance 2 Luxembourg SA 6.75% 01/11/2021	198.064	0,52	EUR	200.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	209.294	0,55
EUR	250.000	CPI Property Group SA 1.45% 14/04/2022	256.082	0,68			Summe Niederlande	1.595.839	4,21
EUR	350.000	Crystal Almond Sarl 10.00% 01/11/2021	362.136	0,96					
					SPANIEN				
					EUR	100.000	Cellnex Telecom SA 3.13% 27/07/2022	108.212	0,29
					EUR	224.802	NH Hotel Group SA 3.75% 01/10/2023	228.573	0,60
							Summe Spanien	336.785	0,89

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapiieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
SCHWEDEN				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
EUR	556.000	Intrum AB 2.75% 15/07/2022	564.289	1,49	GBP	290.000	Travis Perkins plc 4.38% 15/09/2021	341.384	0,90
EUR	92.500	Intrum AB 2.75% 15/07/2022	93.879	0,25	EUR	300.000	Victoria plc 5.25% 15/07/2024	309.354	0,82
		Summe Schweden	658.168	1,74	GBP	190.000	William Hill plc 4.25% 05/06/2020	220.366	0,58
VEREINIGTES KÖNIGREICH				Summe Vereinigtes Königreich					
EUR	200.000	Algeco Global Finance plc 6.50% 15/02/2023	201.775	0,53			8.969.347	23,73	
GBP	300.000	Ardonagh Midco 3 Plc 8.38% 15/07/2023	326.622	0,86	VEREINIGTE STAATEN				
GBP	265.000	Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	320.553	0,85	EUR	260.000	Ball Corp 3.50% 15/12/2020	271.160	0,72
GBP	400.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	476.792	1,27	EUR	100.000	Ball Corp. 4.38% 15/12/2023	116.585	0,31
GBP	290.000	Drax Finco plc 4.25% 01/05/2022	333.767	0,88	EUR	200.000	Cemex Finance LLC 4.63% 15/06/2024	210.484	0,56
EUR	450.000	EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	455.707	1,21	EUR	310.000	Equinix Inc. 2.88% 15/03/2024	322.379	0,85
GBP	234.000	EI Group plc 6.38% 15/02/2022	271.974	0,72	EUR	100.000	MPT Operating Partnership LP 4.00% 19/08/2022	109.752	0,29
GBP	150.000	EI Group plc 6.88% 15/02/2021	174.780	0,46	USD	760.000	Netflix Inc. 5.50% 15/02/2022	740.254	1,96
USD	446.809	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	338.631	0,90			Summe Vereinigte Staaten	1.770.614	4,69
EUR	350.000	FCE Bank plc 1.88% 24/06/2021	357.714	0,95	Summe Anleihen				
GBP	580.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	712.361	1,88			29.654.061	78,42	
GBP	100.000	Heathrow Finance plc 4.75% 01/03/2024	120.876	0,32	Wandelanleihen				
EUR	445.000	International Game Technology plc 4.75% 15/02/2023	492.390	1,30	ITALIEN				
GBP	110.000	Jaguar Land Rover 3.88% 01/03/2023	109.676	0,29	EUR	100.000	Telecom Italia SpA 1.13% 26/03/2022	100.825	0,27
GBP	500.000	Kelda Finance (Nb.3) 5.75% 17/02/2020	570.039	1,51			Summe Italien	100.825	0,27
GBP	500.300	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 16/09/2022	596.267	1,58	JERSEY - KANALINSELN				
EUR	360.000	Merlin Entertainments plc 2.75% 15/03/2022	383.025	1,01	GBP	500.000	British Land White 2015 Limited 0.00% 09/06/2020	558.992	1,47
EUR	450.000	OTE plc 2.38% 18/07/2022	476.879	1,26			Summe Jersey - Kanalinseln	558.992	1,47
EUR	100.000	OTE plc 4.38% 02/12/2019	100.725	0,27	Summe Wandelanleihen				
GBP	150.000	Stonegate Pub Company Financing plc 4.88% 15/03/2022	173.929	0,46			659.817	1,74	
GBP	175.000	Stonegate Pub Company Financing plc FRN 15/03/2022	200.193	0,53	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				
EUR	320.000	Synlab Unsecured Bondco plc 8.25% 01/07/2023	334.741	0,89			30.313.878	80,16	
GBP	350.000	TalkTalk Telecom Group plc 5.38% 15/01/2022	405.708	1,07					
EUR	160.000	Travelex Financing plc 8.00% 15/05/2022	163.119	0,43					

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
IRLAND			
13.022	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	1.298.839	3,43
	Summe Irland	1.298.839	3,43
	Summe Fonds	1.298.839	3,43
	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	1.298.839	3,43
	Wert der Anlagen insgesamt	31.612.717	83,59
	(Gesamtkosten: EUR 31.661.614)		

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
AUSTRALIEN				FRANKREICH (Fortsetzung)					
EUR	300.000	National Australia Bank Limited 0.35% 07/09/2022	304.230	0,44	EUR	700.000	CNP Assurances 1.88% 20/10/2022	737.521	1,09
		Summe Australien	304.230	0,44	EUR	500.000	Credit Agricole Assurances SA Perp FRN	550.448	0,80
ÖSTERREICH				EUR 100.000 Credit Agricole Home Loan SFH SA 0.88% 06/05/2034				111.256	0,16
EUR	600.000	Kommunalkredit Austria AG 0.38% 12/07/2021	605.491	0,88	EUR	400.000	Credit Agricole SA 0.75% 05/12/2023	413.046	0,60
EUR	700.000	Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 07/12/2026	763.162	1,11	EUR	300.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	320.039	0,47
		Summe Österreich	1.368.653	1,99	GBP	100.000	Credit Agricole SA 1.25% 02/10/2024	112.900	0,16
BELGIEN				USD 930.000 Credit Agricole SA Perp FRN				953.288	1,40
EUR	200.000	Bpost SA 1.25% 11/07/2026	213.460	0,31	EUR	700.000	Credit Mutuel Arkea SA 0.38% 03/10/2028	697.008	1,02
EUR	600.000	KBC Group NV 0.88% 27/06/2023	618.720	0,90	EUR	1.000.000	Danone SA 1.00% 26/03/2025	1.055.762	1,54
		Summe Belgien	832.180	1,21	EUR	700.000	La Banque Postale SA 0.25% 12/07/2026	700.752	1,03
KAIMANINSELN				EUR 400.000 La Banque Postale SA 1.38% 24/04/2029				429.397	0,63
GBP	200.000	Dwr Cymru Financing Limited 6.02% 31/03/2028	313.221	0,46	GBP	300.000	Orange SA 3.25% 15/01/2032	384.972	0,56
		Summe Kaimaninseln	313.221	0,46	GBP	465.000	Orange SA Perp FRN	573.243	0,84
DÄNEMARK				EUR 200.000 Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025				188.225	0,27
EUR	310.000	ISS Global A/S 2.13% 02/12/2024	338.823	0,49	EUR	800.000	RATP 0.88% 25/05/2027	865.577	1,27
EUR	200.000	Nykredit Realkredit A/S 0.88% 17/01/2024	205.242	0,30	EUR	200.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.88% 23/10/2037	239.688	0,35
EUR	200.000	Orsted A/S 1.50% 26/11/2029	223.777	0,33	EUR	100.000	Schneider Electric SE 1.84% 13/10/2025	111.039	0,16
GBP	308.000	Orsted A/S 2.13% 17/05/2027	368.639	0,54	EUR	200.000	SNCF Reseau 0.88% 22/01/2029	215.684	0,31
EUR	465.000	Orsted A/S Perp FRN	492.551	0,72	EUR	400.000	SNCF Reseau 2.25% 20/12/2047	544.883	0,80
GBP	259.000	Orsted A/S 2.50% 16/05/2033	319.312	0,47	EUR	300.000	Societe Generale SA 0.75% 25/11/2020	303.655	0,44
		Summe Dänemark	1.948.344	2,85	EUR	465.000	Unibail-Rodamco 1.00% 14/03/2025	489.262	0,71
FRANKREICH				EUR 600.000 Unibail-Rodamco SE Perp FRN				637.871	0,93
EUR	400.000	Axa SA FRN 28/05/2049	453.764	0,66			Summe Frankreich	15.188.438	22,19
EUR	300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 08/06/2026	310.724	0,45	DEUTSCHLAND				
GBP	100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.50% 07/10/2026	112.431	0,16	EUR	525.000	Bayerische Landesbodenkreditanstalt 0.63% 22/11/2027	566.454	0,83
GBP	500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.75% 19/12/2024	577.956	0,84	EUR	300.000	Deutsche Apotheker- und Aerztebank 0.15% 07/03/2023	306.757	0,45
EUR	400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.88% 18/06/2029	431.057	0,63	EUR	400.000	Deutsche Kreditbank AG 0.88% 02/10/2028	439.080	0,64
EUR	200.000	BNP Paribas 0.50% 01/06/2022	203.913	0,30					
EUR	583.000	BNP Paribas 1.00% 17/04/2024	605.306	0,88					
EUR	800.000	BPCE SA 0.63% 26/09/2023	821.537	1,21					
EUR	900.000	BPCE SA 2.88% 22/04/2026	1.036.234	1,52					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
SPANIEN				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
EUR	800.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 1.38% 14/05/2025	850.853	1,25	GBP	182.000	Wellcome Trust Finance plc 4.75% 28/05/2021	218.826	0,32
EUR	200.000	CaixaBank SA 0.63% 01/10/2024	200.442	0,29	EUR	546.000	WellCome Trust Limited 1.13% 21/01/2027	591.640	0,87
EUR	200.000	Iberdrola Finanzas SA 1.25% 28/10/2026	215.881	0,32	GBP	115.000	Western Power Distribution South Wales plc 9.25% 09/11/2020	141.350	0,21
EUR	200.000	NorteGas Energia Distribucion 0.92% 28/09/2022	204.701	0,30	GBP	200.000	Yorkshire Building Society FRN 18/04/2025	231.872	0,34
EUR	600.000	Telefonica Emisiones SA 1.07% 05/02/2024	624.021	0,91					
		Summe Spanien	2.095.898	3,07			Summe Vereinigtes Königreich	4.493.052	6,56
SUPRANATIONAL				VEREINIGTE STAATEN					
GBP	25.000	International Finance Corp 1.25% 15/12/2023	29.004	0,04	EUR	365.000	Becton Dickinson and Company 1.40% 24/05/2023	379.372	0,56
		Summe Supranational	29.004	0,04			Summe Vereinigte Staaten	379.372	0,56
SCHWEDEN				Summe Anleihen					
EUR	1.158.000	Akelius Residential 1.13% 14/03/2024	1.191.642	1,75			44.603.612	65,14	
EUR	400.000	Essity AB 1.13% 27/03/2024	417.892	0,61	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
EUR	100.000	Nordea Bank AB 0.30% 30/06/2022	101.305	0,15	BELGIEN				
		Summe Schweden	1.710.839	2,51	EUR	625.000	Belgium (Govt of) 1.25% 22/04/2033	738.091	1,07
VEREINIGTES KÖNIGREICH				FINNLAND					
GBP	100.000	Accent Capital plc 2.63% 18/07/2049	124.181	0,18	EUR	400.000	Municipality Finance plc 0.05% 06/09/2029	411.684	0,60
GBP	546.000	Anglian Water Services Financing plc 1.63% 10/08/2025	628.863	0,92			Summe Finnland	411.684	0,60
GBP	100.000	British Telecommunications plc 5.75% 07/12/2028	146.965	0,21	FRANKREICH				
GBP	200.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	256.421	0,37	EUR	400.000	Agence Francaise de Developpement 0.50% 31/10/2025	418.856	0,61
USD	730.000	HSBC Holdings plc FRN 22/11/2023	679.384	0,99	EUR	400.000	Caisse des Depots et Consignations 0.00% 19/06/2024	409.555	0,60
EUR	546.000	Motability Operation 0.88% 14/03/2025	569.885	0,83	EUR	400.000	Caisse Francaise de Financement Local 0.50% 19/02/2027	422.976	0,62
EUR	524.000	Motability Operations Group plc 0.38% 03/01/2026	526.096	0,77	EUR	1.000.000	City of Paris France 1.38% 20/11/2034	1.172.923	1,71
EUR	100.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	99.491	0,15					
GBP	40.000	Retail Charity Bonds plc 5.00% 12/04/2026	50.392	0,07					
GBP	200.000	Scottish Hydro Electric Transmission plc 2.25% 27/09/2035	227.686	0,33					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
FRANKREICH (Fortsetzung)				NIEDERLANDE (Fortsetzung)					
EUR	100.000	France (Govt of) OAT 1.75% 25/06/2039	129.905	0,19	EUR	365.000	Niederlandse Waterschapsbank NV 0.13% 28/05/2027	377.996	0,55
EUR	100.000	Ile de France (Region of) 0.50% 14/06/2025	105.180	0,15	EUR	150.000	Niederlandse Waterschapsbank NV 0.25% 07/06/2024	155.457	0,23
EUR	700.000	Ile de France (Region of) 3.63% 27/03/2024	829.652	1,21	EUR	450.000	Niederlandse Waterschapsbank NV 1.50% 15/06/2039	558.121	0,81
EUR	200.000	Unedic Asseo 1.25% 25/05/2033	232.339	0,34	EUR	250.000	Netherlands (Govt of) 0.50% 15/01/2040	281.893	0,41
Summe Frankreich			3.721.386	5,43	Summe Niederlande			2.007.712	2,93
DEUTSCHLAND				POLEN					
EUR	284.000	Free and Hanseatic City of Hamburg 1.45% 05/11/2038	350.153	0,51	EUR	400.000	Poland (Govt of) 1.13% 07/08/2026	436.823	0,64
EUR	200.000	Investitionsbank Schleswig- Holstein 0.50% 13/06/2025	210.656	0,31	Summe Polen			436.823	0,64
GBP	100.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.88% 15/09/2026	114.612	0,17	SPANIEN				
EUR	300.000	Land Berlin 0.63% 15/07/2039	324.457	0,47	EUR	821.000	Autonomous Community of Madrid 0.75% 30/04/2022	843.650	1,23
EUR	600.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.25% 15/07/2024	623.232	0,91	EUR	1.000.000	Autonomous Community of Madrid 1.57% 30/04/2029	1.123.036	1,65
EUR	511.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.38% 14/02/2028	543.033	0,79	EUR	60.000	Basque (Government) 1.13% 30/04/2029	65.337	0,10
EUR	182.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.50% 28/02/2029	196.324	0,29	EUR	894.000	Instituto de Credito Oficial 0.10% 30/07/2021	902.370	1,31
EUR	830.000	Nordrhein-Westfalen Land 0.95% 13/03/2028	919.739	1,34	EUR	450.000	Instituto de Credito Oficial 0.75% 31/10/2023	469.213	0,69
EUR	128.000	NRW. Bank 0.88% 10/11/2025	138.348	0,20	Summe Spanien			3.403.606	4,98
EUR	92.000	State of Lower Saxony 0.88% 25/10/2028	101.677	0,15	SUPRANATIONAL				
Summe Deutschland			3.522.231	5,14	EUR	930.000	African Development Bank 0.25% 21/11/2024	966.689	1,41
IRLAND				IRLAND					
EUR	585.000	Ireland (Govt of) 1.35% 18/03/2031	668.246	0,98	EUR	875.000	Council of Europe 0.38% 27/03/2025	917.866	1,34
Summe Irland			668.246	0,98	EUR	201.000	Council of Europe Development Bank 0.13% 10/04/2024	207.405	0,30
ITALIEN				ITALIEN					
EUR	1.300.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 0.75% 21/11/2022	1.327.049	1,94	EUR	1.265.000	European Investment Bank 0.38% 15/05/2026	1.339.437	1,96
EUR	500.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.13% 21/03/2026	547.973	0,80	GBP	500.000	European Investment Bank 0.75% 15/11/2024	568.494	0,84
Summe Italien			1.875.022	2,74	USD	325.000	Inter-American Development Bank 3.00% 26/09/2022	308.688	0,45
NIEDERLANDE				NIEDERLANDE					
EUR	207.000	Bank Nederlandse Gemeenten NV 0.05% 13/07/2024	212.775	0,31	USD	100.000	Inter-American Investment Corp. 1.75% 02/10/2024	91.521	0,13
GBP	365.000	Deutsche Bahn Finance BV 1.38% 07/07/2025	421.470	0,62	USD	195.000	Inter-American Investment Corp. FRN 12/10/2021	178.915	0,26

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)				
SUPRANATIONAL (Fortsetzung)				
EUR	392.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.25% 21/05/2029	413.847	0,60
USD	329.000	International Finance Corp. 1.75% 30/03/2020	301.405	0,44
		Summe Supranational	5.294.267	7,73
		Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	22.663.794	33,09
		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	67.267.406	98,23
		Wert der Anlagen insgesamt	67.267.406	98,23
(Gesamtkosten: EUR 64.702.457)				

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapiieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
AUSTRALIEN				FRANKREICH					
EUR	1.390.000	APT Pipelines Limited 2.00% 22/03/2027	1.521.766	1,15	EUR	124.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	126.067	0,09
GBP	160.000	APT Pipelines Limited 4.25% 26/11/2024	204.848	0,15	EUR	325.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	330.845	0,25
EUR	840.000	Aurizon Network Pty Limited 3.13% 01/06/2026	975.023	0,73	EUR	601.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	666.828	0,50
EUR	715.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	750.715	0,56	EUR	1.300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 08/06/2026	1.346.473	1,02
EUR	417.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	436.841	0,33	EUR	100.000	Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	92.654	0,07
GBP	400.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023	506.777	0,38	EUR	100.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.56% 25/01/2023	95.653	0,07
		Summe Australien	4.395.970	3,30	EUR	100.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.98% 26/05/2021	102.987	0,08
					EUR	100.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	93.592	0,07
BELGIEN				FRANKREICH (Fortsetzung)					
EUR	160.000	Anheuser-Busch Inbev SA 2.00% 23/01/2035	185.046	0,14	EUR	1.100.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	1.173.475	0,88
GBP	830.000	Anheuser-Busch InBev SA 2.25% 24/05/2029	979.411	0,74	GBP	170.000	Credit Agricole SA FRN 31/12/2049	226.266	0,17
EUR	500.000	Belfius Bank SA 0.00% 28/08/2026	493.745	0,37	EUR	800.000	Credit Mutuel Arkea SA 1.13% 23/05/2029	849.933	0,64
EUR	231.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	237.052	0,18	EUR	500.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	500.085	0,37
EUR	200.000	KBC Group NV Perp FRN	213.972	0,16	EUR	100.000	Elis SA 1.63% 03/04/2028	100.109	0,08
		Summe Belgien	2.109.226	1,59	EUR	600.000	HSBC France SA 0.10% 03/09/2027	594.159	0,45
					EUR	100.000	Louvre Bidco SAS 4.25% 30/09/2024	101.965	0,08
BERMUDAS				FRANKREICH (Fortsetzung)					
EUR	900.000	Bacardi Limited 2.75% 03/07/2023	975.062	0,73	EUR	1.400.000	Orange SA 0.00% 04/09/2026	1.381.236	1,05
		Summe Bermudas	975.062	0,73	EUR	270.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	254.103	0,19
							Summe Frankreich	8.036.430	6,06
KAIMANINSELN				DEUTSCHLAND					
USD	633.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	632.199	0,48	EUR	700.000	ADLER Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	712.397	0,54
		Summe Kaimaninseln	632.199	0,48	EUR	200.000	ADLER Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	212.229	0,16
DÄNEMARK				DEUTSCHLAND (Fortsetzung)					
EUR	250.000	Danske Bank A/S 0.75% 02/06/2023	256.394	0,19	EUR	700.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	693.301	0,52
		Summe Dänemark	256.394	0,19	EUR	865.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	897.307	0,67
FINNLAND				DEUTSCHLAND (Fortsetzung)					
EUR	222.000	Sampo Oyj FRN 23/05/2049	251.055	0,19	EUR	440.000	Deutsche Bank AG 1.13% 30/08/2023	454.043	0,34
		Summe Finnland	251.055	0,19	EUR	182.000	Douglas GmbH 6.25% 15/07/2022	182.700	0,14
					EUR	100.000	Eurogrid GmbH 1.50% 18/04/2028	109.457	0,08

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
LUXEMBURG (Fortsetzung)				NIEDERLANDE (Fortsetzung)					
EUR	300.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	336.801	0,25	USD	1.774.000	Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	1.721.511	1,30
EUR	615.000	Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/02/2022	630.211	0,47	EUR	300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	310.531	0,23
EUR	180.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	186.348	0,14	EUR	500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	551.321	0,41
EUR	281.000	LSF10 Wolverine Investments SCA 5.00% 15/03/2024	289.384	0,22	EUR	200.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	204.123	0,15
EUR	200.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	204.464	0,15	EUR	600.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	696.605	0,52
USD	380.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	382.177	0,29	EUR	245.000	TenneT Holding BV 0.88% 03/06/2030	257.637	0,19
EUR	1.092.000	Selp Finance Sarl 1.25% 25/10/2023	1.133.755	0,85	EUR	632.000	TenneT Holding BV 2.13% 01/11/2020	647.617	0,49
EUR	400.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	431.497	0,32	EUR	618.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	655.124	0,49
		Summe Luxemburg	9.896.451	7,41	EUR	211.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	220.805	0,17
MEXIKO				NORWEGEN					
EUR	374.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	376.275	0,28	EUR	400.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	523.908	0,39
USD	364.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	347.979	0,26	EUR	500.000	Vonovia Finance BV 0.13% 06/04/2023	501.209	0,38
		Summe Mexiko	724.254	0,54	EUR	400.000	Ziggo Bond Finance BV FRN 15/01/2025	412.580	0,31
NIEDERLANDE				Summe Niederlande					
EUR	352.000	ABN Amro Bank NV 0.50% 15/04/2026	360.416	0,27			13.544.826	10,18	
EUR	700.000	Bayer Capital Corp BV 1.50% 26/06/2026	744.146	0,56	NORWEGEN				
EUR	550.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	585.217	0,44	EUR	650.000	DNB Bank ASA 0.25% 09/04/2024	657.008	0,49
EUR	875.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	908.021	0,68			657.008	0,49	
EUR	486.000	Enexis Holding NV 1.50% 20/10/2023	516.789	0,39	Summe Norwegen				
GBP	570.000	Innogy Finance BV 6.25% 03/06/2030	898.607	0,68			657.008	0,49	
EUR	344.000	LKQ Euro Holdings BV 3.63% 01/04/2026	361.317	0,27	SPANIEN				
USD	667.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	623.791	0,47	EUR	300.000	Abanca Corp Bancaria SA FRN 18/01/2029	323.776	0,24
EUR	1.000.000	RELX Finance BV 0.38% 22/03/2021	1.007.155	0,76	EUR	400.000	Bankia SA FRN 15/02/2029	429.355	0,32
EUR	171.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	197.208	0,15	EUR	800.000	Caixabank SA 1.13% 17/05/2024	833.823	0,63
EUR	604.000	Stedin Holding NV Perp FRN	639.188	0,48	EUR	500.000	Caixabank SA FRN 17/04/2030	515.050	0,39
					EUR	1.166.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	1.266.441	0,95
							3.368.445	2,53	
					SUPRANATIONAL				
					EUR	182.000	Ardagh Packaging Finance plc 2.13% 15/08/2026	187.135	0,14
							187.135	0,14	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)			
BELGIEN				SPANIEN			
EUR	325.000	Kingdom of Belgium (Govt of) 1.70% 22/06/2050		EUR	1.639.000	Spain (Govt of) 1.45% 30/04/2029	
				EUR	485.000	Spain (Govt of) 2.90% 31/10/2046	
		431.885	0,32			1.847.710	1,39
						703.108	0,53
						2.550.818	1,92
		431.885	0,32				
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			
USD	630.000	Dominican Republic (Govt of) 5.95% 25/01/2027				12.198.748	9,17
		625.943	0,47	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			
						123.896.243	93,17
		625.943	0,47	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere			
ÄGYPTEN				Anleihen			
EUR	283.000	Egypt (Govt of) 4.75% 16/04/2026		BERMUDAS			
		290.868	0,22	USD	1.950.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	
				USD	440.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	
		290.868	0,22			1.912.096	1,45
FRANKREICH						440.534	0,33
EUR	700.000	Agence Francaise de Developpement 0.50% 31/10/2025				2.352.630	1,78
EUR	3.000.000	France (Govt of) OAT 1.75% 25/06/2039		DÄNEMARK			
		732.998	0,55	USD	500.000	Danske Bank A/S 2.70% 02/03/2022	
		3.897.141	2,93			461.091	0,35
		4.630.139	3,48			461.091	0,35
ITALIEN				FRANKREICH			
EUR	1.562.000	Italy (Govt of) BPT 2.70% 01/03/2047		USD	1.100.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	
		1.887.332	1,42	USD	420.000	Electricite de France 4.88% 22/01/2044	
		1.887.332	1,42	USD	200.000	Electricite de France SA 4.88% 21/09/2038	
ELFENBEINKÜSTE						1.004.344	0,76
EUR	250.000	Ivory Coast (Govt of) 5.25% 22/03/2030				448.870	0,34
		251.877	0,19			214.986	0,16
		251.877	0,19			1.668.200	1,26
OMAN				ITALIEN			
USD	1.300.000	Oman (Govt of) 6.00% 01/08/2029		USD	400.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	
		1.188.765	0,89			366.859	0,28
		1.188.765	0,89			366.859	0,28
KATAR				NIEDERLANDE			
USD	300.000	Qatar (Govt of) 4.82% 14/03/2049		USD	467.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	
		341.121	0,26			461.815	0,35
		341.121	0,26			461.815	0,35

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN			
USD	700.000 Cott Holdings Inc. 5.50% 01/04/2025	666.712	0,50
	Summe Vereinigte Staaten	666.712	0,50
	Summe Anleihen	5.977.307	4,52
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt			
		5.977.307	4,52
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
Anleihen			
PORTUGAL			
EUR	100.000 Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2020	20.878	0,02
	Summe Portugal	20.878	0,02
VEREINIGTES KÖNIGREICH			
GBP	395.000 Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	456.160	0,33
	Summe Vereinigtes Königreich	456.160	0,33
	Summe Anleihen	477.038	0,35
	Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	477.038	0,35
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
IRLAND			
6.983	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	696.543	0,52
	Summe Irland	696.543	0,52
	Summe Fonds	696.543	0,52
	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	696.543	0,52
	Wert der Anlagen insgesamt	131.047.131	98,56
(Gesamtkosten: EUR 125.381.840)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
ARGENTINIEN				KOLUMBIEN					
USD	195.000	YPF SA 8.50% 28/07/2025	152.315	0,39	USD	255.000	Ecopetrol SA 5.88% 18/09/2023	284.102	0,73
		Summe Argentinien	152.315	0,39			Summe Kolumbien	284.102	0,73
BERMUDAS				HONGKONG					
USD	200.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	204.406	0,52	USD	200.000	CNAC HK Finbridge Company Limited 3.38% 19/06/2024	201.823	0,52
USD	500.000	Li & Fung Limited 4.38% 04/10/2024	500.248	1,28	USD	440.000	CNAC HK Finbridge Company Limited 4.63% 14/03/2023	461.578	1,18
USD	400.000	Ooredoo International Finance Limited 3.25% 21/02/2023	409.265	1,05			Summe Hongkong	663.401	1,70
		Summe Bermudas	1.113.919	2,85					
BRASILIEN				INDIEN					
USD	400.000	Light Servicos de Eletricidade SA 7.25% 03/05/2023	426.700	1,09	USD	500.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	519.932	1,32
USD	800.000	Vale Overseas Limited 6.88% 21/11/2036	1.013.100	2,59	USD	400.000	Delhi International Airport Limited 6.45% 04/06/2029	424.218	1,08
		Summe Brasilien	1.439.800	3,68	USD	500.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	465.190	1,19
					USD	650.000	JSW Steel Limited 4.75% 12/11/2019	650.963	1,66
KAIMANINSELN				INDONESIEN					
USD	450.000	Alibaba Group Holding Limited 4.50% 28/11/2034	514.061	1,32	USD	200.000	JSW Steel Limited 5.25% 13/04/2022	202.304	0,52
USD	200.000	China Overseas Finance Cayman VII Limited 4.25% 26/04/2023	209.977	0,54	USD	500.000	ReNew Power Limited 6.45% 27/09/2022	505.682	1,29
USD	700.000	Chn Aoyuan Group Limited 6.35% 11/01/2020	702.456	1,80			Summe Indien	2.768.289	7,06
USD	400.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	412.511	1,05	USD	314.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.76% 15/11/2048	407.324	1,04
USD	743.000	Comunicaciones Celulares SA Via Comcel Trust 6.88% 06/02/2024	767.679	1,95	USD	398.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	400.764	1,03
USD	1.000.000	Lenovo Perpetual Securities Limited FRN	983.750	2,52			Summe Indonesien	808.088	2,07
USD	500.000	Longfor Group Holdings Limited 3.95% 16/09/2029	490.516	1,25	IRLAND				
USD	400.000	MGM China Holdings Limited 5.38% 15/05/2024	413.997	1,06	USD	350.000	Gazprom Neft OAO Via GPN Capital SA 6.00% 27/11/2023	388.856	0,99
USD	355.000	Mumtalakat Sukuk Holding Company 5.63% 27/02/2024	370.801	0,95	USD	288.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3.95% 24/04/2023	295.875	0,76
USD	400.000	Sands China Limited 5.40% 08/08/2028	451.742	1,16			Summe Irland	684.731	1,75
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 4.53% 11/04/2049	239.500	0,61	KASACHSTAN				
		Summe Kaimaninseln	5.556.990	14,21	USD	350.000	KazMunayGas National Company JSC 6.38% 24/10/2048	436.690	1,12
							Summe Kasachstan	436.690	1,12

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
LUXEMBURG				MAROKKO					
USD	630.000	Gaz Capital for Gazprom OAO 6.51% 07/03/2022	686.179	1,75	USD	557.000	OCP SA 6.88% 25/04/2044	692.768	1,76
USD	680.000	Gazprom OAO via Gaz Capital SA 6.00% 23/01/2021	711.380	1,81	Summe Marokko				
USD	400.000	MHP SE 7.75% 10/05/2024	429.978	1,10	NIEDERLANDE				
USD	405.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	444.061	1,14	USD	375.000	Equate Petrochemical BV 3.00% 03/03/2022	377.470	0,97
USD	351.000	Rumo Luxembourg Sarl 5.88% 18/01/2025	371.975	0,95	USD	500.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	509.788	1,30
Summe Luxemburg			2.643.573	6,75	USD	524.000	Petrobras Global Finance BV 5.75% 01/02/2029	577.579	1,48
MALAYSIA				PERU					
USD	442.000	Press Metal Labuan Limited 4.80% 30/10/2022	425.692	1,09	USD	650.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 2.80% 21/07/2023	526.094	1,35
Summe Malaysia			425.692	1,09	Summe Niederlande				
MAURITIUS				PERU					
USD	400.000	Azure Power Solar Energy Pvt Limited 5.65% 24/12/2024	401.000	1,03	USD	200.000	Hunt Oil Company of Peru LLC Sucursal del Peru 6.38% 01/06/2028	224.149	0,57
USD	400.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	400.483	1,02	USD	891.000	Inretail Pharma SA 5.38% 02/05/2023	936.106	2,39
USD	530.000	HTA Group Limited 9.13% 08/03/2022	554.022	1,42	USD	500.000	Volcan Compania Minera SAA 5.38% 02/02/2022	516.438	1,33
Summe Mauritius			1.355.505	3,47	Summe Peru				
MEXIKO				SÜDKOREA					
USD	500.000	BBVA Bancomer SA FRN 13/09/2034	500.625	1,28	USD	200.000	SK Hynix Inc. 3.00% 17/09/2024	199.416	0,51
USD	400.000	Cemex SAB De CV 7.75% 16/04/2026	435.250	1,11	Summe Südkorea				
USD	400.000	Elementia SAB de CV 5.50% 15/01/2025	390.982	1,00	SINGAPUR				
USD	237.000	Gruma SAB de CV 4.88% 01/12/2024	257.030	0,66	USD	200.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	213.033	0,54
USD	512.000	Grupo Posadas SAB de CV 7.88% 30/06/2022	513.216	1,31	USD	220.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	163.833	0,42
USD	400.000	Petroleos Mexicanos 6.38% 23/01/2045	372.714	0,95	USD	500.000	Golden Legacy Pte Limited 6.88% 27/03/2024	508.435	1,30
USD	200.000	Petroleos Mexicanos 6.50% 23/01/2029	203.391	0,52	USD	200.000	Medco Oak Tree Pte Limited 7.38% 14/05/2026	202.371	0,52
USD	300.000	Petroleos Mexicanos 6.75% 21/09/2047	287.513	0,74	USD	250.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 2.38% 28/08/2029	242.060	0,62
Summe Mexiko			2.960.721	7,57	Summe Singapur				
					1.329.732				
					3,40				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts				
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)							
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)							
SÜDAFRIKA				BRITISCHE JUNGFERINSELN (Fortsetzung)							
USD	494.000	Transnet SOC Limited 4.00% 26/07/2022	499.249	1,28	USD	500.000	Hysan MTN Limited 2.82% 04/09/2029	483.758	1,24		
		Summe Südafrika	499.249	1,28	USD	500.000	Shanghai Port Group BVI Development Company Limited 3.38% 18/06/2029	517.136	1,32		
THAILAND				USD				500.000	Sinopec Group Overseas Development 2017 Limited 3.25% 13/09/2027	514.032	1,31
USD	700.000	Bangkok Bank pcl FRN 25/09/2034	709.377	1,82	USD	200.000	Studio City Company Limited 7.25% 30/11/2021	204.022	0,52		
USD	200.000	Kasikornbank pcl FRN 02/10/2031	200.343	0,51	USD	250.000	Studio City Finance Limited 7.25% 11/02/2024	263.722	0,67		
		Summe Thailand	909.720	2,33			Summe Britische Jungferinseln	3.222.208	8,23		
TÜRKEI				Summe Anleihen				35.474.908	90,69		
USD	380.000	KOC Holding AS 6.50% 11/03/2025	389.834	0,99	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente						
USD	300.000	Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS 5.88% 12/08/2020	300.750	0,77	ARGENTINIEN						
USD	387.000	Türkiye Garanti Bankası AS 5.88% 16/03/2023	389.841	1,00	USD	1.500.000	Argentina (Govt of) 4.63% 11/01/2023	628.124	1,61		
		Summe Türkei	1.080.425	2,76			Summe Argentinien	628.124	1,61		
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				DOMINIKANISCHE REPUBLIK							
USD	385.000	Emirates NBD PJSC Perp FRN	404.595	1,03	USD	151.000	Dominican (Govt) 6.40% 05/06/2049	161.247	0,41		
		Summe Vereinigte Arabische Emirate	404.595	1,03			Summe Dominikanische Republik	161.247	0,41		
VEREINIGTES KÖNIGREICH				KATAR							
USD	500.000	Liquid Telecommunications Financing plc 8.50% 13/07/2022	495.504	1,27	USD	350.000	Qatar (Govt of) 4.00% 14/03/2029	388.252	0,99		
USD	374.000	MARB BondCo plc 6.88% 19/01/2025	391.251	1,00			Summe Katar	388.252	0,99		
USD	380.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	388.550	0,99	SÜDAFRIKA						
USD	400.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	369.418	0,94	USD	780.000	Eskom Holdings Limited 5.75% 26/01/2021	788.775	2,02		
		Summe Vereinigtes Königreich	1.644.723	4,20			Summe Südafrika	788.775	2,02		
BRITISCHE JUNGFERINSELN				Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				1.966.398	5,03		
USD	250.000	CNOOC Finance 2013 Limited 2.88% 30/09/2029	249.285	0,64	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung						
USD	250.000	ENN Clean Energy International Investment Limited 7.50% 27/02/2021	257.813	0,66			37.441.306	95,72			
USD	400.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	423.234	1,08							
USD	311.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	309.206	0,79							

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
IRLAND			
1.214.498	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	1.214.498	3,11
	Summe Irland	1.214.498	3,11
	Summe Fonds	1.214.498	3,11
	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	1.214.498	3,11
	Wert der Anlagen insgesamt	38.655.804	98,83
(Gesamtkosten: USD 37.639.988)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)						
KAIMANINSELN				MAROKKO						
USD	250.000	Alibaba Group Holding Limited 4.50% 28/11/2034	285.589	0,52	USD	250.000	OCP SA 6.88% 25/04/2044	310.938	0,57	
USD	200.000	CK Hutchison International 19 II Limited 3.38% 06/09/2049	202.520	0,37	Summe Marokko					
USD	1.000.000	Lenovo Perpetual Securities Limited FRN	983.750	1,80	NIEDERLANDE					
Summe Kaimaninseln				1.471.859	2,69	USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	254.894	0,47
INDONESIEN				SAUDI-ARABIEN						
USD	375.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.76% 15/11/2048	486.454	0,89	USD	810.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	859.623	1,57	
Summe Indonesien				486.454	0,89	USD	250.000	Syngenta Finance NV 5.68% 24/04/2048	260.434	0,48
KASACHSTAN				Summe Niederlande						
USD	567.000	KazMunayGas National Company JSC 5.38% 24/04/2030	636.812	1,17	1.374.951					
Summe Kasachstan				636.812	1,17	2,52				
LUXEMBURG				SINGAPUR						
USD	565.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	619.492	1,14	USD	340.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	253.196	0,46	
Summe Luxemburg				619.492	1,14	USD	300.000	Golden Legacy Pte Limited 6.88% 27/03/2024	305.061	0,56
MEXIKO				SÜDAFRIKA						
USD	400.000	Cemex SAB De CV 7.75% 16/04/2026	435.250	0,80	USD	220.000	Medco Oak Tree Pte Limited 7.38% 14/05/2026	222.608	0,41	
USD	400.000	Elementia SAB de CV 5.50% 15/01/2025	390.982	0,72	Summe Singapur					
USD	350.000	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/01/2025	343.882	0,63	780.865					
USD	1.287.000	Petroleos Mexicanos 6.38% 23/01/2045	1.199.208	2,19	SÜDAFRIKA					
USD	300.000	Petroleos Mexicanos 6.50% 23/01/2029	305.087	0,56	USD	400.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	412.954	0,76	
USD	600.000	Petroleos Mexicanos 6.50% 02/06/2041	575.050	1,05	Summe Südafrika					
USD	345.000	Petroleos Mexicanos 6.75% 21/09/2047	330.639	0,61	412.954					
USD	750.000	Petroleos Mexicanos 6.84% 23/01/2030	777.105	1,42	0,76					
USD	220.000	Petroleos Mexicanos 7.69% 23/01/2050	229.554	0,42	VEREINIGTES KÖNIGREICH					
Summe Mexiko				4.586.757	8,40	USD	260.000	Liquid Telecommunications Financing plc 8.50% 13/07/2022	257.662	0,47
VEREINIGTE STAATEN				Summe Vereinigtes Königreich						
USD	378.000	Petroleos Mexicanos 6.63% 15/06/2035	371.054	0,68	257.662					
Summe Vereinigte Staaten				371.054	0,68	0,47				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
BRITISCHE JUNGFERNINSELN				WEISSRUSSLAND					
USD	300.000	CNOOC Finance 2013 Limited 2.88% 30/09/2029	299.141	0,55	USD	600.000	Belarus (Govt of) 6.20% 28/02/2030	633.299	1,16
USD	250.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	264.521	0,48	Summe Weißrussland				
USD	800.000	Sinopec Group Overseas Development 2017 Limited 3.25% 13/09/2027	822.452	1,50	BRASILIEN				
USD	500.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Limited 4.13% 12/09/2025	540.834	0,99	USD	1.530.000	Brazil (Govt of) 5.00% 27/01/2045	1.591.757	2,92
USD	244.000	State Grid Overseas Investment Limited 3.50% 04/05/2027	257.398	0,47	USD	769.000	Brazil (Govt of) 5.63% 07/01/2041	862.072	1,58
USD	200.000	Studio City Company Limited 7.25% 30/11/2021	204.022	0,37	BRL	2.020	Brazil (Govt of) 10.00% 01/01/2025	555.941	1,02
		Summe Britische Jungferninseln	2.388.368	4,36	Summe Brasilien				
					3.009.770				
					5,52				
Summe Anleihen			14.627.307	26,78	Summe Kroatien				
					713.014				
					1,31				
					713.014				
					1,31				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente									
ANGOLA									
USD	300.000	Angola (Govt of) 8.25% 09/05/2028	311.498	0,57	DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
		Summe Angola	311.498	0,57	USD	355.000	Dominican Republic (Govt of) 6.85% 27/01/2045	398.022	0,73
ARGENTINIEN									
USD	1.400.000	Argentina (Govt of) 5.88% 11/01/2028	575.237	1,05	USD	434.000	Dominican Republic (Govt of) 7.45% 30/04/2044	515.158	0,94
USD	650.000	Argentine (Govt of) 6.63% 06/07/2028	271.282	0,50	DOP	20.700.000	Dominican Republic (Govt of) 9.75% 05/06/2026	406.687	0,74
USD	289.000	Argentina (Govt of) 6.88% 26/01/2027	122.563	0,22	DOP	31.600.000	Dominican Republic (Govt of) 11.25% 05/02/2027	666.490	1,22
USD	365.000	Argentina (Govt of) 6.88% 11/01/2048	155.187	0,28	DOP	23.700.000	Dominican Republic (Govt of) 11.50% 10/05/2024	502.133	0,92
USD	436.000	Argentine (Govt of) 7.13% 06/07/2036	186.563	0,34	Summe Dominikanische Republik				
		Summe Argentinien	1.310.832	2,39	2.488.490				
BAHRAIN									
USD	350.000	Bahrain (Govt of) 7.00% 26/01/2026	393.548	0,72	ECUADOR				
		Summe Bahrain	393.548	0,72	USD	580.000	Ecuador (Govt of) 9.65% 13/12/2026	613.089	1,12
					Summe Ecuador				
					613.089				
					1,12				
ÄGYPTEN									
USD	600.000	Egypt (Govt of) 6.59% 21/02/2028	607.215	1,11	EL SALVADOR				
USD	375.000	Egypt (Govt of) 8.50% 31/01/2047	398.363	0,73	USD	150.000	El Salvador (Govt of) 7.12% 20/01/2050	153.497	0,28
		Summe Ägypten	1.005.578	1,84	Summe El Salvador				
					153.497				
					0,28				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)						
GHANA				OMAN (Fortsetzung)						
USD	200.000	Ghana (Govt of) 8.13% 26/03/2032	201.419	0,37	USD	557.000	Oman (Govt of) 6.75% 17/01/2048	526.557	0,96	
Summe Ghana				201.419	0,37	Summe Oman				
						1.342.039				
						2,45				
HONDURAS				PAKISTAN						
USD	250.000	Honduras (Govt of) 6.25% 19/01/2027	270.844	0,50	USD	274.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 15/04/2024	296.779	0,54	
Summe Honduras				270.844	0,50	Summe Pakistan				
						296.779				
						0,54				
INDONESIEN				PARAGUAY						
USD	950.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 18/07/2047	1.090.359	2,00	USD	340.000	Paraguay (Govt of) 5.60% 13/03/2048	393.869	0,72	
USD	300.000	Indonesia (Govt of) 5.13% 15/01/2045	359.762	0,66	USD	200.000	Paraguay (Govt of) 6.10% 11/08/2044	243.030	0,45	
Summe Indonesien				1.450.121	2,66	Summe Paraguay				
						636.899				
						1,17				
ELFENBEINKÜSTE				PERU						
USD	224.400	Ivory Coast (Govt of) FRN 31/12/2032	220.746	0,40	PEN	1.384.000	Peru (Govt of) 5.40% 12/08/2034	433.856	0,79	
Summe Elfenbeinküste				220.746	0,40	PEN	2.125.000	Peru (Govt of) 6.95% 12/08/2031	764.599	1,40
						Summe Peru				
						1.198.455				
						2,19				
MEXIKO				KATAR						
MXN	145.000	Mexico (Govt of) 8.50% 31/05/2029	816.855	1,50	USD	1.450.000	Qatar (Govt of) 4.00% 14/03/2029	1.608.470	2,96	
Summe Mexiko				816.855	1,50	USD	1.082.000	Qatar (Govt of) 4.82% 14/03/2049	1.341.284	2,47
						USD	200.000	Qatar (Govt of) 5.10% 23/04/2048	256.042	0,47
						Summe Katar				
						3.205.796				
						5,90				
MONGOLEI				RUMÄNIEN						
USD	500.000	Mongolia (Govt of) 5.63% 01/05/2023	506.365	0,93	EUR	400.000	Romania (Govt of) 4.63% 03/04/2049	566.495	1,04	
Summe Mongolei				506.365	0,93	Summe Rumänien				
						566.495				
						1,04				
NIGERIA				RUSSISCHE FÖDERATION						
USD	520.000	Nigeria (Govt of) 6.50% 28/11/2027	526.859	0,96	RUB	40.700.000	Russia (Govt of) 7.15% 12/11/2025	639.493	1,17	
USD	600.000	Nigeria (Govt of) 7.88% 16/02/2032	633.192	1,16	USD	800.000	Russian (Govt of) - Eurobond 4.38% 21/03/2029	857.412	1,57	
Summe Nigeria				1.160.051	2,12	USD	600.000	Russia (Govt of) - Eurobond 5.10% 28/03/2035	679.295	1,24
						Summe Russische Föderation				
						2.176.200				
						3,98				
OMAN										
USD	400.000	Oman (Govt of) 6.00% 01/08/2029	398.767	0,73						
USD	450.000	Oman (Govt of) 6.50% 08/03/2047	416.715	0,76						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
SAUDI-ARABIEN				VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE					
USD	350.000	Saudi (Govt) 4.50% 26/10/2046	391.191	0,72	USD	200.000	Abu Dhabi (Govt of) 3.13% 03/05/2026	209.930	0,38
		Summe Saudi-Arabien	391.191	0,72	USD	300.000	Abu Dhabi (Govt of) 4.13% 11/10/2047	352.088	0,64
SENEGAL				Summe Vereinigte Arabische Emirate					
USD	359.000	Senegal (Govt of) 6.25% 23/05/2033	362.154	0,66			562.018	1,02	
		Summe Senegal	362.154	0,66	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
SÜDAFRIKA									
USD	820.000	Eskom Holdings Limited 5.75% 26/01/2021	829.225	1,52	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				
ZAR	10.580.000	South Africa (Govt of) 10.50% 21/12/2026	778.829	1,43			46.733.051	85,58	
		Summe Südafrika	1.608.054	2,95	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere				
SRI LANKA				Anleihen					
USD	400.000	Sri Lanka (Govt of) 6.75% 18/04/2028	383.201	0,70	VENEZUELA				
USD	440.000	Sri Lanka (Govt of) 6.85% 03/11/2025	442.083	0,81	USD	1.999.683	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	174.972	0,32
USD	250.000	Sri Lanka (Govt of) 7.55% 28/03/2030	247.342	0,45			Summe Venezuela	174.972	0,32
USD	200.000	Sri Lanka (Govt of) 7.55% 28/03/2030	197.920	0,36	Summe Anleihen				
		Summe Sri Lanka	1.270.546	2,32			174.972	0,32	
TÜRKEI				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					
USD	400.000	Turkey (Govt of) 5.13% 17/02/2028	370.470	0,68	ÄGYPTEN				
USD	1.075.000	Turkey (Govt of) 6.00% 25/03/2027	1.057.448	1,94	EGP	19.725.000	Egypt (Govt of) 0.00% 05/11/2019	1.191.857	2,18
USD	450.000	Turkey (Govt of) 6.88% 17/03/2036	449.619	0,82			Summe Ägypten	1.191.857	2,18
		Summe Türkei	1.877.537	3,44	NIGERIA				
UKRAINE				VENEZUELA					
USD	300.000	Ukraine (Govt of) 7.38% 25/09/2032	303.607	0,56	USD	2.004.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	205.451	0,38
USD	1.000.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	1.048.958	1,92			Summe Venezuela	205.451	0,38
		Summe Ukraine	1.352.565	2,48	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
							2.296.537	4,21	
				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt					
							2.471.509	4,53	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
Anleihen				
CHILE				
USD	200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile 3.00% 30/09/2029	199.639	0,37
USD	500.000	Corp Nacional del Cobre de Chile 3.70% 30/01/2050	502.242	0,92
		Summe Chile	701.881	1,29
		Summe Anleihen	701.881	1,29
		Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	701.881	1,29
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren				
Fonds				
IRLAND				
	3.267.161	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.267.161	5,98
		Summe Irland	3.267.161	5,98
		Summe Fonds	3.267.161	5,98
		Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	3.267.161	5,98
		Wert der Anlagen insgesamt	53.173.602	97,38
(Gesamtkosten: USD 53.673.786)				

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts					
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)								
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)								
BERMUDAS				KASACHSTAN								
USD	1.000.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	1.022.029	0,78	USD	1.550.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 24/04/2025	1.693.601	1,31			
USD	1.600.000	Li & Fung Limited 4.38% 04/10/2024	1.600.794	1,22	Summe Kasachstan							
Summe Bermudas				2.622.823	2,00	LUXEMBURG						
KAIMANINSELN				MALAYSIA								
USD	1.040.000	Chn Aoyuan Group Limited 6.35% 11/01/2020	1.043.650	0,80	USD	820.000	Gaz Capital for Gazprom OAO 6.51% 07/03/2022	893.124	0,68			
USD	170.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	170.319	0,13	USD	1.615.000	Gazprom OAO via Gaz Capital SA 6.00% 23/01/2021	1.689.528	1,29			
USD	2.400.000	Lenovo Perpetual Securities Limited Perp FRN	2.361.000	1,81	USD	360.000	Millicom International Cellular SA 6.63% 15/10/2026	393.853	0,30			
USD	400.000	MGM China Holdings Limited 5.38% 15/05/2024	413.997	0,32	Summe Luxemburg							
USD	2.000.000	Vale Overseas Limited 6.25% 10/08/2026	2.314.168	1,77	2.976.505							
Summe Kaimaninseln				6.303.134	4,83	MAURITIUS						
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				MEXIKO								
USD	800.000	Dominican (Gov) 7.50% 06/05/2021	837.168	0,64	USD	1.400.000	Press Metal Labuan Limited 4.80% 30/10/2022	1.348.345	1,03			
Summe Dominikanische Republik				837.168	0,64	Summe Malaysia						
UNGARN				3.348.345								
USD	630.000	Magyar Export-Import Bank Zrt 4.00% 30/01/2020	633.276	0,48	MAURITIUS							
Summe Ungarn				633.276	0,48	USD	1.280.000	Azure Power Solar Energy Pvt Limited 5.65% 24/12/2024	1.283.200	0,98		
INDIEN				MEXIKO								
USD	1.000.000	JSW Steel Limited 4.75% 12/11/2019	1.001.481	0,77	USD	1.300.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	1.301.569	1,00			
USD	650.000	JSW Steel Limited 5.25% 13/04/2022	657.489	0,50	USD	1.000.000	HTA Group Limited 9.13% 08/03/2022	1.045.325	0,80			
USD	1.500.000	ReNew Power Limited 6.45% 27/09/2022	1.517.045	1,15	Summe Mauritius							
Summe Indien				3.176.015	2,42	3.630.094						
INDONESIEN				MAROKKO								
USD	2.250.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.23% 15/11/2021	2.364.472	1,81	USD	950.000	Elementia SAB de CV 5.50% 15/01/2025	928.582	0,71			
USD	500.000	Pertamina Persero PT 4.30% 20/05/2023	524.948	0,40	USD	1.300.000	Grupo Posadas SAB de CV 7.88% 30/06/2022	1.303.088	1,00			
Summe Indonesien				2.889.420	2,21	USD	1.514.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	1.577.913	1,21		
								USD	5.771.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	6.214.645	4,77
								Summe Mexiko				
								10.024.228				
								7,69				
								MAROKKO				
								USD	1.540.000	OCP SA 5.63% 25/04/2024	1.685.338	1,29
								Summe Marokko				
								1.685.338				
								1,29				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
NIEDERLANDE				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
USD	620.000	Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	655.925	0,50	USD	811.500	Ukreximbank Via Biz Finance plc 9.63% 27/04/2022	849.358	0,65
USD	1.900.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	2.016.400	1,54	USD	1.047.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	966.952	0,74
Summe Niederlande			2.672.325	2,04	Summe Vereinigtes Königreich			3.245.199	2,49
PERU				VEREINIGTE STAATEN					
USD	500.000	Inretail Pharma SA 5.38% 02/05/2023	525.313	0,40	USD	1.020.000	Cemex Finance LLC 6.00% 01/04/2024	1.050.218	0,80
Summe Peru			525.313	0,40	Summe Vereinigte Staaten			1.050.218	0,80
SAUDI-ARABIEN				BRITISCHE JUNGFERNINSELN					
USD	350.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	354.253	0,27	USD	580.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	613.689	0,47
USD	300.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	303.645	0,23	USD	860.000	Sinopec Group Overseas Development 3.90% 17/05/2022	890.149	0,68
Summe Saudi-Arabien			657.898	0,50	USD	600.000	Sinopec Group Overseas Development 4.13% 12/09/2025	649.000	0,50
SINGAPUR				BRITISCHE JUNGFERNINSELN					
USD	800.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	595.755	0,46	USD	820.000	Sinopec Group Overseas Development 2013 4.38% 17/10/2023	879.817	0,67
USD	1.500.000	Golden Legacy Pte Limited 6.88% 27/03/2024	1.525.304	1,17	USD	700.000	Studio City Company Limited 7.25% 30/11/2021	714.077	0,54
USD	445.000	Medco Oak Tree Pte Limited 7.38% 14/05/2026	450.275	0,34	USD	250.000	Studio City Finance Limited 7.25% 11/02/2024	263.722	0,20
Summe Singapur			2.571.334	1,97	Summe Britische Jungferninseln			4.010.454	3,06
SÜDAFRIKA				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					
USD	640.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	660.727	0,51	ANGOLA				
Summe Südafrika			660.727	0,51	USD	300.000	Angola (Govt of) 9.50% 12/11/2025	337.579	0,26
TÜRKEI				Summe Angola				337.579	0,26
USD	380.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	400.622	0,31	ARGENTINIEN				
Summe Türkei			400.622	0,31	USD	2.900.000	Argentina (Govt of) 5.88% 11/01/2028	1.191.562	0,91
VEREINIGTES KÖNIGREICH				Summe Argentinien				1.191.562	0,91
USD	1.025.000	Liquid Telecommunications Financing plc 8.50% 13/07/2022	1.015.783	0,78					
USD	400.000	Ukraine Railways Via Shortline plc 9.88% 15/09/2021	413.106	0,32					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)						
BAHRAIN				ÄGYPTEN						
USD	500.000	Bahrain (Govt of) 7.00% 26/01/2026	562.212	0,43	USD	1.493.000	Egypt (Govt of) 6.20% 01/03/2024	1.562.433	1,20	
USD	383.000	CBB International Sukuk Company 6 Spc 5.25% 20/03/2025	403.189	0,31	Summe Ägypten					
Summe Bahrain				965.401	0,74	1.562.433				1,20
WEISSRUSSLAND				EL SALVADOR						
USD	1.202.000	Belarus (Govt of) 6.88% 28/02/2023	1.287.642	0,99	USD	1.381.000	El Salvador (Govt of) 7.38% 01/12/2019	1.389.126	1,06	
Summe Weißrussland				1.287.642	0,99	Summe El Salvador				
BRASILIEN				GEORGIEN						
USD	2.500.000	Brazil (Govt of) 4.25% 07/01/2025	2.639.105	2,02	USD	1.200.000	Georgia (Govt of) 6.88% 12/04/2021	1.271.613	0,97	
BRL	4.790	Brazil (Govt of) 10.00% 01/01/2025	1.318.295	1,01	Summe Georgien					
Summe Brasilien				3.957.400	3,03	1.271.613				0,97
KROATIEN				GUATEMALA						
USD	600.000	Croatia (Govt of) 6.38% 24/03/2021	633.911	0,49	USD	745.000	Guatemala (Govt of) 5.75% 06/06/2022	793.932	0,61	
USD	600.000	Croatia (Govt of) 6.63% 14/07/2020	619.807	0,47	Summe Guatemala					
USD	200.000	Croatia (Govt of) 6.75% 05/11/2019	200.603	0,15	793.932				0,61	
Summe Kroatien				1.454.321	1,11	HONDURAS				
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				INDONESIEN						
USD	1.500.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 18/04/2024	1.585.125	1,21	USD	700.000	Indonesia (Govt of) 3.38% 15/04/2023	719.419	0,55	
DOP	20.000.000	Dominican Republic (Govt of) 8.90% 15/02/2023	384.349	0,29	USD	2.500.000	Indonesia (Govt of) 5.38% 17/10/2023	2.766.509	2,12	
DOP	35.900.000	Dominican Republic (Govt of) 11.50% 10/05/2024	760.615	0,58	Summe Indonesien					
DOP	52.000.000	Dominican Republic (Govt of) 16.95% 04/02/2022	1.173.507	0,90	3.485.928				2,67	
Summe Dominikanische Republik				3.903.596	2,98	ELFENBEINKÜSTE				
ECUADOR				MONGOLEI						
USD	1.650.000	Ecuador (Govt of) 8.75% 02/06/2023	1.757.773	1,35	USD	606.000	Ivory Coast (Govt of) 5.38% 23/07/2024	622.590	0,48	
Summe Ecuador				1.757.773	1,35	Summe Elfenbeinküste				
						622.590				0,48
						Summe Mongolei				
						2.835.641				2,17
						2.835.641				2,17

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					
NIGERIA				SENEGAL					
USD	560.000	Nigeria (Govt of) 6.75% 28/01/2021	580.425	0,44	USD	293.000	Senegal (Govt of) 6.25% 30/07/2024	318.560	0,24
USD	900.000	Nigeria (Govt of) 7.63% 21/11/2025	989.631	0,76	USD	1.000.000	Senegal (Govt of) 8.75% 13/05/2021	1.086.999	0,83
	Summe Nigeria	1.570.056	1,20		Summe Senegal	1.405.559	1,07		
OMAN				SERBIEN					
USD	2.690.000	Oman (Govt of) 4.75% 15/06/2026	2.591.089	1,98	USD	476.000	Serbia (Govt of) 4.88% 25/02/2020	480.246	0,37
	Summe Oman	2.591.089	1,98		Summe Serbien	480.246	0,37		
PAKISTAN				SÜDAFRIKA					
USD	420.000	Pakistan (Govt of) 6.75% 03/12/2019	422.238	0,32	USD	2.500.000	Eskom Holdings Limited 5.75% 26/01/2021	2.528.125	1,93
USD	200.000	Third Pakistan International Sukuk Company Limited 5.50% 13/10/2021	201.139	0,15	ZAR	15.500.000	South Africa (Govt of) 10.50% 21/12/2026	1.141.006	0,87
	Summe Pakistan	623.377	0,47		Summe Südafrika	3.669.131	2,80		
PARAGUAY				SRI LANKA					
USD	1.250.000	Paraguay (Govt of) 4.63% 25/01/2023	1.314.088	1,01	USD	1.599.000	Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/04/2023	1.592.555	1,22
	Summe Paraguay	1.314.088	1,01	USD	1.600.000	Sri Lanka (Govt of) 5.88% 25/07/2022	1.609.040	1,23	
KATAR				TÜRKEI					
USD	1.600.000	Qatar (Govt of) 3.25% 02/06/2026	1.683.951	1,29	USD	661.000	Sri Lanka (Govt of) 6.35% 28/06/2024	662.771	0,51
USD	1.500.000	Qatar (Govt of) 3.38% 14/03/2024	1.570.350	1,20	USD	400.000	Sri Lanka (Govt of) 6.83% 18/07/2026	396.343	0,30
USD	1.218.000	Qatar (Govt of) 3.88% 23/04/2023	1.289.422	0,99		Summe Sri Lanka	4.260.709	3,26	
	Summe Katar	4.543.723	3,48		Summe Türkei	4.633.438	3,55		
RUSSISCHE FÖDERATION				UKRAINE					
USD	1.200.000	Russia (Govt of) 4.75% 27/05/2026	1.312.131	1,00	USD	2.500.000	Turkey (Govt of) 3.25% 23/03/2023	2.335.456	1,79
	Summe Russische Föderation	1.312.131	1,00	USD	2.250.000	Turkey (Govt of) 6.35% 10/08/2024	2.297.982	1,76	
SAUDI-ARABIEN				UKRAINE					
USD	250.000	Saudi (Govt of) 2.88% 04/03/2023	254.501	0,19	USD	2.500.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2023	2.639.875	2,02
	Summe Saudi-Arabien	254.501	0,19	USD	650.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2024	688.632	0,53	
				USD	300.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	314.687	0,24	
					Summe Ukraine	3.643.194	2,79		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)			
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				VENEZUELA			
USD	600.000 Abu Dhabi (Govt of) 2.50% 11/10/2022	606.903	0,46	USD	1.245.400 Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	127.654	0,10
USD	1.250.000 Abu Dhabi (Govt of) 3.13% 03/05/2026	1.312.063	1,00		Summe Venezuela	127.654	0,10
	Summe Vereinigte Arabische Emirate	1.918.966	1,46		Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	5.364.258	4,11
	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	60.926.432	46,61		Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt	5.364.258	4,11
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	114.540.469	87,64		Wert der Anlagen insgesamt	119.904.727	91,75
	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere				(Gesamtkosten: USD 119.063.127)		
Anleihen							
VENEZUELA							
USD	3.288.783 Petroleos de Venezuela SA 6.00% 16/05/2024	287.769	0,22				
USD	491.751 Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	43.028	0,03				
	Summe Venezuela	330.797	0,25				
	Summe Anleihen	330.797	0,25				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente							
ÄGYPTEN							
EGP	49.300.000 Egypt (Govt of) 0.00% 05/11/2019	2.978.887	2,29				
	Summe Ägypten	2.978.887	2,29				
NIGERIA							
NGN	750.000.000 Nigeria (Govt of) 0.00% 16/01/2020	1.926.920	1,47				
	Summe Nigeria	1.926.920	1,47				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
KANADA				NIEDERLANDE					
USD	266.000	Bausch Health Cos Inc. 7.00% 15/01/2028	287.253	0,14	USD	323.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	339.956	0,16
		Summe Kanada	287.253	0,14	USD	198.000	Trivium Packaging Finance BV 8.50% 15/08/2027	215.173	0,10
					USD	955.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	999.169	0,48
						Summe Niederlande	1.554.298	0,74	
FRANKREICH				SUPRANATIONAL					
USD	598.000	Altice France SA 5.50% 15/01/2028	606.223	0,29	USD	382.000	Ardagh Packaging Finance plc 4.13% 15/08/2026	385.807	0,18
USD	1.529.000	Altice France SA 7.38% 01/05/2026	1.640.143	0,77	USD	455.000	Ardagh Packaging Finance plc 5.25% 15/08/2027	461.885	0,22
USD	550.000	Altice France SA 8.13% 01/02/2027	608.974	0,29	USD	1.259.000	Starfruit Finco BV 8.00% 01/10/2026	1.261.360	0,60
USD	328.000	SPCM SA 4.88% 15/09/2025	335.339	0,16		Summe Supranational	2.109.052	1,00	
		Summe Frankreich	3.190.679	1,51	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
DEUTSCHLAND				VEREINIGTE STAATEN					
USD	125.000	IHO Verwaltungs GmbH 4.75% 15/09/2026	123.181	0,06	USD	78.000	International Game Technology plc 6.25% 15/01/2027	86.681	0,04
		Summe Deutschland	123.181	0,06	USD	597.000	Virgin Media Finance plc 5.75% 15/01/2025	617.927	0,29
IRLAND				VEREINIGTES KÖNIGREICH					
USD	830.000	Ardagh Packaging Finance 4.63% 15/05/2023	850.750	0,41	USD	1.025.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/01/2026	1.053.828	0,50
		Summe Irland	850.750	0,41	USD	355.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.50% 15/08/2026	373.611	0,18
ITALIEN				Summe Vereinigtes Königreich					
USD	154.000	Telecom Italia SpA 5.30% 30/05/2024	166.370	0,08		2.132.047	1,01		
		Summe Italien	166.370	0,08	VEREINIGTE STAATEN				
LUXEMBURG				VEREINIGTE STAATEN					
USD	121.000	Altice Luxembourg SA 7.75% 15/05/2022	123.647	0,06	USD	102.000	Acadia Healthcare Company 5.63% 15/02/2023	104.428	0,05
USD	570.000	Altice Luxembourg SA 10.50% 15/05/2027	643.815	0,31	USD	651.000	Acadia Healthcare Company 6.50% 01/03/2024	680.232	0,32
USD	701.000	Ineos Group Holdings 5.63% 01/08/2024	722.390	0,34	USD	344.000	AES Corp. 4.88% 15/05/2023	350.257	0,17
USD	201.000	Telecom Italia Capital SA 6.00% 30/09/2034	213.758	0,10	USD	462.000	AES Corp. 5.13% 01/09/2027	491.951	0,23
		Summe Luxemburg	1.703.610	0,81	USD	177.000	AES Corp. 6.00% 15/05/2026	188.129	0,09
					USD	457.000	Ally Financial Inc. 8.00% 01/11/2031	633.183	0,30
					USD	140.000	APX Group Inc. 8.75% 01/12/2020	138.180	0,07
					USD	88.000	Avis Budget Car Rental LLC 5.50% 01/04/2023	89.908	0,04
					USD	181.000	B&G Foods Inc. 4.63% 01/06/2021	181.149	0,09
					USD	511.000	B&G Foods Inc. 5.25% 01/04/2025	523.719	0,25

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD	385.000 B&G Foods Inc. 5.25% 15/09/2027	394.384	0,19	USD	144.000 Freeport-Mcmoran Copper & Gold Inc. 3.55% 01/03/2022	144.961	0,07
USD	930.000 Berry Global Inc. 5.13% 15/07/2023	955.869	0,46	USD	697.000 Freeport-Mcmoran Inc. 4.55% 14/11/2024	715.157	0,34
USD	185.000 Berry Global Inc. 5.13% 15/07/2023	190.146	0,09	USD	1.128.000 Freeport-McMoran Inc. 5.45% 15/03/2043	1.018.449	0,49
USD	809.000 Boyd Gaming Corp. 6.88% 15/05/2023	840.073	0,40	USD	313.000 Freeport-McMoran Inc. 5.25% 01/09/2029	312.739	0,15
USD	399.000 Broadcom Cayman Finance 3.88% 15/01/2027	400.858	0,19	USD	320.000 Frontier Communications Corp. 7.13% 15/01/2023	142.000	0,07
USD	256.000 Callon Petroleum Company 6.13% 01/10/2024	252.000	0,12	USD	197.000 Frontier Communications Corp. 11.00% 15/09/2025	91.482	0,04
USD	502.000 Calpine Corp. 5.25% 01/06/2026	520.407	0,25	USD	330.000 Group 1 Automotive Inc. 5.00% 01/06/2022	334.592	0,16
USD	150.000 Calpine Corp. 5.50% 01/02/2024	152.320	0,07	USD	1.110.000 HCA Inc. 5.63% 01/09/2028	1.242.922	0,59
USD	152.000 Calpine Corp. 5.75% 15/01/2025	156.275	0,07	USD	327.000 HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	368.522	0,18
USD	647.000 Carrizo Oil & Gas Inc. 6.25% 15/04/2023	614.650	0,29	USD	547.000 Icahn Enterprises LP 6.25% 01/02/2022	562.038	0,27
USD	539.000 Cedar Fair LP 5.38% 01/06/2024	555.881	0,26	USD	956.000 Iron Mountain Inc. 5.75% 15/08/2024	967.950	0,46
USD	676.000 Centene Corp. 4.75% 15/01/2025	696.027	0,33	USD	402.000 Istar Inc. 6.00% 01/04/2022	414.150	0,20
USD	1.081.000 CenturyLink Inc. 7.50% 01/04/2024	1.208.936	0,58	USD	240.000 L Brands Inc. 6.88% 01/11/2035	208.604	0,10
USD	825.000 CenturyLink Inc. 5.80% 15/03/2022	871.865	0,42	USD	207.000 L Brands Inc. 7.50% 15/06/2029	206.094	0,10
USD	139.000 CF Industries Inc. 5.15% 15/03/2034	145.255	0,07	USD	78.000 Lennar Corp 4.75% 29/11/2027	83.909	0,04
USD	78.000 CF Industries Inc. 5.38% 15/03/2044	78.694	0,04	USD	802.000 Lennar Corp. 4.50% 30/04/2024	845.407	0,39
USD	713.000 Chemours Company 7.00% 15/05/2025	675.865	0,32	USD	119.000 Lennar Corp. 4.75% 01/04/2021	121.939	0,06
USD	682.000 Chesapeake Energy Corp. 7.50% 01/10/2026	468.602	0,22	USD	581.000 Match Group Inc. 6.38% 01/06/2024	611.925	0,29
USD	760.000 Cinemark USA Inc. 5.13% 15/12/2022	773.112	0,37	USD	375.000 Meritage Homes Corp. 5.13% 06/06/2027	396.973	0,19
USD	1.105.000 Clearway Energy Operating LLC 5.38% 15/08/2024	1.137.804	0,54	USD	187.000 Meritage Homes Corp. 6.00% 01/06/2025	206.842	0,10
USD	550.000 Community Health Systems (CHS) 6.25% 31/03/2023	549.313	0,26	USD	207.000 MGM Growth Properties 4.50% 01/09/2026	219.938	0,10
USD	205.000 DaVita Inc. 5.13% 15/07/2024	209.074	0,10	USD	158.000 MGM Growth Properties 5.63% 01/05/2024	173.657	0,08
USD	639.000 DCP Midstream Operating LP 5.13% 15/05/2029	650.849	0,31	USD	511.000 MGM Resorts International 6.00% 15/03/2023	564.172	0,27
USD	389.000 DCP Midstream Operating LP 5.60% 01/04/2044	367.119	0,17	USD	450.000 Navient Corp. 5.50% 25/01/2023	465.834	0,22
USD	214.000 Diamond Offshore 7.88% 15/08/2025	168.124	0,08	USD	772.000 Navient Corp. 6.50% 15/06/2022	824.987	0,39
USD	302.000 Dish DBS Corp. 5.88% 15/11/2024	299.310	0,14	USD	200.000 Navient Corp. 6.63% 26/07/2021	211.486	0,10
USD	185.000 Encompass Health Corp 4.50% 01/02/2028	187.141	0,09	USD	111.000 Navient Corp. 6.75% 15/06/2026	113.739	0,05
USD	185.000 Encompass Health Corp 4.75% 01/02/2030	187.040	0,09	USD	289.000 Navient Corp. 7.25% 25/01/2022	312.840	0,15
				USD	6.000 Navient Corp. 7.25% 25/09/2023	6.536	0,00
				USD	609.000 NCR Corp. 5.00% 15/07/2022	616.613	0,29
				USD	740.000 NCR Corp. 6.38% 15/12/2023	760.368	0,36
				USD	1.145.000 Netflix Inc. 4.88% 15/04/2028	1.165.753	0,55
				USD	768.000 Netflix Inc. 5.75% 01/03/2024	840.192	0,40
				USD	352.000 Netflix Inc. 5.88% 15/11/2028	383.647	0,18

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
USD	80.000	NRG Energy Inc. 5.75% 15/01/2028	86.233	0,04	USD	463.000	T-Mobile USA Inc. 4.75% 01/02/2028	485.620	0,23
USD	764.000	NRG Energy Inc. 6.63% 15/01/2027	828.633	0,40	USD	998.000	T-Mobile USA Inc. 5.38% 15/04/2027	1.076.065	0,51
USD	322.000	NRG Energy Inc. 7.25% 15/05/2026	353.677	0,17	USD	1.147.000	T-Mobile USA Inc. 6.50% 15/01/2026	1.233.960	0,59
USD	249.000	NuStar Logistics LP 6.00% 01/06/2026	269.493	0,13	USD	112.000	Transdigm Inc. 6.00% 15/07/2022	113.958	0,05
USD	892.000	Outfront Media Cap LLC 5.88% 15/03/2025	920.814	0,44	USD	260.000	Transdigm Inc. 6.38% 15/06/2026	273.975	0,13
USD	238.000	Penske Automotive Group Inc. 5.38% 01/12/2024	245.140	0,12	USD	1.664.000	Transdigm Inc. 6.50% 15/05/2025	1.734.803	0,83
USD	257.000	QEP Resources Inc. 5.63% 01/03/2026	221.984	0,11	USD	567.000	Transdigm Inc. 7.50% 15/03/2027	616.967	0,29
USD	289.000	Rowan Companies Inc. 4.75% 15/01/2024	172.135	0,08	USD	208.000	TRI Pointe Group Inc. 5.88% 15/06/2024	221.813	0,11
USD	543.000	Scientific Games Corp. 10.00% 01/12/2022	565.399	0,27	USD	710.000	United Rentals North America Inc. 5.88% 15/09/2026	758.404	0,36
USD	265.000	Scotts Miracle-Gro Company 6.00% 15/10/2023	273.824	0,13	USD	191.000	United Rentals North America Inc. 4.63% 15/10/2025	195.680	0,09
USD	156.000	SM Energy Company 5.63% 01/06/2025	134.519	0,06	USD	327.000	United Rentals North America Inc. 4.88% 15/01/2028	340.284	0,16
USD	132.000	SM Energy Company 6.63% 15/01/2027	114.015	0,05	USD	506.000	United Rentals North America Inc. 5.50% 15/05/2027	537.309	0,26
USD	742.000	SM Energy Company 6.75% 15/09/2026	651.723	0,31	USD	230.000	United Rentals North America Inc. 6.50% 15/12/2026	250.219	0,12
USD	694.000	Spectrum Brands Inc. 5.75% 15/07/2025	725.917	0,35	USD	180.000	Vistra Energy Corp. 7.63% 01/11/2024	188.145	0,09
USD	794.000	Springleaf Finance Corp 6.13% 15/03/2024	858.132	0,42	USD	169.000	Welbilt Inc. 9.50% 15/02/2024	181.833	0,09
USD	397.000	Springleaf Finance Corp. 5.63% 15/03/2023	425.882	0,20	USD	439.000	Wellcare Health Plans 5.25% 01/04/2025	458.889	0,22
USD	189.000	Springleaf Finance Corp. 6.88% 15/03/2025	208.879	0,10	USD	751.000	WPX Energy Inc. 5.25% 15/09/2024	771.435	0,37
USD	194.000	Springleaf Finance Corp. 7.13% 15/03/2026	215.069	0,10	USD	356.000	WPX Energy Inc. 5.25% 15/10/2027	359.115	0,17
USD	480.000	Sprint Corp. 7.13% 15/06/2024	518.248	0,25	USD	445.000	WPX Energy Inc. 5.75% 01/06/2026	457.483	0,22
USD	1.356.000	Sprint Corp. 7.63% 15/02/2025	1.493.871	0,71	USD	320.000	Zayo Group LLC 6.00% 01/04/2023	329.416	0,16
USD	603.000	Sprint Corp. 7.63% 01/03/2026	667.737	0,32	USD	881.000	Zayo Group LLC 6.38% 15/05/2025	908.531	0,44
USD	710.000	Tenet Healthcare Corp 4.63% 15/07/2024	731.107	0,35			Summe Vereinigte Staaten	56.730.218	27,03
USD	372.000	Tenet Healthcare Corp 5.13% 01/05/2025	377.599	0,18			Summe Anleihen	68.847.458	32,79
USD	616.000	Tenet Healthcare Corp. 6.75% 15/06/2023	646.911	0,31			Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	68.847.458	32,79
USD	204.000	Tenet Healthcare Corp. 8.13% 01/04/2022	221.146	0,11					
USD	546.000	T-Mobile USA Inc. 4.50% 01/02/2026	563.681	0,27					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)			
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)			
BERMUDAS				KAIMANINSELN			
USD	448.000	Viking Cruises Limited 5.88% 15/09/2027		USD	319.000	Global Aircraft Leasing Company Limited 6.50% 15/09/2024	
						323.267	0,15
		474.701	0,22	USD	209.150	Transocean Guardian Limited 5.88% 15/01/2024	
						212.016	0,10
		474.701	0,22	USD	97.000	Transocean Inc. 7.50% 15/01/2026	
						86.269	0,04
KANADA				USD	165.540	Transocean Pontus Limited 6.13% 01/08/2025	
USD	233.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 3.88% 15/01/2028				168.230	0,08
		234.602	0,11	USD	185.000	Transocean Poseidon Limited 6.88% 01/02/2027	
USD	490.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 4.63% 15/01/2022				193.890	0,09
		489.792	0,23	USD	273.000	Transocean Sentry Limited 5.38% 15/05/2023	
USD	476.000	Bausch Health Americas Inc. 8.50% 31/01/2027				273.341	0,13
		534.953	0,25			1.257.013	0,59
USD	525.000	Bausch Health Cos Inc. 5.50% 01/11/2025		Summe Kaimaninseln			
		550.318	0,26				
USD	370.000	Bausch Health Cos Inc. P.P. 144A 5.88% 15/05/2023		IRLAND			
		376.117	0,18	USD	1.481.000	Ardagh Packaging Finance 6.00% 15/02/2025	
USD	838.000	Bausch Health Cos Inc. P.P. 144A 6.13% 15/04/2025				1.549.459	0,74
		870.995	0,42	USD	444.000	James Hardie International Finance DAC 4.75% 15/01/2025	
USD	147.000	Bausch Health Cos Inc. 7.00% 15/03/2024				459.259	0,22
		154.675	0,07			2.008.718	0,96
USD	124.000	Bombardier Inc. 6.00% 15/10/2022		Summe Irland			
		123.820	0,06				
USD	185.000	Bombardier Inc. 7.50% 01/12/2024		JERSEY - KANALINSELN			
		185.879	0,09	USD	300.000	Delphi Technologies plc 5.00% 01/10/2025	
USD	209.000	Bombardier Inc. 7.50% 15/03/2025				266.438	0,13
		209.392	0,10			266.438	0,13
USD	415.000	Bombardier Inc. 7.88% 15/04/2027		Summe Jersey - Kanalinseln			
		414.056	0,20				
USD	151.000	GFL Environmental Inc. 5.38% 01/03/2023		LUXEMBURG			
		153.235	0,07	USD	1.009.000	Camelot Finance SA 7.88% 15/10/2024	
USD	110.000	GFL Environmental Inc. 7.00% 01/06/2026				1.049.360	0,51
		116.182	0,06	USD	352.000	Fage International 5.63% 15/08/2026	
USD	476.000	GFL Environmental Inc. 8.50% 01/05/2027				316.686	0,15
		528.360	0,24	USD	650.000	Intelsat Jackson Holdings SA 8.50% 15/10/2024	
USD	211.000	Hudbay Minerals Inc. 7.25% 15/01/2023				655.889	0,31
		218.507	0,10	USD	425.000	Nielsen Company Luxembourg Sarl 5.50% 01/10/2021	
USD	1.074.000	Hudbay Minerals Inc. 7.63% 15/01/2025				427.162	0,20
		1.093.479	0,52			2.449.097	1,17
USD	150.000	Meg Energy Corp. 6.50% 15/01/2025		Summe Luxemburg			
		155.353	0,07				
USD	166.000	Nova Chemicals Corp. 5.25% 01/06/2027		NIEDERLANDE			
		173.196	0,08	USD	555.000	Alcoa Nederland Holding BV 6.75% 30/09/2024	
USD	797.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc. 5.38% 15/01/2025				585.203	0,28
		833.582	0,39	USD	560.000	Atotech Alpha 2 BV 8.75% 01/06/2023	
USD	747.000	Rockpoint Gas Storage 7.00% 31/03/2023				557.900	0,27
		751.980	0,36	USD	552.000	Atotech Alpha 3 BV 6.25% 01/02/2025	
		8.168.473	3,86			556.485	0,27
				USD	953.000	Constellium NV 5.88% 15/02/2026	
						996.163	0,47

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
NIEDERLANDE (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD	623.000 Constellium NV 6.63% 01/03/2025	651.185	0,31	USD	410.000 Ascend Learning LLC 6.88% 01/08/2025	427.553	0,20
USD	497.000 Stars Group Holdings BV 7.00% 15/07/2026	528.699	0,25	USD	398.000 Ascend Learning LLC 6.88% 01/08/2025	415.039	0,20
USD	1.034.000 Ziggo BV 5.50% 15/01/2027	1.081.823	0,52	USD	318.000 Avantor Inc. 6.00% 01/10/2024	341.408	0,16
	Summe Niederlande	4.957.458	2,37	USD	807.000 Avantor Inc. 9.00% 01/10/2025	908.379	0,44
				USD	744.000 Avis Budget Car Rental LLC 5.25% 15/03/2025	767.952	0,37
SUPRANATIONAL				USD	439.000 Axalta Coating System Limited 4.88% 15/08/2024	455.417	0,22
USD	192.000 Panther BF Aggregator 2 LP 6.25% 15/05/2026	202.320	0,10	USD	650.000 Bausch Health Americas Inc. 9.25% 01/04/2026	738.904	0,35
USD	403.000 Panther BF Aggregator 2 LP 8.50% 15/05/2027	408.716	0,19	USD	116.000 Bausch Health Cos Inc. P.P. 144A 5.50% 01/03/2023	117.450	0,06
	Summe Supranational	611.036	0,29	USD	626.000 Beacon Roofing Supply 6.38% 01/10/2023	649.260	0,31
VEREINIGTES KÖNIGREICH				USD	1.122.000 Beacon Roofing Supply Inc. 4.88% 01/11/2025	1.102.366	0,52
USD	404.000 International Game Tech 6.25% 15/02/2022	426.833	0,20	USD	157.000 Berry Global Inc. 4.88% 15/07/2026	162.838	0,08
USD	705.000 International Game Tech P.P. 144A 6.50% 15/02/2025	782.937	0,38	USD	130.000 Berry Global Inc. 5.63% 15/07/2027	134.799	0,06
	Summe Vereinigtes Königreich	1.209.770	0,58	USD	756.000 Big River Steel 7.25% 01/09/2025	802.154	0,38
VEREINIGTE STAATEN				USD	249.000 Boyd Gaming Corp 6.00% 15/08/2026	263.744	0,13
USD	145.000 Acrisure LLC 8.13% 15/02/2024	156.328	0,07	USD	202.000 BVX Technologies Inc. 5.38% 15/07/2026	213.255	0,10
USD	214.000 Albertsons Cos Inc. 5.75% 15/03/2025	221.445	0,11	USD	413.000 Caesars Resort Collection LLC 5.25% 15/10/2025	421.877	0,20
USD	487.000 Albertsons Cos Inc. 5.88% 15/02/2028	516.373	0,25	USD	301.000 Calfrac Holdings LP 8.50% 15/06/2026	136.955	0,07
USD	261.000 Albertsons Cos Inc. 7.50% 15/03/2026	292.433	0,14	USD	199.000 California Resources Corp. 8.00% 15/12/2022	99.376	0,05
USD	316.000 Alliant Holdings Intermediate LLC 8.25% 01/08/2023	323.059	0,15	USD	1.273.000 Callon Petroleum Company 6.38% 01/07/2026	1.246.235	0,60
USD	634.000 American Builders & Contractors Supply Company Inc. 5.75% 15/12/2023	655.199	0,31	USD	415.000 Catalent Pharma Solutions Inc. 4.88% 15/01/2026	427.018	0,20
USD	571.000 American Builders & Contractors Supply Company Inc. 5.88% 15/05/2026	601.238	0,28	USD	343.000 CCO Holdings LLC 5.13% 01/05/2027	358.649	0,17
USD	310.000 Antero Midstream Partners LP 5.75% 01/03/2027	259.081	0,12	USD	439.000 Cco Holdings LLC P.P. 144A 5.88% 01/05/2027	465.936	0,22
USD	834.000 Apergy Corp 6.38% 01/05/2026	831.915	0,39	USD	998.000 CCO Holdings LLC 4.75% 01/03/2030	1.013.594	0,48
USD	434.000 APX Group Inc. 7.63% 01/09/2023	387.044	0,18	USD	606.000 CCO Holdings LLC 5.00% 01/02/2028	627.968	0,30
USD	766.000 APX Group Inc. 7.88% 01/12/2022	766.958	0,37	USD	885.000 CCO Holdings LLC 5.38% 01/05/2025	919.294	0,44
USD	380.000 APX Group Inc. 8.50% 01/11/2024	385.225	0,18	USD	93.000 CCO Holdings LLC 5.38% 01/06/2029	99.103	0,05
USD	372.000 Aruba Investments Inc. P.P. 144A 8.75% 15/02/2023	370.528	0,18				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapierranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD	681.000 CCO Holdings LLC 5.50% 01/05/2026	714.131	0,34	USD	435.000 CSC Holdings LLC 5.38% 15/07/2023	447.229	0,21
USD	63.000 CCO Holdings LLC 5.75% 15/02/2026	66.670	0,03	USD	917.000 CSC Holdings LLC 5.50% 15/05/2026	966.243	0,46
USD	384.000 CCO Holdings LLC 5.88% 01/04/2024	401.223	0,19	USD	733.000 CSC Holdings LLC 5.75% 15/01/2030	766.534	0,36
USD	750.000 CDK Global Inc. 4.88% 01/06/2027	782.899	0,37	USD	932.000 CSC Holdings LLC 6.50% 01/02/2029	1.035.895	0,49
USD	1.037.000 Centene Corp. 5.38% 01/06/2026	1.087.553	0,52	USD	730.000 CSC Holdings LLC P.P. 144A 6.63% 15/10/2025	782.232	0,37
USD	831.000 Centennial Resource Production LLC 5.38% 15/01/2026	797.760	0,38	USD	692.000 CSC Holdings LLC 7.50% 01/04/2028	782.202	0,38
USD	291.000 Centennial Resource Production LLC 6.88% 01/04/2027	291.000	0,14	USD	459.000 CSC Holdings LLC P.P. 144A 10.88% 15/10/2025	520.724	0,25
USD	780.000 Change Healthcare Holdings LLC 5.75% 01/03/2025	793.232	0,38	USD	1.182.000 Cyrusone LP 5.38% 15/03/2027	1.264.739	0,60
USD	195.000 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.13% 30/06/2027	213.647	0,10	USD	83.000 Darling Ingredients Inc. 5.25% 15/04/2027	87.381	0,04
USD	295.000 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7.00% 30/06/2024	339.250	0,16	USD	264.000 DCP Midstream Operating LP 5.38% 15/07/2025	283.767	0,14
USD	772.000 Cheniere Energy Partners LP 4.50% 01/10/2029	792.265	0,38	USD	508.000 Delek Logistics Partners LP 6.75% 15/05/2025	507.153	0,24
USD	614.000 Cheniere Energy Partners LP 5.63% 01/10/2026	652.352	0,31	USD	534.000 Diamond Sports Group LLC 5.38% 15/08/2026	554.441	0,26
USD	158.000 Clean Harbors Inc. 4.88% 15/07/2027	165.280	0,08	USD	317.000 Diamond Sports Group LLC 6.63% 15/08/2027	329.022	0,16
USD	110.000 Clean Harbors Inc. 5.13% 15/07/2029	117.130	0,06	USD	1.567.000 DISH DBS Corp. 7.75% 01/07/2026	1.599.710	0,77
USD	612.000 Clear Channel Worldwide Holdings Inc. 5.13% 15/08/2027	640.137	0,30	USD	412.000 Eagle Holding Company II LLC 7.75% 15/05/2022	416.106	0,20
USD	1.067.000 Clear Channel Worldwide Holdings Inc. 9.25% 15/02/2024	1.174.270	0,56	USD	634.000 Eldorado Resorts Inc. 6.00% 01/04/2025	669.952	0,32
USD	411.000 Clearway Energy Operating LLC 5.75% 15/10/2025	434.522	0,21	USD	336.000 Eldorado Resorts Inc. 6.00% 15/09/2026	369.236	0,18
USD	540.000 Colfax Corp 6.00% 15/02/2024	572.184	0,28	USD	1.239.000 Element Solutions Inc. 5.88% 01/12/2025	1.299.834	0,61
USD	161.000 Colfax Corp 6.38% 15/02/2026	173.628	0,08	USD	204.000 Endeavor Energy Resources LP 5.75% 30/01/2028	217.008	0,10
USD	320.000 CommScope Inc. 5.50% 01/03/2024	329.100	0,16	USD	215.000 Energizer Holdings Inc. 6.38% 15/07/2026	230.139	0,11
USD	381.000 CommScope Inc. 6.00% 01/03/2026	394.468	0,19	USD	417.000 Energizer Holdings Inc. 7.75% 15/01/2027	463.130	0,22
USD	13.000 CommScope Inc. 8.25% 01/03/2027	12.712	0,01	USD	61.000 Flex Acquisition Company Inc. 6.88% 15/01/2025	55.905	0,03
USD	555.000 CommScope Technologies LLC P.P. 144A 6.00% 15/06/2025	502.969	0,24	USD	505.000 Flex Acquisition Company Inc. 7.88% 15/07/2026	467.756	0,22
USD	632.000 Core & Main 6.13% 15/08/2025	633.479	0,30	USD	211.000 frontdoor Inc. 6.75% 15/08/2026	231.577	0,11
USD	1.377.000 Crownrock LP 5.63% 15/10/2025	1.389.324	0,66	USD	350.000 Frontier Communications 8.50% 01/04/2026	350.337	0,17
USD	691.000 CSC Holdings LLC 5.13% 15/12/2021	691.570	0,33	USD	319.000 Gartner Inc. 5.13% 01/04/2025	334.306	0,16

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
USD	977.000	Gates Global LLC P.P. 144A 6.00% 15/07/2022	978.396	0,47	USD	368.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP 5.75% 01/02/2027	412.461	0,20
USD	474.000	Genesys Telecommunications Laboratories Inc. 10.00% 30/11/2024	512.809	0,24	USD	411.000	MPH Acquisition Holdings LLC 7.13% 01/06/2024	380.946	0,18
USD	640.000	H&E Equipment Services 5.63% 01/09/2025	660.075	0,32	USD	840.000	Nabors Industries Inc. 5.75% 01/02/2025	627.900	0,30
USD	472.000	Herc Holdings Inc. 5.50% 15/07/2027	491.765	0,23	USD	299.000	NCR Corp 5.75% 01/09/2027	310.026	0,15
USD	416.000	Hertz Corp. 5.50% 15/10/2024	417.061	0,20	USD	377.000	NCR Corp 6.13% 01/09/2029	398.492	0,19
USD	347.000	Hertz Corp. 7.13% 01/08/2026	362.181	0,17	USD	579.000	Netflix Inc. 5.38% 15/11/2029	604.991	0,29
USD	857.000	Hertz Corp. 7.63% 01/06/2022	893.422	0,42	USD	30.000	Netflix Inc. 6.38% 15/05/2029	33.242	0,02
USD	845.000	Holly Energy Partners 6.00% 01/08/2024	882.732	0,42	USD	501.000	NextEra Energy Operating Partners 4.50% 15/09/2027	516.798	0,25
USD	132.000	Horizon Pharma USA Inc. 5.50% 01/08/2027	138.179	0,07	USD	299.000	NextEra Energy Operating Partners LP 4.25% 15/07/2024	308.718	0,15
USD	683.000	HUB International Limited 7.00% 01/05/2026	703.917	0,33	USD	815.000	NFP Corp. 6.88% 15/07/2025	812.775	0,39
USD	115.000	IAA Inc. 5.50% 15/06/2027	122.246	0,06	USD	832.000	Novelis Corp. 5.88% 30/09/2026	874.224	0,41
USD	173.000	iHeartCommunications Inc. 5.25% 15/08/2027	180.397	0,09	USD	551.000	Novelis Corp. 6.25% 15/08/2024	578.722	0,28
USD	252.910	iHeartCommunications Inc. 6.38% 01/05/2026	274.100	0,13	USD	328.000	NRG Energy Inc. 5.25% 15/06/2029	353.108	0,17
USD	1.230.757	iHeartCommunications Inc. 8.38% 01/05/2027	1.329.986	0,64	USD	144.000	Outfront Media Capital LLC 5.00% 15/08/2027	151.380	0,07
USD	234.000	Indigo Natural Resources 6.88% 15/02/2026	211.478	0,10	USD	289.000	Owens-Brockway 5.88% 15/08/2023	308.141	0,15
USD	579.000	Informatica LLC P.P. 144A 7.13% 15/07/2023	590.520	0,28	USD	418.000	Par Pharmaceutical Inc. 7.50% 01/04/2027	382.701	0,18
USD	432.000	IQVIA Inc. 5.00% 15/05/2027	453.924	0,22	USD	1.224.000	Parsley Energy LLC 5.25% 15/08/2025	1.242.770	0,60
USD	604.000	IRB Holding 6.75% 15/02/2026	609.422	0,29	USD	823.000	Parsley Energy LLC 5.63% 15/10/2027	851.919	0,41
USD	545.000	Iron Mountain Inc. 4.88% 15/09/2029	554.415	0,26	USD	419.000	Pdc Energy Inc. 6.13% 15/09/2024	418.738	0,20
USD	551.000	Jagged Peak Energy LLC 5.88% 01/05/2026	553.066	0,26	USD	335.000	Performance Food Group Inc. 5.50% 15/10/2027	353.006	0,17
USD	967.000	Jaguar Holding Company 6.38% 01/08/2023	1.002.356	0,48	USD	644.000	PetSmart Inc. 5.88% 01/06/2025	643.598	0,31
USD	689.000	Kar Auction Services Inc. 5.13% 01/06/2025	714.838	0,34	USD	447.000	PetSmart Inc. P.P. 144A 7.13% 15/03/2023	419.995	0,20
USD	50.000	Lennar Corp 5.25% 01/06/2026	54.307	0,03	USD	559.000	Post Holdings Inc. 5.00% 15/08/2026	580.896	0,27
USD	116.000	Marriott Ownership Resorts Inc. 4.75% 15/01/2028	117.305	0,06	USD	258.000	Post Holdings Inc. 5.50% 15/12/2029	269.650	0,13
USD	879.000	Matador Resources Company 5.88% 15/09/2026	882.318	0,42	USD	11.000	Post Holdings Inc. 5.63% 15/01/2028	11.660	0,01
USD	425.000	Mattel Inc. 6.75% 31/12/2025	443.993	0,21	USD	2.025.000	Post Holdings Inc. 5.75% 01/03/2027	2.149.399	1,01
USD	654.000	Mauser Packaging Solutions Holding Company 5.50% 15/04/2024	673.996	0,32	USD	621.000	PQ Corp. 5.75% 15/12/2022	642.541	0,31
USD	214.000	MGM Growth Properties 4.50% 15/01/2028	222.293	0,11	USD	819.000	PQ Corp. 6.75% 15/11/2022	848.689	0,40
					USD	220.000	Prestige Brands Inc. 5.38% 15/12/2021	221.801	0,11

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD	766.000 Prestige Brands Inc. 6.38% 01/03/2024	800.158	0,37	USD	110.000 Tallgrass Energy Partners 5.50% 15/09/2024	109.588	0,05
USD	289.000 Qorvo Inc. 4.38% 15/10/2029	291.168	0,14	USD	542.000 Tallgrass Energy Partners 5.50% 15/01/2028	530.428	0,25
USD	1.217.000 Qualitytech LP 4.75% 15/11/2025	1.255.538	0,60	USD	918.000 Tallgrass Energy Partners LP 4.75% 01/10/2023	920.869	0,44
USD	1.032.000 Quicken Loans Inc. P.P. 144A 5.75% 01/05/2025	1.067.593	0,52	USD	981.000 Targa Resources 5.38% 01/02/2027	1.017.788	0,48
USD	314.000 Radiate Holdco 6.88% 15/02/2023	323.682	0,15	USD	302.000 Targa Resources Partners LP 4.25% 15/11/2023	304.831	0,15
USD	245.000 Radiate Holdco LLC 6.63% 15/02/2025	247.285	0,12	USD	1.431.000 Targa Resources Partners LP 5.00% 15/01/2028	1.448.314	0,69
USD	737.000 Refinitiv US Holdings Inc. 6.25% 15/05/2026	792.275	0,38	USD	113.000 Targa Resources Partners LP 6.50% 15/07/2027	123.576	0,06
USD	744.000 Refinitiv US Holdings Inc. 8.25% 15/11/2026	821.654	0,40	USD	645.000 Taylor Morrison 5.88% 15/04/2023	690.150	0,33
USD	318.000 Resideo Funding Inc. 6.13% 01/11/2026	336.381	0,16	USD	313.000 Taylor Morrison Communities Inc. 5.75% 15/01/2028	340.805	0,16
USD	1.370.000 Reynolds Group Issuer Inc. 5.13% 15/07/2023	1.407.512	0,67	USD	463.000 Tegna Inc. 5.00% 15/09/2029	469.366	0,22
USD	774.000 Reynolds Group Issuer Inc. 7.00% 15/07/2024	803.798	0,38	USD	677.000 Tempo Acquisition LLC 6.75% 01/06/2025	697.936	0,33
USD	275.000 Ryman Hospitality Properties Inc. 4.75% 15/10/2027	282.654	0,13	USD	715.000 Tenet Healthcare Corp 4.88% 01/01/2026	736.301	0,35
USD	750.000 SBA Communications 4.88% 15/07/2022	760.950	0,36	USD	1.227.000 Tenet Healthcare Corp 5.13% 01/11/2027	1.267.919	0,59
USD	722.000 SBA Communications 4.88% 01/09/2024	749.704	0,36	USD	815.000 Tenet Healthcare Corp 6.25% 01/02/2027	849.699	0,40
USD	798.000 Scientific Games International Inc. 5.00% 15/10/2025	824.872	0,40	USD	610.000 Terraform Power Operating LLC 5.00% 31/01/2028	637.069	0,30
USD	577.000 Scientific Games International Inc. 8.25% 15/03/2026	615.226	0,29	USD	1.468.000 TransDigm Inc. 6.25% 15/03/2026	1.580.008	0,75
USD	180.000 Scripps Escrow Inc. 5.88% 15/07/2027	183.038	0,09	USD	805.000 Transmontaigne Partners LP 6.13% 15/02/2026	778.838	0,37
USD	510.000 Select Medical Corp 6.25% 15/08/2026	535.819	0,26	USD	616.000 Uber Technologies Inc. 7.50% 15/09/2027	615.230	0,29
USD	146.000 Sensata Technologies Inc. 4.38% 15/02/2030	146.091	0,07	USD	53.000 USI Inc. 6.88% 01/05/2025	53.794	0,03
USD	204.000 SESI LLC 7.75% 15/09/2024	117.051	0,06	USD	536.000 Valvoline Inc. 5.50% 15/07/2024	558.445	0,27
USD	239.000 Sirius XM Radio Inc. 4.63% 15/07/2024	248.213	0,12	USD	511.000 Verscend Escrow Corp. 9.75% 15/08/2026	545.426	0,26
USD	1.061.000 Sirius XM Radio Inc. P.P. 144A 5.38% 15/04/2025	1.101.930	0,52	USD	196.000 ViaSat Inc. 5.63% 15/04/2027	207.045	0,10
USD	149.000 Sophia LP P.P. 144A 9.00% 30/09/2023	153.108	0,07	USD	236.000 Vistra Operations Co LLC 5.50% 01/09/2026	247.756	0,12
USD	849.000 Sotera Health Holdings LLC 6.50% 15/05/2023	870.756	0,41	USD	348.000 Vistra Operations Company LLC 5.00% 31/07/2027	359.153	0,17
USD	235.000 Stevens Holding Company Inc. 6.13% 01/10/2026	251.132	0,12	USD	725.000 Vistra Operations Company LLC 5.63% 15/02/2027	765.274	0,36
USD	297.000 Sunoco LP 4.88% 15/01/2023	305.353	0,15	USD	547.000 WellCare Health Plans Inc. 5.38% 15/08/2026	584.155	0,28
USD	652.000 Sunoco LP 5.50% 15/02/2026	679.308	0,32	USD	131.000 West Street Merger Sub Inc. 6.38% 01/09/2025	121.563	0,06

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)				Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Aktien					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN					
USD	666.000	Wynn Las Vegas LLC 5.50% 01/03/2025	700.133	0,33	2.118.000	CB T-Mobile USA Inc.	0	0,00	
USD	185.000	Wynn Resorts Finance LLC 5.13% 01/10/2029	194.180	0,09	998.000	CB T-Mobile USA Inc.	0	0,00	
USD	303.000	XPO Logistics Inc. P.P. 144A 6.50% 15/06/2022	308.871	0,15	546.000	T-Mobile	0	0,00	
USD	238.000	Yum! Brands Inc. 4.75% 15/01/2030	245.884	0,12	683.000	T-Mobile	0	0,00	
USD	417.000	Zayo Group LLC 5.75% 15/01/2027	427.321	0,20	Summe Vereinigte Staaten			0	0,00
USD	292.000	Zekelman Industries 9.88% 15/06/2023	308.425	0,15	Summe Aktien			0	0,00
Summe Vereinigte Staaten			113.737.835	54,21	Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			2.093.663	1,01
Summe Anleihen			135.140.539	64,38	Wert der Anlagen insgesamt			206.081.660	98,18
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				135.140.539	64,38	(Gesamtkosten: USD 201.050.761)			

Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

Anleihen

VEREINIGTE STAATEN

USD	95.000	AMN Healthcare Inc. 4.63% 01/10/2027	95.772	0,05
USD	312.000	Beacon Roofing Supply Inc. 4.50% 15/11/2026	315.120	0,15
USD	111.000	MTS Systems Corp 5.75% 15/08/2027	115.671	0,06
USD	533.000	Pattern Energy Group Inc. 5.88% 01/02/2024	549.847	0,26
USD	789.000	Provident Funding Associates LP 6.38% 15/06/2025	768.289	0,37
USD	102.000	Trimas Corp. 4.88% 15/10/2025	104.040	0,05
USD	140.000	Vhf Parent LLC 6.75% 15/06/2022	144.924	0,07
Summe Vereinigte Staaten			2.093.663	1,01
Summe Anleihen			2.093.663	1,01

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
BAHAMAS				INDIEN (Fortsetzung)					
USD	500.000	Competition Team Technologies Limited 3.75% 12/03/2024	516.728	1,21	USD	500.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	524.822	1,23
USD	200.000	Competition Team Technologies Limited 4.25% 12/03/2029	214.264	0,50	USD	500.000	ReNew Power Limited 6.45% 27/09/2022	505.682	1,18
		Summe Bahamas	730.992	1,71			Summe Indien	2.260.582	5,28
BERMUDAS				INDONESIEN					
USD	200.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	204.406	0,48	USD	900.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.53% 15/11/2028	1.101.735	2,57
USD	500.000	Li & Fung Limited 4.38% 04/10/2024	500.248	1,17	USD	500.000	Perusahaan Listrik Negara PT 5.45% 21/05/2028	575.928	1,34
		Summe Bermudas	704.654	1,65			Summe Indonesien	1.677.663	3,91
KAIMANINSELN				ISLE OF MAN					
USD	800.000	Alibaba Group Holding Limited 3.40% 06/12/2027	830.029	1,94	USD	500.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	521.877	1,22
USD	400.000	Baidu Inc. 4.88% 14/11/2028	450.417	1,05			Summe Isle of Man	521.877	1,22
USD	200.000	China Overseas Finance Cayman VII Limited 4.25% 26/04/2023	209.977	0,49	MALAYSIA				
USD	600.000	Lenovo Perpetual Securities Limited Perp FRN	590.250	1,38	USD	500.000	Malayan Banking Bhd FRN 29/10/2026	508.780	1,19
USD	500.000	Longfor Group Holdings Limited 3.95% 16/09/2029	490.516	1,14	USD	500.000	Press Metal Labuan Limited 4.80% 30/10/2022	481.552	1,12
USD	600.000	MGM China Holdings Limited 5.38% 15/05/2024	620.995	1,45	USD	650.000	TNB Global Ventures Capital Bhd 4.85% 01/11/2028	740.312	1,74
USD	600.000	Sands China Limited 5.40% 08/08/2028	677.613	1,58			Summe Malaysia	1.730.644	4,05
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 4.53% 11/04/2049	239.500	0,56	MAURITIUS				
USD	350.000	Times China Holdings Limited 10.95% 27/11/2020	371.848	0,87	USD	220.000	Azure Power Solar Energy Pvt Limited 5.65% 24/12/2024	220.550	0,51
		Summe Kaimaninseln	4.481.145	10,46			Summe Mauritius	220.550	0,51
HONGKONG				NIEDERLANDE					
USD	500.000	CNAC HK Finbridge Company Limited 3.38% 19/06/2024	504.557	1,18	USD	400.000	Greenko Dutch BV 5.25% 24/07/2024	402.000	0,94
USD	250.000	CNAC HK Finbridge Company Limited 5.13% 14/03/2028	281.132	0,66	USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	254.894	0,59
		Summe Hongkong	785.689	1,84			Summe Niederlande	656.894	1,53
INDIEN				SÜDKOREA					
USD	800.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	831.893	1,94	USD	700.000	Shinhan Financial Group Company Limited Perp FRN	753.265	1,76
USD	200.000	Delhi International Airport Limited 6.45% 04/06/2029	212.109	0,50			Summe Südkorea	753.265	1,76
USD	200.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	186.076	0,43					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					
SINGAPUR				INDONESIEN (Fortsetzung)					
USD	250.000	Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	186.173	0,43	USD	200.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	271.632	0,63
USD	200.000	Medco Oak Tree Pte Limited 7.38% 14/05/2026	202.371	0,47	IDR	5.500.000.000	Indonesia (Govt of) 7.50% 15/08/2032	382.825	0,89
		Summe Singapur	388.544	0,90	IDR	5.500.000.000	Indonesia (Govt of) 7.50% 15/05/2038	380.655	0,89
THAILAND				USD 300.000 Indonesia (Govt of) 7.75% 17/01/2038				451.741	1,05
USD	400.000	Bangkok Bank plc FRN 25/09/2034	405.358	0,95	IDR	21.000.000.000	Indonesia (Govt of) 8.25% 15/05/2029	1.572.579	3,67
		Summe Thailand	405.358	0,95	IDR	5.000.000.000	Indonesia (Govt of) 8.25% 15/05/2036	364.640	0,85
VEREINIGTES KÖNIGREICH				IDR 22.000.000.000 Indonesia (Govt of) 8.38% 15/03/2034				1.636.962	3,82
SGD	1.000.000	HSBC Holdings plc Perp FRN	740.560	1,72	IDR	19.000.000.000	Indonesia (Govt of) 8.38% 15/04/2039	1.404.641	3,28
USD	200.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	184.709	0,43	USD	300.000	Perusahaan Penerbit Sbsn Indonesia 4.35% 10/09/2024	322.744	0,75
		Summe Vereinigtes Königreich	925.269	2,15			Summe Indonesien	12.835.156	29,96
BRITISCHE JUNGFERNINSELN				MONGOLEI					
USD	350.000	Bluestar Finance Holdings Limited Perp FRN	369.676	0,86	USD	800.000	Mongolia (Govt of) 5.63% 01/05/2023	810.183	1,89
USD	250.000	CNOOC Finance 2013 Limited 2.88% 30/09/2029	249.285	0,58			Summe Mongolei	810.183	1,89
USD	250.000	ENN Clean Energy International Investment Limited 7.50% 27/02/2021	257.813	0,60	PAKISTAN				
USD	311.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	309.206	0,72	USD	550.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	595.769	1,39
USD	400.000	Sinopec Group Overseas Development 2017 Limited 3.25% 13/09/2027	411.225	0,96	USD	250.000	Third Pakistan International Sukuk Company Limited 5.63% 05/12/2022	250.862	0,59
		Summe Britische Jungfernseln	1.597.205	3,72			Summe Pakistan	846.631	1,98
Summe Anleihen			17.840.331	41,64	SRI LANKA				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				USD 750.000 Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/04/2023				746.977	1,74
INDONESIEN				USD 750.000 Sri Lanka (Govt of) 6.75% 18/04/2028				718.502	1,68
USD	500.000	Indonesia (Govt of) 3.50% 11/01/2028	518.217	1,21	USD	450.000	Sri Lanka (Govt of) 6.83% 18/07/2026	445.886	1,04
USD	750.000	Indonesia (Govt of) 4.13% 15/01/2025	799.381	1,87	USD	450.000	Sri Lanka (Govt of) 7.55% 28/03/2030	445.216	1,04
USD	1.750.000	Indonesia (Govt of) 4.35% 11/01/2048	1.927.626	4,51			Summe Sri Lanka	2.356.581	5,50
USD	1.500.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 11/02/2029	1.712.159	4,00					
USD	850.000	Indonesia (Govt of) 5.35% 11/02/2049	1.089.354	2,54					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere					
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					
THAILAND				MALAYSIA					
THB	20.000.000	Thailand (Govt of) 1.45% 17/12/2024	657.729	1,54	MYR	3.500.000	Malaysia (Govt of) 4.37% 31/10/2028	893.177	2,08
THB	15.000.000	Thailand (Govt of) 2.88% 17/06/2046	606.194	1,42	MYR	3.500.000	Malaysia (Govt of) 4.76% 04/08/2037	947.401	2,21
THB	30.000.000	Thailand (Govt of) 3.30% 17/06/2038	1.263.834	2,95			Summe Malaysia	1.840.578	4,29
		Summe Thailand	2.527.757	5,91					
VIETNAM				PHILIPPINEN					
USD	400.000	Vietnam (Govt of) 6.75% 29/01/2020	406.143	0,95	PHP	40.000.000	Philippines (Govt of) 5.75% 12/04/2025	810.618	1,89
		Summe Vietnam	406.143	0,95	PHP	25.000.000	Philippines (Govt of) 6.75% 24/01/2039	582.606	1,36
		Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	19.782.451	46,19	PHP	20.000.000	Philippines (Govt of) 8.00% 19/07/2031	488.582	1,14
		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	37.622.782	87,83			Summe Philippinen	1.881.806	4,39
							Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	3.722.384	8,68
							Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt	3.722.384	8,68
							Wert der Anlagen insgesamt	41.345.166	96,51
							(Gesamtkosten: USD 38.443.429)		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren (Fortsetzung)						
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Fonds (Fortsetzung)						
INDONESIEN				LUXEMBURG						
IDR	4.650.000.000	Indonesia (Govt of) 7.00% 15/09/2030	294.043	1,21	57.160	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio XU*	732.985	3,02		
IDR	5.200.000.000	Indonesia (Govt of) 8.25% 15/05/2029	357.183	1,47	13.514	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity Fund XUP*	143.326	0,59		
Summe Indonesien			651.226	2,68	1.626.586	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond 8E*	2.894.674	11,91		
VEREINIGTE STAATEN				161.932 Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond 4E*				1.719.575	7,08	
USD	775.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.13% 15/04/2022	742.728	3,06	349.391	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities IE*	3.531.159	14,53		
USD	80.000	United States Treasury Inflation Indexed N/B FRN 15/02/2041	114.836	0,47	69.481	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies 4E*	691.735	2,85		
USD	550.000	United States Treasury Inflation Indexed N/B 2.52% 15/02/2040	793.315	3,27	4.699	Threadneedle (Lux) - European Short Term High Yield Bond XE*	472.524	1,95		
Summe Vereinigte Staaten			1.650.879	6,80	Summe Luxemburg			10.185.978	41,93	
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				2.302.105	9,48	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
Aktien				241.897 Threadneedle Investment Funds ICVC - European Select Fund**				427.967	1,76	
GUERNSEY - KANALINSELN				62.532 Threadneedle Investment Funds ICVC - American Fund **				306.236	1,26	
	572.358	UK Commercial Property REIT Limited	543.447	2,24	515.467	Threadneedle Investment Funds ICVC - Asia Fund**	1.042.660	4,29		
Summe Guernsey - Kanalinseln			543.447	2,24	262.666	Threadneedle Investment Funds ICVC - European Fund**	441.821	1,82		
Summe Aktien				543.447	2,24	1.437.465	Threadneedle Investment Funds ICVC - Japan Fund**	2.560.730	10,53	
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				2.845.552	11,72	465.148	Threadneedle Investment Funds ICVC - UK Fund**	700.177	2,88	
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren				1.859.775 Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Sterling Short-Dated Corp. Bond Fund**				2.348.139	9,67	
Fonds				Summe Vereinigtes Königreich				7.827.730	32,21	
IRLAND				Summe Fonds				18.777.005	77,28	
	7.652	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	763.297	3,14	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren				18.777.005	77,28
Summe Irland			763.297	3,14	Wert der Anlagen insgesamt				21.622.557	89,00
				(Gesamtkosten: EUR 20.814.826)						

*Siehe Erläuterung 18.

**Fonds der verbundenen Partei.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher örsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Aktien (Fortsetzung)			
INDONESIEN				FRANKREICH			
IDR 12.000.000.000	Indonesia (Govt of) 8.25% 15/05/2029	898.617	1,59	2.214	EssilorLuxottica SA	319.212	0,56
				668	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	265.558	0,47
				1.970	Pernod-Ricard SA	350.933	0,62
	Summe Indonesien	898.617	1,59		Summe Frankreich	935.703	1,65
VEREINIGTE STAATEN				DEUTSCHLAND			
USD 1.000.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.13% 15/04/2022	1.044.803	1,85	1.637	Adidas AG	509.787	0,90
USD 1.401.800	United States Treasury Inflation Indexed N/B 2.52% 15/02/2040	2.204.326	3,90		Summe Deutschland	509.787	0,90
	Summe Vereinigte Staaten	3.249.129	5,75		HONGKONG		
				25.400	Aia Group Limited	239.926	0,42
	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	4.147.746	7,34		Summe Hongkong	239.926	0,42
Aktien				INDIEN			
BERMUDAS							
5.565	IHS Markit Limited	372.187	0,65	9.972	HDFC Bank Limited - ADR	568.903	1,01
	Summe Bermudas	372.187	0,65		Summe Indien	568.903	1,01
KANADA				INDONESIEN			
9.754	Suncor Energy Inc.	308.031	0,54	1.130.700	Bank Rakyat Indonesia	328.190	0,58
	Summe Kanada	308.031	0,54		Summe Indonesien	328.190	0,58
KAIMANINSELN				IRLAND			
2.373	Alibaba Group Holding Limited	396.837	0,70	10.050	CRH plc	346.116	0,61
8.900	Tencent Holdings Limited	374.874	0,66	3.486	Ingersoll-Rand plc	429.510	0,76
	Summe Kaimaninseln	771.711	1,36	2.429	Medtronic Inc.	263.838	0,47
CHINA				JAPAN			
26.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	304.402	0,54	500	Keyence Corp.	309.507	0,55
	Summe China	304.402	0,54	1.200	Nintendo Company Limited	444.358	0,79
				3.700	Rohm Company Limited	282.443	0,50
DÄNEMARK				Summe Japan			
4.723	Novo-Nordisk A/S	242.854	0,43		1.036.308	1,84	
	Summe Dänemark	242.854	0,43	JERSEY - KANALINSELN			
FINNLAND				2.804			
6.502	Upm-Kymmene Oyj	192.240	0,34		Ferguson plc	205.387	0,36
	Summe Finnland	192.240	0,34		Summe Jersey - Kanalinseln	205.387	0,36
				NIEDERLANDE			
				2.122			
				1.703			
				Lyondellbasell Industries NV - A			
				189.855			
				NXP Semiconductor NV			
				185.831			
				0,33			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
NIEDERLANDE (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
18.265	RELX plc	434.690	0,77	3.029	Eog Resources Inc.	224.812	0,40
	Summe Niederlande	810.376	1,44	950	Equinix Inc.	547.960	0,97
SÜDKOREA				1.671	Estee Lauder Companies Inc.	332.445	0,59
11.986	Samsung Electronics Company Limited	491.507	0,87	3.041	Facebook Inc. - A	541.541	0,96
	Summe Südkorea	491.507	0,87	1.989	Fidelity National Information Services Inc.	264.060	0,47
SPANIEN				5.054	Gilead Sciences Inc.	320.323	0,57
7.738	Industria de Diseno Textil SA	239.581	0,42	9.979	Halliburton Company	188.104	0,33
	Summe Spanien	239.581	0,42	1.189	Illumina Inc.	361.718	0,64
SCHWEIZ				5.570	JPMorgan Chase & Company	655.533	1,15
2.070	TE Connectivity Limited	192.883	0,34	1.208	Lam Research Corp.	279.181	0,49
	Summe Schweiz	192.883	0,34	2.607	Mastercard Inc. - A	707.983	1,25
VEREINIGTES KÖNIGREICH				6.731	Microsoft Corp.	935.812	1,66
1.761	Aon plc	340.876	0,60	843	NextEra Energy Inc.	196.411	0,35
9.520	Diageo plc	391.011	0,69	1.429	Nvidia Corp.	248.746	0,44
2.260	Reckitt Benckiser Group plc	176.680	0,31	1.241	S&P Global Inc.	304.020	0,54
8.606	Unilever plc	518.593	0,92	6.283	Service Corp. International	300.390	0,53
	Summe Vereinigtes Königreich	1.427.160	2,52	1.812	Stryker Corp.	391.936	0,70
VEREINIGTE STAATEN				3.037	Transunion	246.331	0,44
7.744	Activision Blizzard Inc.	409.812	0,73	3.006	Trex Company Inc.	273.336	0,48
1.207	Adobe Inc.	333.434	0,59	1.016	Tyler Technologies Inc.	266.700	0,47
855	Alphabet Inc. - A	1.044.075	1,84	2.973	Union Pacific Corp.	481.567	0,85
110	Alphabet Inc. - C	134.090	0,24	815	UnitedHealth Group Inc.	177.116	0,31
416	Amazon.com Inc.	722.138	1,28	2.209	Vertex Pharmaceuticals Inc.	374.248	0,66
2.875	Amphenol Corp.	277.437	0,49	3.756	Visa Inc. - A	646.070	1,14
3.201	Baxter International Inc.	279.991	0,49		Summe Vereinigte Staaten	15.289.770	27,04
1.525	Becton Dickinson & Company	385.764	0,68		Summe Aktien	25.506.370	45,09
8.560	Centene Corp.	370.306	0,66	Strukturierte Instrumente - Rohstoffe			
5.086	Charles Schwab Corp.	212.747	0,38	IRLAND			
1.483	CME Group Inc.	313.417	0,55	1.691	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	241.348	0,43
7.428	Comcast Corp.	334.854	0,59		Summe Irland	241.348	0,43
1.102	Cooper Companies Inc.	327.294	0,58		Summe Strukturierte Instrumente - Rohstoffe	241.348	0,43
3.203	Diamondback Energy Inc.	287.982	0,51		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	29.895.464	52,86
1.604	Ecolab Inc.	317.657	0,56				
2.785	Electronic Arts Inc.	272.429	0,48				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			
VEREINIGTE STAATEN			
USD	4.144.700 United States Treasury Bill 0.00% 03/10/2019	4.144.311	7,33
USD	5.500.000 United States Treasury Bill 0.00% 07/11/2019	5.490.153	9,69
USD	2.900.000 United States Treasury Bill 0.00% 05/12/2019	2.890.533	5,11
	Summe Vereinigte Staaten	12.524.997	22,13
	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	12.524.997	22,13
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt			
		12.524.997	22,13
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
LUXEMBURG			
88.447	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio XU*	1.236.503	2,19
114.491	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds AU*	2.037.717	3,60
196.894	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities IUH*	2.072.704	3,66
	Summe Luxemburg	5.346.924	9,45
	Summe Fonds	5.346.924	9,45
	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	5.346.924	9,45
	Wert der Anlagen insgesamt	47.767.385	84,44
(Gesamtkosten: USD 41.970.575)			

*Siehe Erläuterung 18.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts				
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)							
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)							
BELGIEN				FRANKREICH (Fortsetzung)							
EUR	239.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	267.384	0,10	EUR	100.000	Crown European Holdings 2.63% 30/09/2024	117.716	0,04		
EUR	600.000	Solvay SA Perp FRN	722.738	0,27	EUR	100.000	Crown European Holdings 3.38% 15/05/2025	121.219	0,05		
		Summe Belgien	990.122	0,37	EUR	325.000	Crown European Holdings 4.00% 15/07/2022	387.516	0,15		
KANADA				EUR				300.000	Crown European Holdings SA 2.25% 01/02/2023	345.539	0,13
EUR	301.000	Bausch Health Cos Inc. 4.50% 15/05/2023	332.416	0,13	EUR	330.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	391.411	0,15		
EUR	195.000	Cott Corp. 5.50% 01/07/2024	221.995	0,08	EUR	300.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	327.116	0,12		
		Summe Kanada	554.411	0,21	EUR	100.000	Elis SA 1.63% 03/04/2028	109.138	0,04		
KAIMANINSELN				EUR				500.000	Elis SA 1.75% 11/04/2024	565.857	0,21
GBP	415.000	Petrobras International Finance Company 6.25% 14/12/2026	606.550	0,23	EUR	300.000	Elis SA 1.88% 15/02/2023	339.608	0,13		
EUR	90.000	UPCB Finance IV Limited 4.00% 15/01/2027	103.855	0,04	EUR	200.000	Elis SA 2.88% 15/02/2026	239.531	0,09		
EUR	110.000	UPCB Finance VII 3.63% 15/06/2029	127.549	0,05	EUR	144.000	Faurecia SE 3.13% 15/06/2026	166.899	0,06		
		Summe Kaimaninseln	837.954	0,32	EUR	205.000	Getlink SE 3.63% 01/10/2023	233.656	0,09		
FINNLAND				EUR				264.000	La Financiere Atalian 4.00% 15/05/2024	212.612	0,08
EUR	189.000	Nokia Oyj 2.00% 11/03/2026	217.169	0,08	EUR	190.000	La Financiere Atalian 5.13% 15/05/2025	152.421	0,06		
EUR	100.000	Stora Enso Oyj 2.50% 07/06/2027	119.749	0,05	EUR	200.000	Louvre Bidco SAS 4.25% 30/09/2024	222.325	0,08		
		Summe Finnland	336.918	0,13	EUR	160.000	Louvre Bidco SAS FRN 30/09/2024	177.288	0,07		
FRANKREICH				EUR				482.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	542.162	0,20
EUR	200.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	221.674	0,08	EUR	235.000	Loxam SAS 3.75% 15/07/2026	266.007	0,10		
EUR	349.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	387.322	0,15	EUR	100.000	Orange SA Perp FRN	114.399	0,04		
EUR	180.000	Altice France SA 5.63% 15/05/2024	202.565	0,08	EUR	346.000	Orange SA Perp FRN	460.435	0,17		
EUR	1.182.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	1.429.758	0,54	EUR	100.000	Orano SA 3.25% 04/09/2020	111.987	0,04		
EUR	800.000	Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	808.093	0,31	EUR	200.000	Orano SA 3.38% 23/04/2026	235.118	0,09		
EUR	200.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.05% 05/08/2026	191.497	0,07	EUR	200.000	Orano SA 3.50% 22/03/2021	227.955	0,09		
EUR	200.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.56% 25/01/2023	208.562	0,08	EUR	460.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	471.965	0,18		
EUR	400.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	408.137	0,15	EUR	160.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2025	178.560	0,07		
EUR	100.000	CMA CGM SA 5.25% 15/01/2025	78.052	0,03	EUR	322.000	Rexel SA 2.75% 15/06/2026	367.425	0,14		
EUR	100.000	Constantin Investissement 3 SASU 5.38% 15/04/2025	112.829	0,05	EUR	465.000	Solvay Finance SA Perp FRN	546.568	0,21		
EUR	250.000	Credit Agricole SA Perp FRN	295.024	0,11	EUR	300.000	SPCM SA 2.88% 15/06/2023	330.832	0,13		
					EUR	300.000	Spie SA 3.13% 22/03/2024	352.855	0,13		
					EUR	200.000	Spie SA 2.63% 18/06/2026	227.344	0,09		
							Summe Frankreich	12.886.977	4,88		
				DEUTSCHLAND							
				EUR	175.000	Adler Real Estate AG 1.50% 06/12/2021	194.047	0,07			
				EUR	510.000	Adler Real Estate AG 2.13% 06/02/2024	571.640	0,22			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
JAPAN					LUXEMBURG (Fortsetzung)				
EUR	255.000	SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	298.490	0,11	EUR	121.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	139.273	0,05
EUR	640.000	SoftBank Group Corp 5.00% 15/04/2028	777.949	0,29	EUR	216.000	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	250.919	0,09
EUR	100.000	SoftBank Group Corp 5.00% 15/04/2028	121.555	0,05	EUR	125.000	Codere Finance 2 Luxembourg SA 6.75% 01/11/2021	134.956	0,05
EUR	130.000	Softbank Group Corp. 4.00% 19/09/2029	146.871	0,06	EUR	196.000	CPI Property Group SA Perp FRN	219.140	0,08
		Summe Japan	1.344.865	0,51	EUR	208.000	CPI Property Group SA Perp FRN	237.406	0,09
					EUR	399.000	Crystal Almond Sarl 10.00% 01/11/2021	450.072	0,17
JERSEY - KANALINSELN					EUR	325.000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 4.75% 22/03/2021	378.409	0,14
EUR	175.000	Avis Budget Finance plc 4.50% 15/05/2025	201.257	0,08	EUR	430.000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 4.75% 15/07/2022	526.421	0,19
EUR	454.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	529.817	0,20	EUR	381.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.50% 01/08/2022	396.924	0,15
GBP	200.000	Cpuk Finance Limited 4.25% 28/08/2022	251.901	0,10	GBP	363.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 8.50% 01/11/2022	422.178	0,16
GBP	200.000	Cpuk Finance Limited 4.88% 28/08/2025	254.670	0,10	EUR	330.000	Gestamp Fund Lux 3.50% 15/05/2023	366.429	0,14
EUR	710.000	Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	807.744	0,31	EUR	600.000	Grand City Properties SA Perp FRN	699.511	0,26
		Summe Jersey - Kanalinseln	2.045.389	0,79	EUR	108.000	Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	113.874	0,04
LUXEMBURG					EUR	600.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	734.362	0,28
EUR	125.000	Altice Financing SA 5.25% 15/02/2023	140.592	0,05	EUR	345.000	Holcim Finance Luxembourg SA Perp FRN	395.914	0,15
USD	200.000	Altice Financing SA 6.63% 15/02/2023	205.538	0,08	EUR	597.000	Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/02/2022	666.948	0,25
USD	221.000	Altice Finco SA 8.13% 15/01/2024	228.617	0,09	EUR	215.000	Ineos Group Holdings SA 5.38% 01/08/2024	240.660	0,09
EUR	244.000	Altice Finco SA 9.00% 15/06/2023	276.788	0,10	EUR	350.000	Intralot Capital Lux 5.25% 15/09/2024	184.384	0,07
EUR	300.000	Altice Luxembourg SA 6.25% 15/02/2025	342.397	0,13	EUR	200.000	Leonardo SpA 4.50% 19/01/2021	230.341	0,09
EUR	242.981	Altice Luxembourg SA 7.25% 15/05/2022	270.647	0,10	EUR	280.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	316.021	0,12
EUR	1.064.000	Altice Luxembourg SA 8.00% 15/05/2027	1.277.271	0,48	EUR	100.000	LSF10 Wolverine Investments SCA FRN 15/03/2024	109.812	0,04
EUR	340.000	Aramark International Finance 3.13% 01/04/2025	383.204	0,14	EUR	300.000	LSF10 Wolverine Investments SCA 5.00% 15/03/2024	336.818	0,13
EUR	332.000	ARD Finance SA 6.63% 15/09/2023	375.065	0,14	EUR	338.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	376.713	0,14
EUR	320.000	Arena Luxembourg Finance SarL FRN 01/11/2023	352.530	0,13	EUR	100.000	Picard Bondco SA 5.50% 30/11/2024	106.266	0,04
EUR	100.000	Arena Luxembourg Finance SarL 2.88% 01/11/2024	113.814	0,04	EUR	264.000	Swissport Financing Sarl 5.25% 15/08/2024	299.031	0,10
EUR	200.000	BMBG Bond Finance SCA 3.00% 15/06/2021	219.529	0,08					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
SUPRANATIONAL				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
EUR	146.000	Ardagh Packaging Finance plc 2.13% 15/08/2026	163.660	0,06	EUR	225.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	265.461	0,10
		Summe Supranational	163.660	0,06	EUR	265.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	307.787	0,12
SCHWEDEN				GBP					
EUR	778.000	Akelius Residential AB FRN 05/10/2078	911.578	0,35	GBP	815.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	1.011.165	0,38
EUR	474.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	526.709	0,20	GBP	425.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	461.969	0,17
EUR	115.000	Volvo Car AB 2.00% 24/01/2025	130.302	0,05	EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	93.151	0,04
EUR	366.000	Volvo Car AB 2.13% 02/04/2024	416.518	0,16	GBP	200.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.75% 24/01/2021	232.744	0,09
		Summe Schweden	1.985.107	0,76	EUR	450.000	Merlin Entertainments plc 2.75% 15/03/2022	521.968	0,19
SCHWEIZ				GBP					
EUR	200.000	UBS AG FRN 12/02/2026	231.448	0,09	GBP	100.000	Miller Homes 5.50% 15/10/2024	126.123	0,05
		Summe Schweiz	231.448	0,09	EUR	100.000	OTE plc 0.88% 24/09/2026	108.984	0,04
VEREINIGTES KÖNIGREICH				EUR					
EUR	144.000	Algeco Global Finance plc 6.50% 15/02/2023	158.382	0,06	EUR	200.000	OTE plc 3.50% 09/07/2020	223.722	0,08
GBP	436.000	Ardonagh Midco 3 Plc 8.38% 15/07/2023	517.507	0,20	GBP	514.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	675.986	0,26
GBP	250.000	Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	329.686	0,12	USD	100.000	Royal Bank of Scotland 6.13% 15/12/2022	108.272	0,04
GBP	625.000	Arrow Global Finance 5.13% 15/09/2024	768.605	0,29	USD	440.000	Royal Bank of Scotland Perp 8.63%	471.724	0,17
GBP	125.000	Boparan Finance plc 5.50% 15/07/2021	95.877	0,04	GBP	287.000	Shop Direct 7.75% 15/11/2022	313.939	0,12
GBP	335.000	Co-operative Group FRN 08/07/2026	469.495	0,18	GBP	414.000	Stonegate Pub Company Financing plc FRN 15/03/2022	516.319	0,19
GBP	167.000	Co-operative Group 5.13% 17/05/2024	217.016	0,08	EUR	125.000	Tesco Corporate Treasury Services plc 2.50% 01/07/2024	147.264	0,06
GBP	200.000	Drax Finco plc 4.25% 01/05/2022	250.947	0,09	EUR	100.000	Tesco Corporate Treasury Services plc 1.38% 24/10/2023	112.564	0,04
EUR	600.000	EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	662.416	0,25	GBP	121.000	Tesco Corporate Treasury Services plc 2.50% 02/05/2025	151.888	0,06
EUR	115.000	EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	126.963	0,05	GBP	63.000	Tesco plc 6.13% 24/02/2022	86.448	0,03
GBP	383.000	El Group plc 7.50% 15/03/2024	506.617	0,19	GBP	684.838	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	1.238.396	0,48
USD	703.697	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	581.430	0,22	GBP	100.000	Travis Perkins 4.50% 07/09/2023	130.443	0,05
GBP	70.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	97.790	0,04	EUR	357.000	Victoria plc 5.25% 15/07/2024	401.337	0,15
GBP	200.000	GKN Holdings plc 4.63% 12/05/2032	251.289	0,09	EUR	300.000	Virgin Media Finance plc 4.50% 15/01/2025	338.048	0,13
GBP	100.000	Heathrow Finance plc 3.88% 01/03/2027	123.428	0,05	GBP	131.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	170.324	0,06
EUR	446.000	Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	481.607	0,18	GBP	100.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.13% 15/01/2025	127.676	0,05
EUR	233.000	International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	254.332	0,10	GBP	481.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	637.620	0,24
					EUR	454.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	524.825	0,20
					EUR	261.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	325.159	0,12

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				INDONESIEN				
GBP	155.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	203.279	0,08	IDR	58.000.000.000 Indonesia (Govt of) 7.00% 15/09/2030	3.998.453	1,51	
USD	431.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	466.142	0,18	IDR	54.500.000.000 Indonesia (Govt of) 8.25% 15/05/2029	4.081.218	1,54	
USD	159.000 Vodafone Group plc FRN 04/04/2079	183.284	0,07	Summe Indonesien			8.079.671	3,05
GBP	200.000 William Hill plc 4.75% 01/05/2026	255.686	0,10	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
GBP	200.000 William Hill plc 4.88% 07/09/2023	264.596	0,10	8.079.671				3,05
Summe Vereinigtes Königreich			17.097.680	6,47	Aktien			
VEREINIGTE STAATEN				AUSTRALIEN				
EUR	785.000 Avantor Inc. 4.75% 01/10/2024	916.516	0,35	585.136	Alumina Limited	935.309	0,35	
EUR	309.000 Axalta Coating System Limited 4.25% 15/08/2024	348.391	0,13	166.158	Amcors plc	1.596.930	0,60	
EUR	425.000 Ball Corp. 4.38% 15/12/2023	540.181	0,20	110.052	Sydney Airport Finance Company Pty Limited	596.023	0,23	
EUR	620.000 Catalent Pharma Solutions Inc. 4.75% 15/12/2024	698.197	0,26	96.798	Transurban Group	959.043	0,36	
EUR	573.000 Cemex Finance LLC 4.63% 15/06/2024	657.430	0,26	Summe Australien			4.087.305	1,54
EUR	259.000 Colfax Corp. 3.25% 15/05/2025	291.081	0,11	ÖSTERREICH				
EUR	993.000 Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	1.124.414	0,43	42.272	Erste Group Bank AG	1.398.217	0,53	
EUR	700.000 Equinix Inc. 2.88% 01/02/2026	796.690	0,30	Summe Österreich			1.398.217	0,53
USD	52.000 Equinix Inc. 5.38% 15/05/2027	56.095	0,02	BRASILIEN				
EUR	563.000 IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	626.653	0,24	347.129	Ambev SA	1.604.224	0,61	
EUR	1.197.000 IQVIA Inc. 3.25% 15/03/2025	1.340.709	0,51	272.570	Kroton Educacional SA	731.582	0,28	
EUR	582.000 IQVIA Inc. 3.50% 15/10/2024	647.760	0,24	Summe Brasilien			2.335.806	0,89
EUR	100.000 Iron Mountain Inc. 3.00% 15/01/2025	111.981	0,04	KANADA				
EUR	352.000 Kronos International 3.75% 15/09/2025	384.470	0,15	90.909	Manulife Financial Corp.	1.668.496	0,63	
EUR	480.000 Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	556.565	0,21	46.696	Suncor Energy Inc.	1.473.887	0,56	
EUR	300.000 Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	347.853	0,13	22.272	TC Energy Corp.	1.153.972	0,44	
EUR	664.000 Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	769.585	0,29	Summe Kanada			4.296.355	1,63
EUR	793.000 Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	963.528	0,36	KAIMANINSELN				
EUR	609.000 Refinitiv US Holdings Inc. 4.50% 15/05/2026	716.674	0,28	842.000	HKT Trust and Hkt Limited	1.336.135	0,50	
EUR	401.000 Refinitiv US Holdings Inc. 6.88% 15/11/2026	490.489	0,19	Summe Kaimaninseln			1.336.135	0,50
EUR	699.000 Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	782.956	0,31	CHINA				
EUR	832.000 Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	959.230	0,36	53.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	614.547	0,23	
EUR	295.000 UGI International LLC 3.25% 01/11/2025	341.129	0,13	Summe China			614.547	0,23
Summe Vereinigte Staaten			14.468.577	5,50				
Summe Anleihen		103.429.205	39,10					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
CURACAO				NIEDERLANDE			
25.044	Schlumberger Limited	855.753	0,32	64.883	RELX plc	1.544.155	0,58
	Summe Curacao	855.753	0,32	35.694	Unilever NV	2.146.085	0,81
FINNLAND				SÜDKOREA			
55.381	Sampo Oyj - A	2.202.531	0,84	100.384	Samsung Electronics Company Limited	4.116.424	1,55
43.525	Upm-Kymmene Oyj	1.286.870	0,49		Summe Südkorea	4.116.424	1,55
	Summe Finnland	3.489.401	1,33				
FRANKREICH				SPANIEN			
25.473	BNP Paribas	1.240.516	0,47	54.821	Ferrovial SA	1.584.393	0,59
	Summe Frankreich	1.240.516	0,47	Summe Spanien			
DEUTSCHLAND				SCHWEIZ			
19.678	Axel Springer SE	1.351.536	0,51	25.113	Novartis AG - Reg	2.179.490	0,82
208.556	Deutsche Telekom AG - Reg	3.500.099	1,32	148.067	UBS Group AG	1.682.394	0,64
47.416	Evonik Industries AG	1.170.845	0,44		Summe Schweiz	3.861.884	1,46
	Summe Deutschland	6.022.480	2,27				
HONGKONG				TAIWAN			
28.100	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	824.427	0,31	113.000	Eclat Textile Company Limited	1.515.209	0,57
	Summe Hongkong	824.427	0,31	244.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	2.139.239	0,81
INDONESIEN				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
4.940.300	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	1.500.070	0,57	37.321	Anglo American plc	860.577	0,33
	Summe Indonesien	1.500.070	0,57	318.655	BAE Systems plc	2.238.268	0,85
ISLE OF MAN							
70.193	Gvc Holdings plc	643.032	0,24	70.649	British American Tobacco plc	2.618.353	1,00
	Summe Isle of Man	643.032	0,24	455.871	BT Group plc	1.003.209	0,38
JAPAN							
57.000	Bridgestone Corp.	2.206.689	0,83	122.471	Glaxosmithkline plc	2.632.968	1,00
341.900	Daiwa Securities Group Inc. - ADR	1.522.929	0,58	110.734	Prudential plc	2.012.748	0,76
1.299	Japan Hotel REIT Investment	968.766	0,37	24.433	Reckitt Benckiser Group plc	1.910.101	0,72
6.700	Nintendo Company Limited	2.480.998	0,94	29.284	Rio Tinto plc	1.518.888	0,57
7.400	Tokyo Electron Limited	1.408.105	0,53	53.448	Royal Dutch Shell plc - A	1.570.197	0,59
	Summe Japan	8.587.487	3,25	Summe Vereinigtes Königreich			
				16.365.309			
				6,20			
				VEREINIGTE STAATEN			
				8.093	3M Company	1.330.489	0,50
				18.278	Altria Group Inc.	747.570	0,28
				15.270	American Electric Power Company Inc.	1.430.646	0,54
				39.088	BB&T Corp.	2.086.127	0,79
				38.512	Cisco Systems Inc.	1.902.878	0,72

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
Aktien (Fortsetzung)				Anleihen			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				PORTUGAL			
7.322	CME Group Inc.	1.547.431	0,58	EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2020	22.761 0,01
46.165	Coca Cola Company	2.513.222	0,95			Summe Portugal	22.761 0,01
13.914	Crown Castle International Corp.	1.934.185	0,73	VEREINIGTES KÖNIGREICH			
29.214	Emerson Electric Company	1.953.248	0,74	GBP	305.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	383.995 0,14
93.242	Enterprise Products Partners LP	2.664.857	1,01			Summe Vereinigtes Königreich	383.995 0,14
47.054	General Motors Company	1.763.584	0,67	Summe Anleihen			
29.447	Gilead Sciences Inc.	1.866.351	0,71			406.756 0,15	
10.583	IBM Corp.	1.538.980	0,58	Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
14.343	Johnson & Johnson	1.855.697	0,70			406.756 0,15	
22.449	Las Vegas Sands Corp.	1.296.655	0,49	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
4.902	Lockheed Martin Corp.	1.912.074	0,72	Fonds			
35.088	Maxim Integrated Products Inc.	2.031.946	0,77	LUXEMBURG			
16.193	Merck & Company Inc.	1.363.127	0,52		2.301.652	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds AUP*	13.498.956 5,10
52.910	Nutrien Limited	2.639.151	1,00		137.621	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income Fund ZUP*	1.690.462 0,64
18.780	Occidental Petroleum Corp.	835.147	0,32		671.054	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities IUH*	7.064.181 2,67
12.467	Paychex Inc.	1.031.894	0,39			Summe Luxemburg	22.253.599 8,41
17.558	PepsiCo Inc.	2.407.202	0,91	Summe Fonds			
84.589	Pfizer Inc.	3.039.282	1,14			22.253.599 8,41	
12.993	Philip Morris International Inc.	986.558	0,37	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
7.733	United Parcel Service Inc.	926.568	0,35			22.253.599 8,41	
22.647	Valero Energy Corp.	1.930.430	0,73	Wert der Anlagen insgesamt			
4.415	Watsco Inc.	746.930	0,28			257.460.292 97,31	
80.370	Wells Fargo & Company	4.053.862	1,53	(Gesamtkosten: USD 264.245.659)			
31.654	Xcel Energy Inc.	2.054.029	0,78	<i>*Siehe Erläuterung 18.</i>			
	Summe Vereinigte Staaten	52.390.120	19,80				
Summe Aktien		122.894.349	46,45				
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung		234.403.225	88,60				
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere							
Anleihen							
VEREINIGTE STAATEN							
USD	59.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 5.00% 15/07/2027	61.323 0,02				
USD	323.000	Cott Holdings Inc. 5.50% 01/04/2025	335.389 0,13				
		Summe Vereinigte Staaten	396.712 0,15				
Summe Anleihen		396.712	0,15				
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt							
		396.712	0,15				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				SCHWEDEN			
22.457	CSL Limited	3.539.498	0,42	262.462	Atlas Copco AB	7.122.019	0,85
	Summe Australien	3.539.498	0,42		Summe Schweden	7.122.019	0,85
FRANKREICH				TAIWAN			
42.916	Louis Vuitton Moët Hennessy SE	17.060.888	2,04	1.140.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	9.994.808	1,19
129.669	Pernod-Ricard SA	23.099.065	2,76		Summe Taiwan	9.994.808	1,19
	Summe Frankreich	40.159.953	4,80				
DEUTSCHLAND				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
44.039	Adidas AG	13.714.433	1,64	70.208	Aon plc	13.590.163	1,62
	Summe Deutschland	13.714.433	1,64	127.437	InterContinental Hotels Group plc	7.969.811	0,95
HONGKONG				34.688	Linde plc	6.731.401	0,80
1.603.400	Aia Group Limited	15.145.543	1,81		Summe Vereinigtes Königreich	28.291.375	3,37
	Summe Hongkong	15.145.543	1,81				
INDIEN				VEREINIGTE STAATEN			
1.425.117	HDFC Bank Limited	24.683.806	2,95	206.521	Abbott Laboratories	17.279.612	2,07
1.102.290	Kotak Mahindra Bank Limited	25.578.456	3,06	160.736	Activision Blizzard Inc.	8.506.149	1,02
	Summe Indien	50.262.262	6,01	156.476	Adobe Inc.	43.226.495	5,16
INDONESIEN				32.729	Alphabet Inc. - A	39.966.691	4,78
2.150.000	Bank Central Asia Tbk Pt	4.597.039	0,55	11.538	Amazon.com Inc.	20.028.930	2,39
	Summe Indonesien	4.597.039	0,55	39.120	Ansys Inc.	8.659.603	1,04
IRLAND				131.044	Automatic Data Processing Inc.	21.153.122	2,52
110.218	Ingersoll-Rand plc	13.579.960	1,62	239.931	Baxter International Inc.	20.986.765	2,51
141.759	Medtronic Inc.	15.397.863	1,84	73.188	Becton Dickinson & Company	18.513.636	2,21
	Summe Irland	28.977.823	3,46	644.933	Boston Scientific Corp.	26.242.323	3,14
JAPAN				155.878	Charles Schwab Corp.	6.520.377	0,78
33.756	Keyence Corp.	20.895.448	2,50	67.390	CME Group Inc.	14.242.203	1,70
24.100	Nintendo Company Limited	8.924.188	1,07	88.264	Electronic Arts Inc.	8.633.984	1,03
	Summe Japan	29.819.636	3,57	105.257	Estee Lauder Companies Inc.	20.940.880	2,51
NIEDERLANDE				240.376	Fidelity National Information Services Inc.	31.912.318	3,81
1.271.640	RELX plc	30.263.845	3,62	35.714	Lam Research Corp.	8.253.863	0,99
274.674	Unilever NV	16.514.645	1,97	168.836	Mastercard Inc. - A	45.850.793	5,48
	Summe Niederlande	46.778.490	5,59	430.595	Microsoft Corp.	59.865.622	7,15
				107.449	S&P Global Inc.	26.322.856	3,15
				68.326	Texas Instruments Inc.	8.830.452	1,06
				93.360	Thermo Fisher Scientific Inc.	27.192.967	3,25
				232.732	Transunion	18.876.893	2,26

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
93.032	UnitedHealth Group Inc.	20.217.714	2,42
128.406	Visa Inc. - A	22.087.115	2,64
	Summe Vereinigte Staaten	544.311.363	65,07
	Summe Aktien	822.714.242	98,33
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	822.714.242	98,33
	Wert der Anlagen insgesamt	822.714.242	98,33
(Gesamtkosten: USD 697.218.137)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BERMUDAS				KAIMANINSELN (Fortsetzung)			
5.462	Credicorp Limited	1.138.499	1,19	73.032	Tencent Music Entertainment Group	932.619	0,98
	Summe Bermudas	1.138.499	1,19	116.000	Wuxi Biologics Cayman Inc.	1.183.766	1,25
BRASILIEN				Summe Kaimaninseln			
62.922	Azul SA	750.913	0,79			24.860.772	26,12
295.717	BK Brasil Operacao e Assessoria a Restaurantes SA	1.463.889	1,54	CHINA			
221.036	Itau Unibanco Holding SA - ADR	1.858.913	1,95	20.294	Ctrip.com International Limited - ADR	594.411	0,62
98.182	Localiza Rent a Car	1.071.531	1,12	2.308	Kweichow Moutai Company Limited - A	371.673	0,39
88.776	Lojas Americanas SA Pfd	425.402	0,45	110.500	Midea Group Company Limited - A	790.698	0,83
40.368	Lojas Renner SA	489.118	0,51	192.929	Ping An Insurance Group Company of China Limited	2.216.150	2,33
64.536	Magazine Luiza SA	572.324	0,60	53.460	WuXi AppTec Company Limited	584.424	0,61
65.328	Notre Dame Intermedica Participacoes	850.829	0,89		Summe China	4.557.356	4,78
109.093	Petrobras Distribuidora SA	721.019	0,76	ZYPERN			
102.008	Petroleo Brasileiro SA - ADR	1.340.385	1,41	33.280	Tcs Group Holding plc - Reg	582.400	0,61
15.752	Petroleo Brasileiro SA - ADR	227.931	0,24		Summe Zypern	582.400	0,61
	Summe Brasilien	9.772.254	10,26	HONGKONG			
KANADA				243.000	Aia Group Limited	2.295.352	2,40
33.455	Parex Resources Inc.	512.943	0,54	680.000	Cnooc Limited	1.037.428	1,09
	Summe Kanada	512.943	0,54	209.000	Galaxy Entertainment Group Limited	1.299.687	1,36
KAIMANINSELN				119.000	Techtronic Industries Company	828.056	0,87
10.857	58.com Inc. - ADR	535.359	0,56		Summe Hongkong	5.460.523	5,72
21.138	Afya Limited	541.978	0,57	UNGARN			
40.754	Alibaba Group Holding Limited	6.815.291	7,16	28.549	OTP Bank Nyrt	1.188.416	1,25
4.834	Arco Platform Limited	245.035	0,26		Summe Ungarn	1.188.416	1,25
7.961	BeiGene Limited - ADR	974.904	1,02	INDIEN			
1.002.000	China Resources Cement Holdings Limited	1.004.635	1,05	30.094	Apollo Hospitals Enterprise Limited	592.608	0,62
10.417	Huya Inc.	246.258	0,26	37.342	Asian Paints Limited	928.535	0,97
612.000	Kingdee International Software Group Company Limited	644.836	0,68	8.855	Bajaj Finance Limited	505.566	0,53
4.538	NetEase Inc. - ADR	1.207.925	1,26	45.480	Balkrishna Industries Limited	498.173	0,52
7.535	New Oriental Education & Technology Group - ADR	834.577	0,88	2.544	Eicher Motors Limited	637.742	0,67
11.048	Pagseguro Digital Limited	511.633	0,54	34.866	HDFC Bank Limited - ADR	1.989.105	2,09
95.000	Shenzhou International Group Holdings Limited	1.240.913	1,30	105.328	HDFC Standard Life Insurance	893.479	0,94
14.122	StoneCo Limited	491.163	0,52	107.022	Indraprastha Gas Limited	528.113	0,55
37.237	Tal Education Group - ADR	1.274.994	1,34	52.420	Jubilant Foodworks Limited	1.005.547	1,05
146.600	Tencent Holdings Limited	6.174.886	6,49				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
INDIEN (Fortsetzung)				SÜDKOREA			
3.700	Maruti Suzuki India Limited	350.637	0,37	19.633	KB Financial Group Inc.	700.860	0,74
113.515	Reliance Industries Limited	2.134.012	2,23	2.423	Pearl Abyss Corp.	401.084	0,42
51.515	Tech Mahindra Limited	519.390	0,55	116.922	Samsung Electronics Company Limited	4.794.595	5,03
	Summe Indien	10.582.907	11,09	23.658	SK hynix Inc.	1.625.798	1,71
INDONESIEN				Summe Südkorea			
6.100.400	ACE Hardware Indonesia	760.699	0,80			7.522.337	7,90
1.097.400	Bank Central Asia Tbk Pt	2.346.414	2,46	RUSSISCHE FÖDERATION			
5.307.500	Bank Rakyat Indonesia	1.540.523	1,62	18.161	Lukoil PJSC - ADR	1.502.641	1,58
15.061.800	Pakuwon Jati Tbk Pt	705.634	0,74	59.972	Sberbank of Russia PJSC - ADR	850.103	0,89
	Summe Indonesien	5.353.270	5,62		Summe Russische Föderation	2.352.744	2,47
LUXEMBURG				SÜDAFRIKA			
26.581	Ternium SA - ADR	510.089	0,54	82.690	AVI Limited	448.665	0,47
	Summe Luxemburg	510.089	0,54	7.079	Capitec Bank Holdings Limited	601.073	0,63
MEXIKO				15.695	Naspers Limited	2.375.644	2,49
182.052	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	978.026	1,03		Summe Südafrika	3.425.382	3,59
	Summe Mexiko	978.026	1,03	TAIWAN			
NIEDERLANDE				35.000	Asmedia Technology Inc.	547.155	0,57
15.695	Prosus NV	1.152.405	1,21	91.882	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	4.270.675	4,48
39.551	Yandex NV	1.384.681	1,45		Summe Taiwan	4.817.830	5,05
	Summe Niederlande	2.537.086	2,66	THAILAND			
PANAMA				1.121.000	Muangthai Capital plc	2.089.176	2,19
7.899	Copa Holdings SA - A	780.026	0,82	210.700	Tisco Financial	706.127	0,74
	Summe Panama	780.026	0,82		Summe Thailand	2.795.303	2,93
PHILIPPINEN				VEREINIGTE STAATEN			
2.100.300	Ayala Land Inc.	2.003.872	2,10	799	Mercadolibre Inc.	440.433	0,46
	Summe Philippinen	2.003.872	2,10		Summe Vereinigte Staaten	440.433	0,46
POLEN				BRITISCHE JUNGFERNINSELN			
14.058	Dino Polska SA	550.516	0,58	35.935	Mail.Ru Group Limited - GDR	753.198	0,80
5.315	Kruk SA	200.713	0,21		Summe Britische Jungferninseln	753.198	0,80
	Summe Polen	751.229	0,79		Summe Aktien	93.676.895	98,32

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Optionsscheine Aktien			
CHINA			
342	Kweichow Moutai Company Limited - Wts 14/07/2020 Str.0,01	55.075	0,06
	Summe China	55.075	0,06
NIEDERLANDE			
2.261	JPMorgan - Jiangsu Yanghe Brewery Joint Stock Company - Wts 23/06/2020 Str.0.01	32.928	0,03
21.501	Midea Group Company Limited - Wts 20/04/2020 Str.0.01	153.853	0,16
	Summe Niederlande	186.781	0,19
	Summe Optionsscheine Aktien	241.856	0,25
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	93.918.751	98,57
	Wert der Anlagen insgesamt	93.918.751	98,57
	(Gesamtkosten: USD 90.581.025)		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				FRANKREICH			
2.669.822	Alumina Limited	4.267.568	0,75	119.666	BNP Paribas	5.827.643	1,03
733.674	Amcor plc	7.051.277	1,24		Summe Frankreich	5.827.643	1,03
510.972	Sydney Airport Finance Company Pty Limited	2.767.339	0,49				
447.630	Transurban Group	4.434.971	0,78				
	Summe Australien	18.521.155	3,26				
ÖSTERREICH				DEUTSCHLAND			
189.498	Erste Group Bank AG	6.267.962	1,11	91.671	Axel Springer SE	6.296.203	1,11
	Summe Österreich	6.267.962	1,11	959.800	Deutsche Telekom AG - Reg	16.107.881	2,85
				220.828	Evonik Industries AG	5.452.912	0,96
BRASILIEN				Summe Deutschland			
1.608.223	Ambev SA	7.432.250	1,31			27.856.996	4,92
1.237.853	Kroton Educacional SA	3.322.417	0,59				
	Summe Brasilien	10.754.667	1,90				
KANADA				HONGKONG			
422.092	Manulife Financial Corp.	7.746.855	1,37	132.100	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	3.875.686	0,68
218.989	Suncor Energy Inc.	6.912.047	1,22		Summe Hongkong	3.875.686	0,68
103.082	TC Energy Corp.	5.340.956	0,94				
	Summe Kanada	19.999.858	3,53				
KAIMANINSELN				INDONESIEN			
3.873.445	HKT Trust and Hkt Limited	6.146.610	1,08	22.542.600	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	6.844.824	1,21
	Summe Kaimaninseln	6.146.610	1,08		Summe Indonesien	6.844.824	1,21
CHINA				ISLE OF MAN			
247.792	Ping An Insurance Group Company of China Limited	2.846.354	0,50	363.937	Gvc Holdings plc	3.333.997	0,59
	Summe China	2.846.354	0,50		Summe Isle of Man	3.333.997	0,59
CURACAO				JAPAN			
112.444	Schlumberger Limited	3.842.211	0,68	260.181	Bridgestone Corp.	10.072.606	1,78
	Summe Curacao	3.842.211	0,68	1.532.014	Daiwa Securities Group Inc. - ADR	6.824.069	1,21
FINNLAND				NIEDERLANDE			
259.728	Sampo Oyj - A	10.329.511	1,82	300.250	RELX plc	7.145.670	1,26
201.276	Upm-Kymmene Oyj	5.950.971	1,05	165.111	Unilever NV	9.927.221	1,75
	Summe Finnland	16.280.482	2,87		Summe Niederlande	17.072.891	3,01
				SÜDKOREA			
				466.081	Samsung Electronics Company Limited	19.112.481	3,38
					Summe Südkorea	19.112.481	3,38

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Select

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BERMUDAS				INDIEN			
98.657	IHS Markit Limited	6.598.180	1,42	560.920	HDFC Bank Limited	9.715.441	2,09
	Summe Bermudas	6.598.180	1,42		Summe Indien	9.715.441	2,09
KANADA				INDONESIEN			
198.258	Suncor Energy Inc.	6.260.987	1,35	20.545.800	Bank Rakyat Indonesia	5.963.501	1,29
	Summe Kanada	6.260.987	1,35		Summe Indonesien	5.963.501	1,29
KAIMANINSELN				IRLAND			
55.512	Alibaba Group Holding Limited	9.283.272	2,00	179.407	CRH plc	6.178.673	1,33
143.700	Tencent Holdings Limited	6.052.736	1,31	63.068	Ingersoll-Rand plc	7.770.608	1,68
	Summe Kaimaninseln	15.336.008	3,31	43.403	Medtronic Inc.	4.714.434	1,02
					Summe Irland	18.663.715	4,03
CHINA				JAPAN			
484.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	5.559.644	1,20	8.500	Keyence Corp.	5.261.622	1,13
	Summe China	5.559.644	1,20	15.800	Nintendo Company Limited	5.850.712	1,26
				67.700	Rohm Company Limited	5.167.937	1,11
					Summe Japan	16.280.271	3,50
DÄNEMARK				JERSEY - KANALINSELN			
88.433	Novo-Nordisk A/S	4.547.184	0,98	61.419	Ferguson plc	4.498.814	0,97
	Summe Dänemark	4.547.184	0,98		Summe Jersey - Kanalinseln	4.498.814	0,97
FINNLAND				NIEDERLANDE			
115.263	Upm-Kymmene Oyj	3.407.892	0,73	37.622	Lyondellbasell Industries NV - A	3.366.040	0,73
	Summe Finnland	3.407.892	0,73	30.193	NXP Semiconductor NV	3.294.660	0,71
				324.083	RELX plc	7.712.873	1,67
FRANKREICH					Summe Niederlande	14.373.573	3,11
39.519	EssilorLuxottica SA	5.697.808	1,23	SÜDKOREA			
12.212	Louis Vuitton Moët Hennessy SE	4.854.776	1,05	213.972	Samsung Electronics Company Limited	8.774.303	1,90
34.505	Pernod-Ricard SA	6.146.675	1,33		Summe Südkorea	8.774.303	1,90
	Summe Frankreich	16.699.259	3,61	SPANIEN			
DEUTSCHLAND				161.719	Industria de Diseno Textil SA	5.007.092	1,08
29.646	Adidas AG	9.232.228	1,99		Summe Spanien	5.007.092	1,08
	Summe Deutschland	9.232.228	1,99	SCHWEIZ			
HONGKONG				37.179	TE Connectivity Limited	3.464.339	0,75
452.800	Aia Group Limited	4.277.100	0,92		Summe Schweiz	3.464.339	0,75
	Summe Hongkong	4.277.100	0,92				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Select

Aufstellung der Wertpapierranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTES KÖNIGREICH				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
31.214	Aon plc	6.042.094	1,30	57.648	Union Pacific Corp.	9.337.823	2,01
40.609	Reckitt Benckiser Group plc	3.174.694	0,68	14.464	UnitedHealth Group Inc.	3.143.316	0,68
153.642	Unilever plc	9.258.385	2,00	40.722	Vertex Pharmaceuticals Inc.	6.899.122	1,49
	Summe Vereinigtes Königreich	18.475.173	3,98	66.577	Visa Inc. - A	11.451.910	2,47
					Summe Vereinigte Staaten	275.947.514	59,47
VEREINIGTE STAATEN				Summe Aktien			
133.981	Activision Blizzard Inc.	7.090.275	1,53			453.082.218	97,68
21.763	Adobe Inc.	6.012.029	1,30	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			
15.579	Alphabet Inc. - A	19.024.140	4,10			453.082.218	97,68
1.982	Alphabet Inc. - C	2.416.058	0,52	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
7.805	Amazon.com Inc.	13.548.777	2,92	Fonds			
50.984	Amphenol Corp.	4.919.956	1,06	IRLAND			
58.252	Baxter International Inc.	5.095.302	1,10	12.175.736	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	12.175.736	2,63
27.781	Becton Dickinson & Company	7.027.482	1,51		Summe Irland	12.175.736	2,63
163.308	Centene Corp.	7.064.704	1,52	Summe Fonds			
92.906	Charles Schwab Corp.	3.886.258	0,84			12.175.736	2,63
26.427	CME Group Inc.	5.585.082	1,20	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
130.592	Comcast Corp.	5.887.087	1,27			12.175.736	2,63
19.645	Cooper Companies Inc.	5.834.565	1,26	Wert der Anlagen insgesamt			
61.815	Diamondback Energy Inc.	5.557.787	1,20			465.257.954	100,31
28.640	Ecolab Inc.	5.671.866	1,22	(Gesamtkosten: USD 424.603.722)			
49.631	Electronic Arts Inc.	4.854.904	1,05				
59.337	Eog Resources Inc.	4.403.992	0,95				
17.842	Equinix Inc.	10.291.266	2,22				
29.783	Estee Lauder Companies Inc.	5.925.328	1,28				
54.532	Facebook Inc. - A	9.711.059	2,09				
35.458	Fidelity National Information Services Inc.	4.707.404	1,01				
87.237	Gilead Sciences Inc.	5.529.081	1,19				
177.991	Halliburton Company	3.355.130	0,72				
21.660	Illumina Inc.	6.589.405	1,42				
100.837	JPMorgan Chase & Company	11.867.506	2,56				
22.364	Lam Research Corp.	5.168.544	1,11				
46.208	Mastercard Inc. - A	12.548.707	2,71				
125.420	Microsoft Corp.	17.437.143	3,75				
14.670	NextEra Energy Inc.	3.417.963	0,74				
26.514	Nvidia Corp.	4.615.292	1,00				
22.003	S&P Global Inc.	5.390.295	1,16				
100.539	Service Corp. International	4.806.770	1,04				
32.126	Stryker Corp.	6.948.854	1,49				
40.618	Transunion	3.294.526	0,71				
53.657	Trex Company Inc.	4.879.031	1,05				
18.102	Tyler Technologies Inc.	4.751.775	1,02				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BAHAMAS				ITALIEN			
554.644	OneSpaWorld Holdings Limited	7.900.955	2,06	334.215	Carel Industries SpA	4.538.640	1,18
	Summe Bahamas	7.900.955	2,06	69.394	Diasorin SpA	7.404.340	1,92
BERMUDAS				579.374	Finecobank Banca Fineco SpA	5.626.880	1,46
238.918	Axalta Coating System Limited	6.607.391	1,71	520.191	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	4.952.218	1,29
	Summe Bermudas	6.607.391	1,71	219.503	Marr SpA	4.412.010	1,15
KANADA				Summe Italien			
112.254	Cargojet Inc.	7.319.638	1,90		Summe Italien	26.934.088	7,00
157.655	Gildan Activewear Inc.	5.135.659	1,34	JAPAN			
205.705	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	7.528.553	1,96	157.600	Asahi Intecc Company Limited	3.794.757	0,99
	Summe Kanada	19.983.850	5,20	95.200	Daifuku Company Limited	4.500.498	1,17
DÄNEMARK				42.800	Disco Corp.	7.432.207	1,93
41.924	Simcorp A/S	3.377.479	0,88	276.286	Nihon M&A Center Inc.	7.128.545	1,85
	Summe Dänemark	3.377.479	0,88	106.200	Pigeon Corp.	4.015.509	1,04
FRANKREICH				118.900	Raksul Inc.	3.602.620	0,94
229.022	Elis SA	3.714.737	0,97		Summe Japan	30.474.136	7,92
211.871	Lectra	3.834.865	1,00	LUXEMBURG			
35.036	Orpea	3.927.536	1,02	15.626	Eurofins Scientific	6.662.926	1,74
52.233	Remy Cointreau	6.361.979	1,65		Summe Luxemburg	6.662.926	1,74
	Summe Frankreich	17.839.117	4,64	NIEDERLANDE			
DEUTSCHLAND				93.289	Core Laboratories NV	3.989.298	1,04
76.636	CTS Eventim AG	3.962.081	1,03	44.661	IMCD Group NV	3.030.249	0,79
64.383	Grenke AG	4.867.355	1,27	48.911	Takeaway.com Holding BV	3.580.285	0,93
233.168	Norma Group	7.419.405	1,92		Summe Niederlande	10.599.832	2,76
9.378	Sartorius AG	1.569.877	0,41	SCHWEDEN			
118.631	Stabilus SA	5.326.531	1,39	547.126	Dometic Group AB	3.941.503	1,03
	Summe Deutschland	23.145.249	6,02	1.433.722	Karnov Group AB	6.420.234	1,67
ISLAND					Summe Schweden	10.361.737	2,70
876.592	Marel HF	3.681.686	0,96	SCHWEIZ			
	Summe Island	3.681.686	0,96	1.143	Belimo Holding AG - Reg	5.772.339	1,50
INDIEN				2.316	LEM Holding SA	2.535.238	0,66
213.427	Colgate-Palmolive Company	4.154.650	1,08	425.089	SIG Combibloc Group AG	5.200.736	1,35
6.661	Eicher Motors Limited	1.531.656	0,40	60.881	Vat Group AG	7.048.038	1,83
	Summe Indien	5.686.306	1,48	20.219	VZ Holding AG	5.542.545	1,44
					Summe Schweiz	26.098.896	6,78

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Aktien (Fortsetzung)				Fonds			
VEREINIGTES KÖNIGREICH				IRLAND			
870.597	Ascential plc	3.729.638	0,97	6.004.904	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	5.508.076	1,43
393.711	Big Yellow Group plc	4.623.846	1,20		Summe Irland	5.508.076	1,43
69.747	Croda International plc	3.831.528	1,00		Summe Fonds	5.508.076	1,43
215.064	Genus plc	6.787.243	1,77		Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	5.508.076	1,43
397.923	St James's Place plc	4.405.238	1,15		Wert der Anlagen insgesamt	383.259.858	99,68
	Summe Vereinigtes Königreich	23.377.493	6,09		(Gesamtkosten: EUR 360.279.438)		
VEREINIGTE STAATEN							
230.981	Altair Engineering Inc.	7.334.949	1,90				
59.129	Aspen Technology Inc.	6.675.470	1,74				
75.692	Blackline Inc.	3.319.423	0,86				
97.199	Casella Waste Systems Inc.	3.828.403	1,00				
57.116	Catalent Inc.	2.496.926	0,65				
62.220	Charles River Laboratories International Inc.	7.554.634	1,96				
117.308	Cubic Corp.	7.578.428	1,97				
60.401	Envestnet Inc.	3.141.384	0,82				
12.046	Fair Isaac Corp.	3.353.698	0,87				
108.688	Freshpet Inc.	4.961.843	1,29				
61.916	Gatx Corp.	4.403.181	1,15				
122.823	Graco Inc.	5.186.912	1,35				
51.889	Guardant Health Inc.	3.038.043	0,79				
79.568	MSA Safety Inc.	7.963.369	2,07				
52.855	Nordson Corp.	7.090.967	1,84				
64.584	Novanta Inc.	4.841.134	1,26				
42.737	Pool Corp.	7.906.855	2,06				
77.003	PTC Inc.	4.815.689	1,25				
164.100	Service Corp. International	7.196.497	1,87				
57.646	Servicemaster Global Holdings Inc.	2.955.798	0,77				
116.450	SiteOne Landscape Supply Inc.	7.906.466	2,06				
50.466	Transunion	3.754.630	0,98				
101.536	Trex Company Inc.	8.468.784	2,20				
177.615	Trimble Inc.	6.322.912	1,64				
29.783	Tyler Technologies Inc.	7.171.196	1,87				
21.398	Watsco Inc.	3.320.596	0,86				
32.056	WD-40 Company	5.396.770	1,40				
251.178	Welbilt Inc.	3.884.481	1,01				
16.647	Zebra Technologies Corp.	3.151.203	0,82				
	Summe Vereinigte Staaten	155.020.641	40,31				
	Summe Aktien	377.751.782	98,25				
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	377.751.782	98,25				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
IRLAND				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
153.097	Ingersoll-Rand plc	18.863.081	2,00	427.865	Microsoft Corp.	59.486.072	6,33
	Summe Irland	18.863.081	2,00	345.511	Mondelez International Inc.	19.113.669	2,03
				240.544	Procter & Gamble Company	29.918.863	3,18
NIEDERLANDE				184.635	Republic Services Inc.	15.980.159	1,70
112.898	NXP Semiconductor NV	12.319.430	1,31	16.645	Sage Therapeutics Inc.	2.335.127	0,25
	Summe Niederlande	12.319.430	1,31	68.368	Spirit Aerosystems Holdings Inc.	5.622.584	0,60
VEREINIGTE STAATEN				127.102	Take-Two Interactive Software Inc.	15.930.965	1,69
71.164	Adobe Inc.	19.659.055	2,09	66.907	Thermo Fisher Scientific Inc.	19.488.002	2,07
167.697	Aflac Inc.	8.773.907	0,93	131.309	Union Pacific Corp.	21.269.432	2,26
60.356	Albemarle Corp.	4.195.949	0,45	146.637	Valero Energy Corp.	12.499.338	1,33
91.884	Alexion Pharmaceuticals Inc.	8.999.119	0,96	69.445	Vertex Pharmaceuticals Inc.	11.765.373	1,25
137.794	Allstate Corp.	14.975.452	1,59	148.674	Visa Inc. - A	25.573.415	2,71
34.929	Alphabet Inc. - A	42.653.199	4,53	95.551	Voya Financial Inc.	5.201.796	0,55
22.003	Amazon.com Inc.	38.195.228	4,06		Summe Vereinigte Staaten	897.650.042	95,40
57.721	American Tower Corp.	12.763.845	1,36		Summe Aktien	928.832.553	98,71
237.959	Apple Inc.	53.295.677	5,66		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	928.832.553	98,71
1.052.083	Bank of America Corp.	30.689.261	3,27		Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren		
235.771	Baxter International Inc.	20.622.889	2,19		Fonds		
125.908	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	8.486.199	0,90		IRLAND		
20.626	Bluebird Bio Inc.	1.893.879	0,20	9.517.661	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	9.517.661	1,01
281.275	Bristol-Myers Squibb Company	14.263.455	1,52		Summe Irland	9.517.661	1,01
57.470	Broadcom Inc.	15.865.743	1,69		Summe Fonds	9.517.661	1,01
109.611	Caterpillar Inc.	13.844.966	1,47		Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	9.517.661	1,01
232.903	Centene Corp.	10.075.384	1,07		Wert der Anlagen insgesamt	938.350.214	99,72
163.873	Chevron Corp.	19.435.337	2,06		(Gesamtkosten: USD 834.821.403)		
447.335	Cisco Systems Inc.	22.102.822	2,35				
382.927	Citigroup Inc.	26.452.597	2,81				
392.872	Citizens Financial Group Inc.	13.895.883	1,48				
80.012	CME Group Inc.	16.909.736	1,80				
564.477	Comcast Corp.	25.446.623	2,70				
93.782	Diamondback Energy Inc.	8.431.940	0,90				
106.151	Dow Inc.	5.058.095	0,53				
146.166	DuPont de Nemours Inc.	10.423.097	1,11				
262.777	Edison International	19.818.641	2,11				
117.076	Eog Resources Inc.	8.689.381	0,92				
303.146	Extended Stay America Inc.	4.438.057	0,47				
171.736	Facebook Inc. - A	30.582.747	3,25				
209.587	Gardner Denver Holdings Inc.	5.929.216	0,63				
62.211	Guardant Health Inc.	3.970.928	0,42				
131.587	Home Depot Inc.	30.530.816	3,24				
100.920	L3Harris Technologies Inc.	21.055.949	2,24				
72.689	Lam Research Corp.	16.799.154	1,78				
178.849	Marsh & McLennan Companies Inc.	17.893.843	1,91				
97.018	Mastercard Inc. - A	26.347.178	2,80				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Select

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
IRLAND				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
22.499	Ingersoll-Rand plc	2.772.102	0,77	88.192	Visa Inc. - A	15.169.906	4,23
	Summe Irland	2.772.102	0,77	12.042	VMware Inc. - A	1.807.023	0,50
				26.710	Walt Disney Company	3.480.847	0,97
				591.569	WPX Energy Inc.	6.264.716	1,75
NIEDERLANDE				Summe Vereinigte Staaten			
43.929	NXP Semiconductor NV	4.793.532	1,34			331.912.995	92,62
	Summe Niederlande	4.793.532	1,34				
VEREINIGTE STAATEN				Summe Aktien			
21.720	Activision Blizzard Inc.	1.149.422	0,32			339.478.629	94,73
28.017	Adobe Inc.	7.739.696	2,16	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			
44.151	Alexion Pharmaceuticals Inc.	4.324.149	1,20			339.478.629	94,73
26.946	Alphabet Inc. - A	32.904.839	9,18	Wert der Anlagen insgesamt			
9.853	Amazon.com Inc.	17.103.921	4,77			339.478.629	94,73
21.738	Analog Devices Inc.	2.428.787	0,68	(Gesamtkosten: USD 313.110.720)			
14.314	Ansys Inc.	3.168.547	0,88				
28.348	Apple Inc.	6.349.102	1,77				
403.923	Bank of America Corp.	11.782.434	3,29				
141.503	Berkshire Hathaway Inc.	29.435.454	8,21				
16.728	Biogen Idec Inc.	3.894.613	1,09				
52.097	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	3.511.338	0,98				
4.064	Booking Holdings Inc.	7.976.047	2,23				
500.871	Centennial Resource Development - A	2.261.433	0,63				
12.670	Charter Communications Inc. - A	5.221.560	1,46				
15.511	Colgate-Palmolive Company	1.140.214	0,32				
197.235	Comcast Corp.	8.891.354	2,48				
7.651	Curtiss-Wright Corp.	989.810	0,28				
24.210	Edwards Lifesciences Corp.	5.324.021	1,49				
101.143	Facebook Inc. - A	18.011.545	5,02				
6.161	Illumina Inc.	1.874.299	0,52				
106.393	JPMorgan Chase & Company	12.521.392	3,49				
26.300	L3Harris Technologies Inc.	5.487.232	1,53				
66.648	Lam Research Corp.	15.403.020	4,29				
25.949	Mastercard Inc. - A	7.046.970	1,97				
220.861	Microsoft Corp.	30.706.304	8,57				
66.878	Moderna Inc.	1.064.698	0,30				
103.502	Mondelez International Inc.	5.725.731	1,60				
35.012	Norfolk Southern Corp.	6.290.256	1,76				
241.865	Nutanix Inc. - A	6.348.956	1,77				
36.742	PepsiCo Inc.	5.037.328	1,41				
48.526	Phillips 66	4.969.062	1,39				
61.757	PNC Financial Services	8.655.861	2,42				
351.954	Uber Technologies Inc.	10.724.038	2,99				
29.788	UnitedHealth Group Inc.	6.473.528	1,81				
19.204	Vertex Pharmaceuticals Inc.	3.253.542	0,91				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BAHAMAS				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
238.340	OneSpaWorld Holdings Limited	3.701.420	1,62	89.490	Quanterix Corp.	1.965.200	0,86
	Summe Bahamas	3.701.420	1,62	42.206	Sandy Spring Bancorp Inc.	1.422.764	0,62
				59.761	Schnitzer Steel Industries Inc.	1.234.662	0,54
KANADA				193.936	Store Capital Corp.	7.255.146	3,18
54.694	Canada Goose Holdings Inc.	2.404.895	1,06	36.459	Take-Two Interactive Software Inc.	4.569.771	2,01
217.791	Gildan Activewear Inc.	7.731.581	3,39	79.892	Teradyne Inc.	4.626.546	2,03
70.428	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	2.810.077	1,23	30.370	Trex Company Inc.	2.761.544	1,21
	Summe Kanada	12.946.553	5,68	577.288	Virtu Financial Inc.	9.444.431	4,14
				61.395	Voya Financial Inc.	3.342.344	1,47
VEREINIGTE STAATEN				176.779	W&t Offshore Inc.	772.524	0,34
114.333	Aerie Pharmaceuticals Inc.	2.197.480	0,97	30.300	Zebra Technologies Corp.	6.253.011	2,74
20.264	Aerojet Rocketdyne Holdings Inc.	1.023.535	0,45		Summe Vereinigte Staaten	211.114.074	92,65
160.457	Albemarle Corp.	11.154.971	4,89		Summe Aktien	227.762.047	99,95
312.675	Altair Engineering Inc.	10.824.809	4,75		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	227.762.047	99,95
90.745	BJ's Wholesale Club Holdings Inc.	2.347.573	1,03				
85.567	Charles River Laboratories International Inc.	11.326.504	4,98		Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren		
166.888	Cubic Corp.	11.753.922	5,16		Fonds		
155.316	Elf Beauty Inc.	2.719.583	1,19		IRLAND		
86.198	Extended Stay America Inc.	1.261.939	0,55	1.300.000	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	1.300.000	0,57
141.145	First Hawaiian Inc.	3.768.572	1,66		Summe Irland	1.300.000	0,57
187.314	First Industrial Realty Trust Inc.	7.410.141	3,26		Summe Fonds	1.300.000	0,57
47.611	Freshpet Inc.	2.369.600	1,04		Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	1.300.000	0,57
145.468	Gardner Denver Holdings Inc.	4.115.290	1,81		Wert der Anlagen insgesamt	229.062.047	100,52
63.733	Guardant Health Inc.	4.068.077	1,78		(Gesamtkosten: USD 222.280.210)		
44.918	Hanover Insurance Group	6.088.186	2,67				
174.882	Houlihan Lokey Inc.	7.887.178	3,46				
56.664	Immunomedics Inc.	751.365	0,33				
130.299	Impinj Inc.	4.017.118	1,76				
390.280	KBR Inc.	9.577.471	4,20				
347.759	Kindred Biosciences Inc.	2.382.149	1,05				
419.899	Livent Corp	2.809.124	1,23				
17.855	Medifast Inc.	1.850.314	0,81				
27.301	Mirati Therapeutics Inc.	2.127.021	0,93				
35.425	Mobile Mini Inc.	1.305.766	0,57				
170.750	Moelis & Company - A	5.609.137	2,46				
33.051	MSA Safety Inc.	3.606.195	1,58				
1.005.590	Newpark Resources	7.662.596	3,36				
10.988	Nordson Corp.	1.607.105	0,71				
169.708	Planet Fitness Inc.	9.821.002	4,31				
160.830	Portland General Electric Company	9.065.987	3,98				
190.658	QTS Realty Trust Inc. - A	9.801.727	4,31				
45.564	Quanex Building Products Corp.	823.797	0,36				
114.574	Quanta Services Inc.	4.330.897	1,91				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
SINGAPUR			
118.000	DBS Group Holdings Limited	2.133.198	1,40
1.239.000	Lendlease Global Commercial REIT	788.430	0,52
	Summe Singapur	2.921.628	1,92
TAIWAN			
349.000	MediaTek Inc.	4.150.998	2,72
828.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	7.259.388	4,76
203.000	Yageo Corp.	1.612.923	1,06
	Summe Taiwan	13.023.309	8,54
THAILAND			
359.100	Bangkok Bank pcl - NVDR	2.037.087	1,34
201.600	Kasikornbank pcl - NVDR	1.031.572	0,68
2.765.000	Thai Beverage pcl	1.769.488	1,16
	Summe Thailand	4.838.147	3,18
	Summe Aktien	147.490.137	96,71
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	147.490.137	96,71
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
IRLAND			
3.525.592	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.525.592	2,31
	Summe Irland	3.525.592	2,31
	Summe Fonds	3.525.592	2,31
	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	3.525.592	2,31
	Wert der Anlagen insgesamt	151.015.729	99,02
(Gesamtkosten: USD 151.368.095)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				
Aktien				Aktien (Fortsetzung)				
AUSTRALIEN				HONGKONG (Fortsetzung)				
212.655	Amcor plc	2.043.809	0,90	215.500	Sun Hung Kai Properties Limited	3.100.804	1,37	
155.915	Aristocrat Leisure Limited	3.217.800	1,42	305.500	Techtronic Industries Company	2.125.807	0,94	
240.144	Australia & New Zealand Banking Group Limited	4.619.245	2,04	Summe Hongkong			30.170.951	13,35
319.945	BHP Group Limited	7.923.695	3,50	INDIEN				
40.044	CSL Limited	6.311.424	2,79	189.676	Godrej Consumer Products Limited	1.839.571	0,81	
385.735	Lendlease Group	4.568.392	2,02	342.500	HDFC Bank Limited	5.932.288	2,63	
52.298	Macquarie Group Limited	4.623.504	2,04	287.317	Icici Bank Limited	1.758.363	0,78	
178.496	Treasury Wine Estates Limited	2.235.580	0,99	210.266	Infosys Technologies Limited	2.390.415	1,06	
Summe Australien			15,70	178.432	Mahindra & Mahindra Limited	1.377.644	0,61	
KAIMANINSELN				835.400	Petronet Lng Limited	3.063.787	1,35	
76.816	Alibaba Group Holding Limited	12.845.939	5,68	147.425	Reliance Industries Limited	2.771.499	1,23	
666.816	China Resources Land Limited	2.794.212	1,24	Summe Indien			19.133.567	8,47
27.224	New Oriental Education & Technology Group - ADR	3.015.330	1,33	INDONESIEN				
836.800	Sands China Limited	3.789.378	1,68	13.923.200	Bank Rakyat Indonesia	4.041.264	1,79	
297.200	Tencent Holdings Limited	12.518.255	5,53	12.239.500	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	3.716.395	1,64	
Summe Kaimaninseln			15,46	Summe Indonesien			7.757.659	3,43
CHINA				PHILIPPINEN				
546.000	Anhui Conch Cement Company Limited	3.242.129	1,43	3.174.690	Ayala Land Inc.	3.028.935	1,34	
4.675.000	China Construction Bank Corp.	3.566.159	1,58	2.081.120	Metropolitan Bank & Trust	2.746.474	1,21	
1.014.000	China Merchants Bank Company Limited - H	4.824.638	2,13	Summe Philippinen			5.775.409	2,55
2.559.000	CRRC Corp. Limited	1.785.564	0,79	SÜDKOREA				
577.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	6.627.923	2,93	63.798	Hite Jinro Company Limited	1.450.750	0,64	
137.200	Shanghai International Airport - A	1.532.765	0,68	58.110	KB Financial Group Inc.	2.074.414	0,92	
232.077	Wuliangye Yibin Company Limited	4.218.267	1,86	41.972	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	3.614.212	1,60	
Summe China			11,40	350.663	Samsung Electronics Company Limited	14.379.561	6,36	
HONGKONG				16.681	Samsung Sdi Company Limited	3.109.880	1,38	
986.400	Aia Group Limited	9.317.427	4,12	Summe Südkorea			24.628.817	10,90
253.000	China Mobile Limited	2.092.900	0,93	SINGAPUR				
2.739.000	Cnooc Limited	4.178.699	1,85	1.215.500	Capitaland Limited	3.102.692	1,37	
1.058.000	CSPC Pharmaceutical Group Limited	2.124.263	0,94	282.900	United Overseas Bank Limited	5.249.268	2,33	
616.000	Galaxy Entertainment Group Limited	3.830.657	1,69	Summe Singapur			8.351.960	3,70
115.900	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	3.400.394	1,51					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
TAIWAN			
348.000	Chroma ATE Inc.	1.648.911	0,73
3.755.281	E.Sun Financial Holding Company Limited	3.177.404	1,40
18.000	Largan Precision Company Limited	2.581.864	1,14
459.000	MediaTek Inc.	5.459.335	2,41
1.594.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	13.975.197	6,18
	Summe Taiwan	26.842.711	11,86
THAILAND			
367.900	Kasikornbank pcl - NVDR	1.882.516	0,83
757.700	Thai Oil pcl	1.727.970	0,76
	Summe Thailand	3.610.486	1,59
	Summe Aktien	222.575.568	98,41
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	222.575.568	98,41
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
IRLAND			
2.004.971	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.004.971	0,89
	Summe Irland	2.004.971	0,89
	Summe Fonds	2.004.971	0,89
	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	2.004.971	0,89
	Wert der Anlagen insgesamt	224.580.539	99,30
(Gesamtkosten: USD 211.816.156)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				HONGKONG (Fortsetzung)			
16.125	Ancor plc	154.976	1,50	469.000	Pacific Basin Shipping Limited	95.722	0,93
5.601	Ansell Limited	103.544	1,00	362.000	Sinopec Kantons Holdings Limited	148.690	1,44
9.789	Aristocrat Leisure Limited	202.027	1,96		Summe Hongkong	2.787.797	27,04
8.809	Australia & New Zealand Banking Group Limited	169.444	1,64				
14.619	BHP Group Limited	362.051	3,51				
1.877	CSL Limited	295.838	2,87	MACAU			
21.396	Lendlease Group	253.400	2,46	88.400	Wynn Macau Limited	172.529	1,67
2.425	Macquarie Group Limited	214.387	2,08		Summe Macau	172.529	1,67
14.038	Treasury Wine Estates Limited	175.820	1,71				
66.258	Vicinity Centres	114.847	1,11	SÜDKOREA			
	Summe Australien	2.046.334	19,84	1.819	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	156.634	1,52
					Summe Südkorea	156.634	1,52
BERMUDAS				SINGAPUR			
334.000	Beijing Enterprises Water Group Limited	170.848	1,66	113.200	Capitaland Limited	288.955	2,80
	Summe Bermudas	170.848	1,66	46.700	DBS Group Holdings Limited	844.241	8,18
				91.700	Lendlease Global Commercial REIT	58.353	0,57
KAIMANINSELN				106.700	Mapletree Commercial Trust	176.689	1,71
836	Alibaba Group Holding Limited	139.804	1,35	71.118	Oversea-Chinese Banking Corp. Limited	558.494	5,41
19.000	CK Asset Holdings Limited	128.696	1,25	261.300	Singapore Telecommunications Limited	585.747	5,68
13.500	CK Hutchison Holdings Limited	119.167	1,16	35.935	United Overseas Bank Limited	666.782	6,46
76.400	Mgm China Holdings Limited	119.092	1,15	24.400	UOL Group Limited	132.331	1,28
3.100	Tencent Holdings Limited	130.574	1,27		Summe Singapur	3.311.592	32,09
	Summe Kaimaninseln	637.333	6,18				
CHINA				TAIWAN			
223.000	Times China Holdings Ltd	347.042	3,36	19.000	MediaTek Inc.	225.985	2,19
	Summe China	347.042	3,36	16.000	Yageo Corp.	127.127	1,23
HONGKONG					Summe Taiwan	353.112	3,42
100.200	Aia Group Limited	946.478	9,18	THAILAND			
35.000	Boc Hong Kong Holdings Limited	118.759	1,15	163.500	Thai Beverage plc	104.633	1,01
50.000	Galaxy Entertainment Group Limited	310.930	3,02		Summe Thailand	104.633	1,01
5.100	Hang Seng Bank Limited	109.945	1,07	Summe Aktien			
16.669	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	489.052	4,74	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			
72.000	Hua Hong Semiconductor Limited	143.277	1,39	10.087.854			
39.500	Kerry Properties Limited	121.684	1,18	Wert der Anlagen insgesamt			
27.500	Link Real Estate Investment Trust	303.260	2,94	10.087.854			
				(Gesamtkosten: USD 9.575.938)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BERMUDAS				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
118.845	Marvell Technology Group Limited	2.967.560	0,45	26.625	Becton Dickinson & Company	6.735.060	1,02
	Summe Bermudas	2.967.560	0,45	126.697	Berkshire Hathaway Inc.	26.355.510	3,98
KANADA				14.891	Blackrock Inc.	6.636.026	1,00
189.620	Canadian Natural Resources Limited	5.049.581	0,76	12.585	Broadcom Inc.	3.474.341	0,52
	Summe Kanada	5.049.581	0,76	8.310	Caterpillar Inc.	1.049.636	0,16
CURACAO				53.195	CDK Global Inc.	2.558.148	0,39
81.080	Schlumberger Limited	2.770.504	0,42	131.249	Chevron Corp.	15.566.131	2,35
	Summe Curacao	2.770.504	0,42	31.196	Cigna Corp.	4.735.241	0,71
IRLAND				132.335	Cisco Systems Inc.	6.538.672	0,99
31.870	Allergan plc	5.363.402	0,81	252.255	Citigroup Inc.	17.425.775	2,63
181.591	Medtronic Inc.	19.724.415	2,98	74.895	Colgate-Palmolive Company	5.505.531	0,83
	Summe Irland	25.087.817	3,79	421.198	Comcast Corp.	18.987.606	2,87
NIEDERLANDE				228.769	Conagra Brands Inc.	7.018.633	1,06
61.920	NXP Semiconductor NV	6.756.710	1,02	117.050	Corning Inc.	3.338.266	0,50
	Summe Niederlande	6.756.710	1,02	134.707	Corteva Inc.	3.771.796	0,57
VEREINIGTES KÖNIGREICH				109.340	Dentsply Sirona Inc.	5.828.915	0,88
41.769	Aon plc	8.085.225	1,22	87.450	DR Horton Inc.	4.609.490	0,70
	Summe Vereinigtes Königreich	8.085.225	1,22	87.572	DuPont de Nemours Inc.	6.244.759	0,94
VEREINIGTE STAATEN				208.980	Ebay Inc.	8.146.040	1,23
65.533	Abbott Laboratories	5.483.146	0,83	37.380	Electronic Arts Inc.	3.656.512	0,55
159.189	Activision Blizzard Inc.	8.424.282	1,27	81.443	Emerson Electric Company	5.445.279	0,82
27.060	Adobe Inc.	7.475.325	1,13	104.082	Eog Resources Inc.	7.724.966	1,17
14.995	Air Products & Chemicals Inc.	3.326.791	0,50	48.330	Facebook Inc. - A	8.606.606	1,30
25.130	Alexion Pharmaceuticals Inc.	2.461.232	0,37	97.435	Fidelity National Information Services Inc.	12.935.471	1,95
9.479	Alphabet Inc. - A	11.575.186	1,75	82.448	Fiserv Inc.	8.540.788	1,29
12.490	Alphabet Inc. - C	15.225.310	2,30	80.829	Honeywell International Inc.	13.676.267	2,07
11.460	Amazon.com Inc.	19.893.529	3,00	2.565	Humana Inc.	655.794	0,10
74.065	American Electric Power Company Inc.	6.939.150	1,05	62.395	IBM Corp.	9.073.481	1,37
40.679	American Tower Corp.	8.995.347	1,36	77.020	Intel Corp.	3.968.841	0,60
17.369	Anthem Inc.	4.170.296	0,63	96.896	Johnson & Johnson	12.536.405	1,89
120.756	Apple Inc.	27.045.721	4,08	168.563	JPMorgan Chase & Company	19.838.179	2,99
114.971	Aramark	5.010.436	0,76	27.325	L3Harris Technologies Inc.	5.701.088	0,86
357.035	AT&T Inc.	13.510.204	2,04	30.825	Lam Research Corp.	7.123.966	1,08
15.310	Autodesk Inc.	2.261.287	0,34	110.002	Lowe's Companies Inc.	12.095.820	1,82
53.905	Baxter International Inc.	4.715.070	0,71	68.824	Mastercard Inc. - A	18.690.534	2,82
				40.651	McDonald's Corp.	8.728.176	1,32
				274.131	Microsoft Corp.	38.112.433	5,74
				188.115	Mondelez International Inc.	10.406.522	1,57
				241.980	Morgan Stanley	10.325.287	1,56
				107.055	Mosaic Company	2.194.628	0,33
				180.175	Newmont Mining Corp.	6.832.236	1,03
				36.975	Northrop Grumman Corp.	13.857.860	2,09
				28.660	Nvidia Corp.	4.988.846	0,75
				12.695	Palo Alto Networks Inc.	2.587.622	0,39
				191.974	Pfizer Inc.	6.897.626	1,04
				163.790	Philip Morris International Inc.	12.436.575	1,88
				7.537	Sherwin-Williams Company	4.144.369	0,63

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
34.055	Spirit Aerosystems Holdings Inc.	2.800.683	0,42
34.567	Sysco Corp.	2.744.620	0,41
46.200	T-Mobile USA Inc.	3.639.174	0,55
31.910	Valero Energy Corp.	2.720.008	0,41
153.796	Verizon Communications Inc.	9.283.127	1,40
71.625	Wells Fargo & Company	3.612.765	0,55
	Summe Vereinigte Staaten	597.620.442	90,20
	Summe Aktien	648.337.839	97,86
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	648.337.839	97,86
	Wert der Anlagen insgesamt	648.337.839	97,86
	(Gesamtkosten: USD 527.242.375)		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
KAIMANINSELN				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
75	Garmin Limited	6.352	0,10	1.790	Conocophillips	101.995	1,64
	Summe Kaimaninseln	6.352	0,10	265	CSX Corp.	18.357	0,29
				701	Cummins Inc.	114.032	1,83
IRLAND				235	Dentsply Sirona Inc.	12.528	0,20
88	Allergan plc	14.810	0,24	2.160	Ebay Inc.	84.197	1,35
960	Eaton Corp. plc	79.824	1,28	172	Eli Lilly & Company	19.235	0,31
448	Medtronic Inc.	48.662	0,78	2.300	Exelon Corp.	111.113	1,78
380	Perrigo Company	21.238	0,34	600	Expedia Group Inc.	80.646	1,29
104	Willis Towers Watson plc	20.069	0,32	74	F5 Networks Inc.	10.391	0,17
	Summe Irland	184.603	2,96	1.071	Facebook Inc. - A	190.724	3,05
				475	Fortinet Inc.	36.461	0,58
NIEDERLANDE				1.990	Franklin Resources Inc.	57.431	0,92
849	Lyondellbasell Industries NV - A	75.960	1,22	430	General Mills Inc.	23.702	0,38
760	Mylan NV	15.033	0,24	565	Harley-Davidson Inc.	20.323	0,33
	Summe Niederlande	90.993	1,46	655	Hollyfrontier Corp.	35.134	0,56
				145	Hologic Inc.	7.321	0,12
VEREINIGTES KÖNIGREICH				413	Honeywell International Inc.	69.879	1,12
130	Aon plc	25.164	0,40	365	Host Hotels & Resorts Inc.	6.311	0,10
	Summe Vereinigtes Königreich	25.164	0,40	3.430	HP Inc.	64.896	1,04
				167	Illinois Tool Works Inc.	26.134	0,42
VEREINIGTE STAATEN				1.350	IntercontinentalExchange Inc.	124.565	2,00
650	Abbott Laboratories	54.386	0,87	412	Johnson & Johnson	53.305	0,85
565	Abbvie Inc.	42.782	0,68	766	Kimberly-Clark Corp.	108.810	1,74
232	Adobe Inc.	64.090	1,03	129	L3Harris Technologies Inc.	26.914	0,43
3.185	AES Corp.	52.043	0,83	452	Lam Research Corp.	104.462	1,67
327	Alexion Pharmaceuticals Inc.	32.026	0,51	42	Lockheed Martin Corp.	16.383	0,26
550	Allstate Corp.	59.774	0,96	628	Mastercard Inc. - A	170.546	2,73
237	Alphabet Inc. - A	289.410	4,63	516	Mckesson Corp.	70.517	1,13
1.680	Altria Group Inc.	68.712	1,10	1.830	Merck & Company Inc.	154.048	2,47
82	Amazon.com Inc.	142.345	2,28	745	Metlife Inc.	35.134	0,56
440	American Electric Power Company Inc.	41.224	0,66	1.172	Microsoft Corp.	162.943	2,61
532	American Tower Corp.	117.641	1,88	765	Nike Inc.	71.849	1,15
619	Apple Inc.	138.637	2,22	750	Nrg Energy Inc.	29.700	0,48
74	Autozone Inc.	80.262	1,28	1.555	Nucor Corp.	79.165	1,27
900	Bank of America Corp.	26.253	0,42	1.255	Paypal Holdings Inc.	130.005	2,08
345	Bank of New York Mellon Corp.	15.597	0,25	730	Philip Morris International Inc.	55.429	0,89
640	Baxter International Inc.	55.981	0,89	72	Procter & Gamble Company	8.955	0,14
280	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	18.872	0,30	642	Prudential Financial Inc.	57.748	0,92
2.410	Bristol-Myers Squibb Company	122.210	1,96	55	Qorvo Inc.	4.078	0,07
427	Broadcom Inc.	117.881	1,88	305	Robert Half International Inc.	16.976	0,27
1.150	Capital One Financial Corp.	104.627	1,67	41	S&P Global Inc.	10.044	0,16
1.705	Cardinal Health Inc.	80.459	1,29	68	SBA Communications	16.398	0,26
622	Chevron Corp.	73.769	1,18	264	Simon Property Group Inc.	41.092	0,66
3.175	Cisco Systems Inc.	156.877	2,51	424	Snap-On Inc.	66.373	1,06
2.225	Citigroup Inc.	153.703	2,46	2.030	Southwest Airlines Company	109.641	1,75
				1.475	Starbucks Corp.	130.420	2,08
				760	Synchrony Financial	25.908	0,41
				142	T Rowe Price Group Inc.	16.224	0,26
				510	Tyson Foods Inc. - A	43.931	0,70

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
970	Under Armour Inc.	19.342	0,31
206	Union Pacific Corp.	33.367	0,54
714	Valero Energy Corp.	60.861	0,97
575	VeriSign Inc.	108.462	1,74
2.775	Verizon Communications Inc.	167.499	2,68
200	Vertex Pharmaceuticals Inc.	33.884	0,55
273	Visa Inc. - A	46.959	0,75
334	VMware Inc. - A	50.120	0,80
970	Voya Financial Inc.	52.807	0,85
1.520	Walgreens Boots Alliance Inc.	84.071	1,35
730	Wal-Mart Stores Inc.	86.636	1,39
	Summe Vereinigte Staaten	5.885.942	94,21
	Summe Aktien	6.193.054	99,13
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	6.193.054	99,13
	Wert der Anlagen insgesamt	6.193.054	99,13
	(Gesamtkosten: USD 5.641.026)		

Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
DÄNEMARK				ITALIEN			
24.796	DSV A/S	2.164.663	1,06	335.073	Fincobank Banca Fineco SpA	3.254.229	1,60
125.295	Novo-Nordisk A/S	5.909.567	2,91	54.459	Moncler SpA	1.780.809	0,87
	Summe Dänemark	8.074.230	3,97		Summe Italien	5.035.038	2,47
FINNLAND				NIEDERLANDE			
94.330	Neste Oyj	2.864.802	1,41	29.698	ASML Holding NV	6.748.871	3,31
53.369	Sampo Oyj - A	1.946.901	0,96	18.263	Ferrari NV	2.585.128	1,27
	Summe Finnland	4.811.703	2,37	421.278	ING Groep NV	4.045.954	1,99
				66.980	Philips NV	2.846.650	1,40
				263.181	RELX plc	5.745.241	2,82
FRANKREICH				Summe Niederlande			
37.869	Air Liquide SA	4.945.691	2,43			21.971.844	10,79
15.995	Dassault Systemes SA	2.091.346	1,03	NORWEGEN			
31.552	Legrand SA	2.066.025	1,01	248.387	Dnb ASA	4.018.373	1,97
23.260	L'Oreal SA	5.975.494	2,93	68.920	Mowi ASA	1.460.431	0,72
18.709	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	6.822.237	3,35		Summe Norwegen	5.478.804	2,69
26.286	Pernod-Ricard SA	4.295.132	2,11	SPANIEN			
28.205	Sanofi	2.399.117	1,18	15.210	Amadeus IT Holding SA - A	999.601	0,49
18.296	Teleperformance	3.639.074	1,79	117.408	Grifols SA	3.174.712	1,56
101.735	Total SA	4.871.580	2,39		Summe Spanien	4.174.313	2,05
45.741	Ubisoft Entertainment	3.034.459	1,48	SCHWEDEN			
35.329	Vinci SA	3.491.212	1,71	104.347	Atlas Copco AB - A	2.951.576	1,45
	Summe Frankreich	43.631.367	21,41	271.398	Sandvik AB	3.882.711	1,91
					Summe Schweden	6.834.287	3,36
DEUTSCHLAND				SCHWEIZ			
18.394	Adidas AG	5.254.246	2,58	9.325	Lonza Group AG - Reg	2.894.191	1,42
24.731	Allianz SE - Reg	5.288.724	2,59	79.027	Nestle SA - Reg	7.871.491	3,86
40.229	Knorr-Bremse AG	3.469.349	1,70	65.700	Novartis AG - Reg	5.230.167	2,57
46.150	Puma SE	3.276.650	1,61	4.347	Partners Group Holding AG - Reg	3.062.233	1,50
25.048	SAP SE	2.702.178	1,33	33.966	Sika AG	4.561.740	2,24
52.058	TeamViewer AG	1.285.312	0,63		Summe Schweiz	23.619.822	11,59
43.865	Vonovia SE	2.041.916	1,00	VEREINIGTES KÖNIGREICH			
	Summe Deutschland	23.318.375	11,44	332.012	3i Group plc	4.377.728	2,15
				218.472	Glaxosmithkline plc	4.308.260	2,11
IRLAND							
185.589	CRH plc	5.848.645	2,87				
88.983	Kingspan Group plc	3.986.438	1,96				
	Summe Irland	9.835.083	4,83				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
17.332	Linde plc	3.085.096	1,51
132.661	Persimmon plc	3.253.968	1,60
317.136	Prudential plc	5.287.469	2,59
65.460	Rio Tinto plc	3.114.334	1,53
270.523	Royal Dutch Shell plc - B	7.326.580	3,59
279.475	St James's Place plc	3.093.950	1,52
1.518.259	Tesco plc	4.135.930	2,03
36.491	Unilever plc	2.016.995	0,99
2.448.664	Vodafone Group plc	4.483.885	2,20
85.319	Weir Group plc	1.374.748	0,67
	Summe Vereinigtes Königreich	45.858.943	22,49
	Summe Aktien	202.643.809	99,46
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	202.643.809	99,46
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
IRLAND			
44	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	4.388	0,00
	Summe Irland	4.388	0,00
	Summe Fonds	4.388	0,00
	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	4.388	0,00
	Wert der Anlagen insgesamt	202.648.197	99,46
(Gesamtkosten: EUR 184.061.144)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BELGIEN				NORWEGEN			
21.759	KBC Group NV	1.297.272	2,30	83.979	Dnb ASA	1.358.600	2,40
	Summe Belgien	1.297.272	2,30	62.027	Mowi ASA	1.314.367	2,33
DÄNEMARK				SPANIEN			
61.554	Tryg A/S	1.618.344	2,87	19.048	Amadeus IT Holding SA - A	1.251.835	2,22
	Summe Dänemark	1.618.344	2,87	22.192	Industria de Diseno Textil SA	630.253	1,12
FINNLAND				SCHWEDEN			
18.787	Kone Oyj	981.433	1,74	61.754	Atlas Copco AB	1.537.077	2,72
19.017	Neste Oyj	577.546	1,02		Summe Schweden	1.537.077	2,72
62.349	Sampo Oyj - A	2.274.491	4,04	SCHWEIZ			
	Summe Finnland	3.833.470	6,80	18.267	Julius Baer Group Limited	743.052	1,32
FRANKREICH				997	Partners Group Holding		
11.048	Air Liquide SA	1.442.869	2,56		AG - Reg	702.334	1,24
13.014	Nexity SA	568.452	1,01	337	SGS SA - Reg	766.943	1,36
4.960	Pernod-Ricard SA	810.464	1,44		Summe Schweiz	2.212.329	3,92
21.148	Sanofi	1.798.849	3,19	VEREINIGTES KÖNIGREICH			
16.305	Schneider Electric SE	1.312.553	2,33	23.927	Astrazeneca plc	1.963.789	3,48
28.674	Total SA	1.373.054	2,43	125.855	BBA Aviation plc	444.134	0,79
	Summe Frankreich	7.306.241	12,96	17.406	Carnival plc	663.039	1,17
DEUTSCHLAND				36.987	Diageo plc	1.393.461	2,46
4.143	Adidas AG	1.183.448	2,10	270.995	DS Smith plc	1.103.968	1,96
7.533	Allianz SE - Reg	1.610.932	2,85	154.230	Glaxosmithkline plc	3.041.409	5,38
93.065	Deutsche Telekom AG - Reg	1.432.643	2,54	338.441	Legal & General Group plc	950.265	1,68
9.745	Knorr-Bremse AG	840.409	1,49	44.471	Persimmon plc	1.090.804	1,93
23.456	Vonovia SE	1.091.877	1,93	18.507	Rio Tinto plc	880.492	1,56
	Summe Deutschland	6.159.309	10,91	88.672	Royal Dutch Shell plc - A	2.389.478	4,24
ITALIEN				109.335	St James's Place plc	1.210.402	2,14
67.210	Fincobank Banca Fineco SpA	652.744	1,16	857.040	Vodafone Group plc	1.569.373	2,78
74.495	Marr SpA	1.497.350	2,65		Summe Vereinigtes Königreich	16.700.614	29,57
169.881	Pirelli & Company SpA	922.114	1,63	Summe Aktien			
347.716	Snam SpA	1.611.316	2,85			55.980.365	99,18
	Summe Italien	4.683.524	8,29	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			
NIEDERLANDE						55.980.365	99,18
40.736	Philips NV	1.731.280	3,07	Wert der Anlagen insgesamt			
91.940	RELX plc	2.007.049	3,56			55.980.365	99,18
42.408	Unilever NV	2.338.801	4,14	(Gesamtkosten: EUR 53.590.465)			
	Summe Niederlande	6.077.130	10,77				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
ÖSTERREICH				DEUTSCHLAND (Fortsetzung)			
43.551	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	2.373.530	0,44	189.636	Stabilus SA	8.514.656	1,56
	Summe Österreich	2.373.530	0,44	102.375	STRATEC SE	7.350.525	1,35
BELGIEN				215.729	TeamViewer AG	5.326.349	0,98
105.192	Biocartis NV	652.190	0,12	882.304	Tele Columbus AG	1.554.620	0,29
144.185	Melexis NV	9.162.956	1,69	29.229	Varta AG	2.645.225	0,49
210.117	Umicore SA	7.276.352	1,34	Summe Deutschland			
770.047	X-Fab Silicon Foundries SE	3.157.193	0,58			66.102.256	12,17
	Summe Belgien	20.248.691	3,73	ISLAND			
DÄNEMARK				738.708	Marel HF	3.102.574	0,57
34.920	Christian Hansen Holding A/S	2.719.215	0,50	Summe Island			
117.108	Simcorp A/S	9.434.447	1,73			3.102.574	0,57
	Summe Dänemark	12.153.662	2,23	IRLAND			
FINNLAND				1.239.024	Dalata Hotel Group Limited	6.071.218	1,12
109.273	Basware Oyj	2.404.006	0,44	1.572.493	Irish Continental Group plc	6.573.020	1,21
88.184	Cargotec Oyj	2.603.192	0,48	178.735	Kingspan Group plc	8.018.052	1,47
233.854	Huhtamaki Oyj	8.554.379	1,57	Summe Irland			
166.284	Konecranes Oyj	4.892.076	0,90			20.662.290	3,80
285.606	Tikkurila Oyj	3.867.105	0,71	ITALIEN			
172.370	Vaisala Oyj	4.369.580	0,80	645.455	Carel Industries SpA	8.765.279	1,61
	Summe Finnland	26.690.338	4,90	100.566	Diasorin SpA	10.730.393	1,97
FRANKREICH				1.085.021	Fincobank Banca Fineco SpA	10.537.724	1,94
260.095	Bureau Veritas SA	5.748.100	1,06	22.192	Industria Macchine Automatiche SpA	1.424.726	0,26
91.853	Edenred	4.044.288	0,74	580.664	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	5.527.921	1,02
663.057	Elis SA	10.754.784	1,98	388.318	Marr SpA	7.805.192	1,44
291.163	Lectra	5.270.050	0,97	1.557.659	Pirelli & Company SpA	8.454.974	1,56
138.371	Nexity SA	6.044.045	1,11	Summe Italien			
102.027	Orpea	11.437.227	2,10			53.246.209	9,80
52.969	SEB SA	7.378.582	1,36	JERSEY - KANALINSELN			
14.078	Teleperformance	2.800.114	0,51	689.852	JTC plc	2.736.991	0,50
	Summe Frankreich	53.477.190	9,83	Summe Jersey - Kanalinseln			
						2.736.991	0,50
DEUTSCHLAND				LUXEMBURG			
91.316	Brenntag AG	4.054.430	0,75	29.172	Eurofins Scientific	12.438.941	2,29
74.261	Compugroup Holding AG	4.099.207	0,75	Summe Luxemburg			
176.856	CTS Eventim AG	9.143.455	1,69			12.438.941	2,29
85.585	Gerresheimer AG	5.631.493	1,04	NIEDERLANDE			
79.877	Grenke AG	6.038.701	1,11	103.254	IMCD Group NV	7.005.784	1,29
243.103	Norma Group	7.735.537	1,42	35.974	Interxion Holding NV	2.687.986	0,49
23.943	Sartorius AG	4.008.058	0,74	98.853	Sligro Food Group NV	2.565.235	0,47
				126.157	Takeaway.com Holding BV	9.234.692	1,70
				Summe Niederlande			
						21.493.697	3,95

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
SPANIEN				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
440.566	Applus Services SA	5.242.735	0,96	805.353	Victoria plc	4.451.490	0,82
518.362	Fluidra SA	5.639.779	1,04	297.397	Victrex plc	7.254.347	1,33
	Summe Spanien	10.882.514	2,00		Summe Vereinigtes Königreich	137.635.431	25,31
SCHWEDEN				Summe Aktien			
497.495	Avanza Bank Holding AB	3.722.269	0,68			537.128.179	98,79
836.632	Dometic Group AB	6.027.107	1,11		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	537.128.179	98,79
597.486	Elekta AB - B	7.229.568	1,33				
753.903	Hexpol AB	5.313.670	0,98		Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		
1.758.633	Karnov Group AB	7.875.191	1,45		Aktien		
154.896	MIPS AB	2.413.245	0,44		DÄNEMARK		
198.909	Stillfront Group AB	4.806.167	0,88		49.761	Ow Bunker A/S	0
140.235	Thule Group AB	2.438.636	0,45			Summe Dänemark	0
	Summe Schweden	39.825.853	7,32			Summe Aktien	0
SCHWEIZ						Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	0
1.598	Belimo Holding AG - Reg	8.070.165	1,49			Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	
18.797	Burckhardt Compression Holding AG	4.322.767	0,80			Fonds	
6.234	LEM Holding SA	6.824.126	1,25			IRLAND	
861.455	SIG Combibloc Group AG	10.539.439	1,93		97	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	9.702
20.153	Sika AG	2.706.611	0,50			Summe Irland	9.702
87.483	Vat Group AG	10.127.684	1,86			Summe Fonds	9.702
41.832	VZ Holding AG	11.467.220	2,12			Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	9.702
	Summe Schweiz	54.058.012	9,95			Wert der Anlagen insgesamt	537.137.881
VEREINIGTES KÖNIGREICH						(Gesamtkosten: EUR 472.651.540)	98,79
1.541.012	Ascential plc	6.601.695	1,21				
164.541	Aveva Group plc	6.881.547	1,27				
2.545.650	BBA Aviation plc	8.983.423	1,65				
729.798	Big Yellow Group plc	8.570.940	1,58				
6.181.092	Coats Group plc	5.194.652	0,96				
722.500	Cvs Group plc	8.330.063	1,53				
156.759	First Derivatives plc	3.960.229	0,73				
383.027	Genus plc	12.088.017	2,22				
440.467	GlobalData plc	4.132.394	0,76				
1.359.137	Howden Joinery Group plc	8.609.374	1,58				
1.848.732	Ibstock plc	4.935.874	0,91				
5.795.301	Johnson Service Group plc	11.398.179	2,10				
490.632	Just Eat plc	3.705.720	0,68				
1.619.255	Rentokil Initial plc	8.562.207	1,57				
1.344.117	Rightmove PLC	8.365.339	1,54				
568.065	St James's Place plc	6.288.809	1,16				
1.160.353	Synthomer plc	4.254.820	0,78				
1.859.793	Tyman plc	5.066.312	0,93				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
ÖSTERREICH				DEUTSCHLAND (Fortsetzung)			
123.439	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	6.727.426	0,58	117.529	Sartorius AG	19.674.354	1,70
	Summe Österreich	6.727.426	0,58	345.490	Stabilus SA	15.512.501	1,34
BELGIEN				148.175	STRATEC SE	10.638.965	0,92
289.991	Biocartis NV	1.797.944	0,15	453.756	TeamViewer AG	11.203.236	0,96
42.620	Telenet Group Holding NV	1.845.446	0,16	2.423.382	Tele Columbus AG	4.269.999	0,37
572.831	Umicore SA	19.837.138	1,71	62.720	Varta AG	5.676.160	0,49
1.723.432	X-Fab Silicon Foundries SE	7.066.071	0,61		Summe Deutschland	202.810.469	17,46
	Summe Belgien	30.546.599	2,63	ISLAND			
DÄNEMARK				1.573.143	Marel HF	6.607.201	0,57
75.504	Christian Hansen Holding A/S	5.879.485	0,51		Summe Island	6.607.201	0,57
242.862	Simcorp A/S	19.565.433	1,69	IRLAND			
414.453	Tryg A/S	10.896.571	0,94	3.587.878	Dalata Hotel Group Limited	17.580.602	1,51
	Summe Dänemark	36.341.489	3,14	3.505.061	Irish Continental Group plc	14.651.155	1,26
FINNLAND				473.048	Kingspan Group plc	21.220.933	1,83
370.119	Cargotec Oyj	10.925.913	0,94		Summe Irland	53.452.690	4,60
508.811	Huhtamaki Oyj	18.612.307	1,60	ITALIEN			
446.264	Konecranes Oyj	13.129.087	1,13	685.720	Davide Campari-Milano SpA	5.684.619	0,49
	Summe Finnland	42.667.307	3,67	234.327	Diasorin SpA	25.002.691	2,15
FRANKREICH				2.303.814	Finacobank Banca Fineco SpA	22.374.642	1,93
733.258	Bureau Veritas SA	16.205.002	1,40	120.902	Industria Macchine Automatiche SpA	7.761.908	0,67
244.627	Edenred	10.770.927	0,93	1.857.403	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	17.682.477	1,52
1.572.388	Elis SA	25.504.132	2,19	754.326	Marr SpA	15.161.953	1,31
166.902	Ingenico Group SA	14.937.729	1,29	332.347	Salvatore Ferragamo Italia SpA	5.634.943	0,49
177.436	Korian SA	6.692.886	0,58		Summe Italien	99.303.233	8,56
294.966	Nexity SA	12.884.115	1,11	JERSEY - KANALINSELN			
227.898	Orpea	25.547.366	2,20	973.894	Sanne Group plc	5.977.530	0,51
112.660	SEB SA	15.693.538	1,35		Summe Jersey - Kanalinseln	5.977.530	0,51
42.866	Teleperformance	8.526.047	0,73	LUXEMBURG			
167.876	Ubisoft Entertainment	11.136.894	0,96	62.842	Eurofins Scientific	26.795.829	2,30
	Summe Frankreich	147.898.636	12,74		Summe Luxemburg	26.795.829	2,30
DEUTSCHLAND				NIEDERLANDE			
277.694	Brenntag AG	12.329.614	1,06	291.508	IMCD Group NV	19.778.817	1,69
420.871	Cancom SE	20.833.115	1,79	320.733	Takeaway.com Holding BV	23.477.656	2,02
313.319	Compugroup Holding AG	17.295.209	1,49		Summe Niederlande	43.256.473	3,71
535.722	CTS Eventim AG	27.696.828	2,38				
185.508	Gerresheimer AG	12.206.426	1,05				
226.032	Grenke AG	17.088.019	1,47				
449.173	Norma Group	14.292.685	1,23				
198.498	Puma SE	14.093.358	1,21				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Aktien (Fortsetzung)				Fonds			
SPANIEN				IRLAND			
1.382.710	Applus Services SA	16.454.249	1,42	142	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	14.148	0,00
1.112.921	Fluidra SA	12.108.580	1,04				
	Summe Spanien	28.562.829	2,46		Summe Irland	14.148	0,00
SCHWEDEN				Summe Fonds			
1.793.654	Avanza Bank Holding AB	13.420.160	1,16			14.148	0,00
2.326.302	Dometic Group AB	16.758.709	1,44				
541.125	Intrum AB	12.489.411	1,08				
352.930	Thule Group AB	6.137.325	0,53				
	Summe Schweden	48.805.605	4,21				
SCHWEIZ				Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
3.982	Belimo Holding AG - Reg	20.109.759	1,73			14.148	0,00
1.935.106	SIG Combibloc Group AG	23.674.982	2,03				
188.050	Sika AG	25.255.703	2,17				
	Summe Schweiz	69.040.444	5,93				
VEREINIGTES KÖNIGREICH				Wert der Anlagen insgesamt			
4.897.326	Ascential plc	20.980.144	1,81			1.156.736.469	99,61
226.059	Ashtead Group plc	5.785.068	0,50				
520.254	Aveva Group plc	21.758.422	1,88				
5.895.177	BBA Aviation plc	20.803.672	1,79				
1.485.759	Big Yellow Group plc	17.449.146	1,50				
13.836.567	Coats Group plc	11.628.390	1,00				
1.188.719	Cvs Group plc	13.705.334	1,18				
183.671	Derwent London plc	6.996.498	0,60				
3.764.328	DS Smith plc	15.334.954	1,32				
5.950.350	Elementis plc	9.947.660	0,86				
335.195	First Derivatives plc	8.468.087	0,73				
910.401	Genus plc	28.731.506	2,47				
3.656.463	Howden Joinery Group plc	23.161.653	2,00				
4.479.883	Ibstock plc	11.960.706	1,03				
1.085.878	Just Eat plc	8.201.584	0,71				
267.007	Renishaw plc	11.058.300	0,95				
3.330.057	Rentokil Initial plc	17.608.491	1,52				
1.096.714	Shaftesbury plc	11.262.338	0,97				
1.759.822	St James's Place plc	19.482.249	1,68				
2.712.815	Synthomer plc	9.947.439	0,86				
559.875	Victrex plc	13.656.920	1,18				
	Summe Vereinigtes Königreich	307.928.561	26,54				
	Summe Aktien	1.156.722.321	99,61				
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	1.156.722.321	99,61				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Select

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
DÄNEMARK				NIEDERLANDE			
99.242	Christian Hansen Holding A/S	7.727.959	0,54	211.060	ASML Holding NV	47.963.385	3,34
408.778	DSV A/S	35.685.858	2,48	747.351	IMCD Group NV	50.707.765	3,53
1.049.193	Novo-Nordisk A/S	49.485.429	3,44	292.087	Interxion Holding NV	21.824.809	1,52
	Summe Dänemark	92.899.246	6,46	1.042.083	Philips NV	44.288.527	3,09
				3.261.945	RELX plc	71.208.259	4,96
				788.772	Unilever NV	43.500.776	3,03
					Summe Niederlande	279.493.521	19,47
FINNLAND				SPANIEN			
552.404	Kone Oyj	28.857.585	2,01	759.177	Amadeus IT Holding SA - A	49.893.112	3,47
1.440.348	Sampo Oyj - A	52.543.895	3,66	2.396.994	Grifols SA - ADR	44.061.420	3,07
	Summe Finnland	81.401.480	5,67	1.064.577	Industria de Diseno Textil SA	30.233.987	2,10
					Summe Spanien	124.188.519	8,64
FRANKREICH				SCHWEDEN			
190.671	Air Liquide SA	24.901.633	1,73	908.537	Assa Abloy AB	18.570.759	1,29
435.524	Dassault Systemes SA	56.944.764	3,97	1.270.460	Atlas Copco AB - A	35.936.424	2,50
2.632.485	Elis SA	42.698.907	2,97	1.913.213	Epiroc AB - A	19.044.625	1,33
310.172	EssilorLuxottica SA	41.020.247	2,86	1.107.400	Sandvik AB	15.842.837	1,10
474.121	Legrand SA	31.045.443	2,16		Summe Schweden	89.394.645	6,22
270.091	L'Oreal SA	69.386.378	4,83				
110.787	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	40.398.480	2,81				
456.469	Pernod-Ricard SA	74.587.035	5,19				
266.330	Schneider Electric SE	21.439.565	1,49				
211.507	Ubisoft Entertainment	14.031.374	0,98				
	Summe Frankreich	416.453.826	28,99				
DEUTSCHLAND				SCHWEIZ			
179.058	Adidas AG	51.147.917	3,56	295.777	Nestle SA - Reg	29.460.894	2,05
1.146.952	Brenntag AG	50.924.669	3,55	223.890	Sika AG	30.069.127	2,09
485.959	Fresenius Medical Care AG & Company KGaA	29.983.670	2,09		Summe Schweiz	59.530.021	4,14
321.455	Knorr-Bremse AG	27.722.279	1,93				
1.632.390	Tele Columbus AG	2.876.271	0,20				
	Summe Deutschland	162.654.806	11,33				
IRLAND				Summe Aktien			
136.821	Kerry Group plc	14.680.893	1,02			1.400.534.301	97,49
318.139	Kingspan Group plc	14.252.627	0,99				
	Summe Irland	28.933.520	2,01				
ITALIEN				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			
4.558.169	Davide Campari-Milano SpA	37.787.221	2,63			1.400.534.301	97,49
861.266	Fincobank Banca Fineco SpA	8.364.615	0,58				
2.041.269	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	19.432.881	1,35				
	Summe Italien	65.584.717	4,56				
				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
				Fonds			
				IRLAND			
				184.121	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	18.365.303	1,28
					Summe Irland	18.365.303	1,28
					Summe Fonds	18.365.303	1,28
					Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	18.365.303	1,28
					Wert der Anlagen insgesamt	1.418.899.604	98,77
					(Gesamtkosten: EUR 1.260.223.430)		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
ÖSTERREICH				DEUTSCHLAND (Fortsetzung)			
162.937	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	8.880.067	0,50	359.627	Grenke AG	27.187.801	1,52
	Summe Österreich	8.880.067	0,50	335.333	Knorr-Bremse AG	28.919.118	1,61
				913.608	Norma Group	29.071.007	1,62
BELGIEN				258.197	Sartorius AG	43.222.177	2,42
361.169	Biocartis NV	2.239.248	0,12	595.328	Stabilus SA	26.730.227	1,49
586.088	Melexis NV	37.245.892	2,07	371.659	STRATEC SE	26.685.116	1,49
66.058	Telenet Group Holding NV	2.860.311	0,16	703.896	TeamViewer AG	17.379.192	0,97
883.841	Umicore SA	30.607.414	1,71	3.445.614	Tele Columbus AG	6.071.172	0,34
3.137.056	X-Fab Silicon Foundries SE	12.861.930	0,72	96.954	Varta AG	8.774.337	0,49
	Summe Belgien	85.814.795	4,78		Summe Deutschland	347.641.128	19,40
DÄNEMARK				ISLAND			
216.770	Christian Hansen Holding A/S	16.879.846	0,94	2.425.033	Marel HF	10.185.139	0,57
472.716	Simcorp A/S	38.082.917	2,12		Summe Island	10.185.139	0,57
941.311	Tryg A/S	24.748.433	1,38	IRLAND			
	Summe Dänemark	79.711.196	4,44	5.472.107	Dalata Hotel Group Limited	26.813.324	1,49
FINNLAND				6.151.937	Irish Continental Group plc	25.715.096	1,44
470.378	Basware Oyj	10.348.316	0,58	1.016.259	Kingspan Group plc	45.589.379	2,54
756.438	Cargotec Oyj	22.330.050	1,24		Summe Irland	98.117.799	5,47
903.374	Huhtamaki Oyj	33.045.421	1,84	ITALIEN			
887.385	Konecranes Oyj	26.106.866	1,46	2.153.523	Davide Campari-Milano SpA	17.852.706	1,00
1.078.052	Tikkurila Oyj	14.596.824	0,81	429.776	Diasorin SpA	45.857.100	2,56
511.902	Vaisala Oyj	12.976.716	0,72	3.864.308	Finecobank Banca Fineco SpA	37.530.159	2,09
	Summe Finnland	119.404.193	6,65	132.483	Industria Macchine Automatiche SpA	8.505.409	0,47
FRANKREICH				4.356.967	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	41.478.326	2,31
1.607.275	Bureau Veritas SA	35.520.778	1,98	1.824.877	Marr SpA	36.680.028	2,04
431.934	Edenred	19.018.054	1,06	6.407.972	Pirelli & Company SpA	34.782.472	1,94
2.560.786	Elis SA	41.535.949	2,31		Summe Italien	222.686.200	12,41
277.707	Korian SA	10.475.108	0,58	LUXEMBURG			
785.108	Nexity SA	34.293.517	1,91	98.354	Eurofins Scientific	41.938.146	2,34
380.748	Orpea	42.681.850	2,38		Summe Luxemburg	41.938.146	2,34
193.427	Remy Cointreau	23.559.408	1,31	NIEDERLANDE			
217.148	SEB SA	30.248.716	1,69	573.733	IMCD Group NV	38.927.784	2,17
62.250	Teleperformance	12.381.525	0,69	559.499	Interxion Holding NV	41.805.897	2,33
259.645	Ubisoft Entertainment	17.224.849	0,96	326.659	Sligro Food Group NV	8.476.801	0,47
	Summe Frankreich	266.939.754	14,87	545.299	Takeaway.com Holding BV	39.915.887	2,23
DEUTSCHLAND					Summe Niederlande	129.126.369	7,20
718.488	Brenntag AG	31.900.867	1,78				
600.326	Compugroup Holding AG	33.137.995	1,85				
903.189	CTS Eventim AG	46.694.871	2,60				
332.329	Gerresheimer AG	21.867.248	1,22				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Aktien (Fortsetzung)				Fonds			
SPANIEN				IRLAND			
2.449.874	Applus Services SA	29.153.501	1,63	206	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	20.583	0,00
1.828.906	Fluidra SA	19.898.497	1,11				
	Summe Spanien	49.051.998	2,74		Summe Irland	20.583	0,00
SCHWEDEN				Summe Fonds			
2.783.091	Avanza Bank Holding AB	20.823.151	1,16			20.583	0,00
3.945.862	Dometic Group AB	28.426.040	1,58				
2.169.313	Elekta AB - B	26.248.643	1,46				
2.486.142	Hexpol AB	17.522.863	0,98				
584.935	Thule Group AB	10.171.809	0,57				
	Summe Schweden	103.192.506	5,75				
SCHWEIZ				Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
8.696	Belimo Holding AG - Reg	43.916.239	2,45			20.583	0,00
84.355	Burckhardt Compression Holding AG	19.399.213	1,08				
24.991	LEM Holding SA	27.356.710	1,52				
3.161.191	SIG Combibloc Group AG	38.675.474	2,15				
330.200	Sika AG	44.346.892	2,47				
304.581	Vat Group AG	35.260.567	1,97				
	Summe Schweiz	208.955.095	11,64				
VEREINIGTE STAATEN				Wert der Anlagen insgesamt			
262.482	Autoliv Inc.	18.781.901	1,05			1.790.446.869	99,81
	Summe Vereinigte Staaten	18.781.901	1,05				
	Summe Aktien	1.790.426.286	99,81				
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	1.790.426.286	99,81				
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente							
Aktien							
DÄNEMARK							
280.528	Ow Bunker A/S	0	0,00				
	Summe Dänemark	0	0,00				
	Summe Aktien	0	0,00				
	Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	0	0,00				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				
Aktien				Aktien (Fortsetzung)				
AUSTRALIEN				INDIEN (Fortsetzung)				
73.063	Australia & New Zealand Banking Group Limited	1.405.390	2,40	83.860	Infosys Technologies Limited - ADR	953.488	1,64	
84.314	BHP Group Limited	2.088.104	3,59	408.876	Petronet Lng Limited	1.499.532	2,57	
108.010	Dexus	869.069	1,49	Summe Indien			4.944.299	8,50
112.975	Fortescue Metals Group Limited	670.525	1,15	INDONESIEN				
107.351	Lendlease Group	1.271.395	2,18	4.071.200	Bank Rakyat Indonesia	1.181.682	2,03	
18.320	Macquarie Group Limited	1.619.615	2,78	5.269.100	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	1.599.907	2,75	
127.938	Oz Minerals Limited	829.226	1,42	Summe Indonesien			2.781.589	4,78
184.572	Sydney Airport Finance Company Pty Limited	999.611	1,72	MACAU				
151.360	Transurban Group	1.499.625	2,57	430.400	Wynn Macau Limited	840.004	1,44	
Summe Australien			19,30	Summe Macau			840.004	1,44
KAIMANINSELN				PHILIPPINEN				
1.492.000	China Resources Cement Holdings Limited	1.495.923	2,57	969.520	Ayala Land Inc.	925.008	1,59	
306.000	China Resources Land Limited	1.282.255	2,19	Summe Philippinen			925.008	1,59
358.800	Sands China Limited	1.624.796	2,79	SÜDKOREA				
Summe Kaimaninseln			7,55	24.321	KB Financial Group Inc.	868.212	1,49	
CHINA				25.443	Orange Life Insurance Limited	575.377	0,99	
1.589.000	China Construction Bank Corp.	1.212.113	2,08	124.852	Samsung Electronics Company Limited Pfd	4.122.961	7,06	
233.000	China Merchants Bank Company Limited - H	1.108.620	1,90	4.783	SK Innovation Company Limited P.P. 144A	663.781	1,14	
170.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.958.511	3,36	Summe Südkorea			6.230.331	10,68
70.100	Wuliangye Yibin Company Limited	1.274.148	2,19	SINGAPUR				
Summe China			9,53	369.000	Capitaland Limited	941.912	1,62	
HONGKONG				469.300	Lendlease Global Commercial REIT	298.636	0,51	
228.000	Aia Group Limited	2.153.663	3,69	532.400	Mapletree Commercial Trust	881.623	1,51	
135.500	China Mobile Limited	1.120.901	1,92	73.200	United Overseas Bank Limited	1.358.241	2,33	
882.000	Cnooc Limited	1.345.605	2,31	Summe Singapur			3.480.412	5,97
29.927	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	878.029	1,51	TAIWAN				
72.500	Sun Hung Kai Properties Limited	1.043.194	1,79	238.000	Chroma ATE Inc.	1.127.704	1,93	
768.000	Xinyi Glass Holdings Limited	845.454	1,45	163.000	MediaTek Inc.	1.938.718	3,33	
Summe Hongkong			12,67	428.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	3.752.437	6,44	
INDIEN				157.000	Yageo Corp.	1.247.433	2,15	
265.200	Embassy Office Parks REIT	1.502.657	2,59	Summe Taiwan			8.066.292	13,85
57.078	HDFC Bank Limited	988.622	1,70					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
THAILAND			
1.164.200	Samui Airport Property Fund	980.166	1,68
318.000	Thai Oil plc	725.214	1,24
	Summe Thailand	1.705.380	2,92
	Summe Aktien	57.569.087	98,78
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	57.569.087	98,78
	Wert der Anlagen insgesamt	57.569.087	98,78
	(Gesamtkosten: USD 52.714.504)		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
111.000	Western Digital Corp.	6.620.040	2,52
66.370	Xperi Corp.	1.372.532	0,52
	Summe Vereinigte Staaten	219.389.532	83,53
	Summe Aktien	256.471.241	97,64
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	256.471.241	97,64
	Wert der Anlagen insgesamt	256.471.241	97,64
(Gesamtkosten: USD 225.014.945)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert GBP	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert GBP	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
IRLAND				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
132.611	CRH plc	3.697.195	1,39	571.261	Prudential plc	8.426.100	3,18
	Summe Irland	3.697.195	1,39	133.859	Reckitt Benckiser Group plc	8.492.015	3,21
				435.947	RELX plc	8.424.676	3,19
JERSEY - KANALINSELN				674.798	Rentokil Initial plc	3.156.705	1,19
3.599.144	Breedon Group plc	2.350.241	0,89	206.636	Rio Tinto plc	8.697.309	3,29
59.909	Ferguson plc	3.560.991	1,34	463.583	Rolls-Royce Holdings plc	3.673.432	1,39
	Summe Jersey - Kanalinseln	5.911.232	2,23	781.931	Rotork plc	2.435.715	0,92
VEREINIGTES KÖNIGREICH				588.416	Royal Dutch Shell plc - B	14.098.447	5,33
201.719	Aggreko plc	1.675.881	0,63	581.408	Royal Mail plc	1.230.841	0,47
212.125	Associated British Foods plc	4.885.239	1,85	433.800	RSA Insurance Group	2.317.360	0,88
3.148.255	Barclays plc	4.734.976	1,79	683.754	Sage Group plc	4.727.475	1,79
47.533	Berkeley Group Holdings plc	1.986.404	0,75	96.905	Schroders plc	2.349.946	0,89
295.675	British American Tobacco plc	8.892.425	3,36	270.109	Smith & Nephew plc	5.291.435	2,00
3.132.118	BT Group plc	5.593.336	2,11	232.658	Smiths Group plc	3.652.731	1,38
98.270	Burberry Group plc	2.136.390	0,81	197.485	SSP Group plc	1.224.407	0,46
124.206	Carnival plc	4.185.742	1,58	404.692	St James's Place plc	3.963.553	1,50
2.095.860	Cobham plc	3.287.356	1,24	1.168.035	Stagecoach Group plc	1.561.663	0,59
274.684	Compass Group	5.749.136	2,17	760.461	Standard Chartered plc	5.203.074	1,97
736.077	Crest Nicholson Holdings plc	2.789.732	1,05	2.330.571	Tesco plc	5.616.676	2,11
65.599	Derwent London plc	2.210.686	0,84	172.659	Unilever plc	8.443.025	3,19
305.114	Diageo plc	10.169.450	3,84	353.076	Weir Group plc	5.033.098	1,90
951.630	DS Smith plc	3.429.675	1,30	89.772	Whitbread plc	3.854.810	1,46
277.167	Easyjet plc	3.187.420	1,20		Summe Vereinigtes Königreich	254.385.184	96,13
820.064	Elementis plc	1.212.875	0,46		Summe Aktien	263.993.611	99,75
77.717	Euromoney Institutional Investor plc	1.150.212	0,43		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	263.993.611	99,75
226.056	Fdm Group Holdings plc	1.670.554	0,63		Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren		
785.246	Glaxosmithkline plc	13.699.402	5,18		Fonds		
1.234.445	Grainger plc	3.036.735	1,15		IRLAND		
237.362	Greene King plc	2.010.456	0,76	77.677	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	77.677	0,03
513.885	Howden Joinery Group plc	2.879.812	1,09		Summe Irland	77.677	0,03
458.078	Hunting plc	2.099.830	0,79		Summe Fonds	77.677	0,03
243.970	Imperial Brands plc	4.460.260	1,69		Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	77.677	0,03
316.984	Inchcape plc	2.001.754	0,76		Wert der Anlagen insgesamt	264.071.288	99,78
634.069	Informa plc	5.402.268	2,04		(Gesamtkosten: GBP 258.532.776)		
79.515	InterContinental Hotels Group plc	4.035.386	1,52				
305.529	Intermediate Capital Group plc	4.445.447	1,68				
4.358.423	ITV plc	5.487.254	2,07				
743.295	John Wood Group plc	2.823.777	1,07				
190.429	Johnson Matthey plc	5.821.414	2,20				
282.932	Land Securities Group plc	2.423.030	0,91				
1.756.950	Legal & General Group plc	4.364.264	1,65				
74.541	London Stock Exchange Group plc	5.447.456	2,06				
1.549.929	Melrose Industries plc	3.124.657	1,18				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert GBP	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert GBP	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
GUERNSEY - KANALINSELN				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
2.136.113	Sherborne Investors Guernsey C	1.089.418	0,61	1.329.194	Tesco plc	3.203.358	1,81
1.288.866	Sherborne Investors Guernsey B	103.109	0,06	130.213	Unilever plc	6.367.416	3,59
	Summe Guernsey - Kanalinseln	1.192.527	0,67	153.944	United Utilities Group plc	1.271.270	0,72
				800.091	Wincanton plc	1.792.204	1,01
				3.084.573	WM Morrison Supermarkets plc	6.178.399	3,49
					Summe Vereinigtes Königreich	169.706.427	95,76
JERSEY - KANALINSELN				Summe Aktien			
52.185	Ferguson plc	3.101.876	1,75			174.000.830	98,18
	Summe Jersey - Kanalinseln	3.101.876	1,75	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			
						174.000.830	98,18
VEREINIGTES KÖNIGREICH				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
482.490	3i Group plc	5.628.246	3,18	Fonds			
219.620	Astrazeneca plc	15.946.607	8,99	IRLAND			
802.534	BAE Systems plc	4.574.444	2,58	2.000.535	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	2.000.535	1,13
2.398.283	BT Group plc	4.282.854	2,42		Summe Irland	2.000.535	1,13
2.586.056	Centrica plc	1.906.958	1,08	Summe Fonds			
635.642	Chesnara plc	1.789.332	1,01			2.000.535	1,13
2.805.174	Cobham plc	4.399.915	2,48	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
210.785	Compass Group	4.411.730	2,49			2.000.535	1,13
868.047	DS Smith plc	3.128.441	1,77	Wert der Anlagen insgesamt			
1.221.241	Electrocomponents plc	7.862.350	4,43			176.001.365	99,31
780.183	Elementis plc	1.153.891	0,65	(Gesamtkosten: GBP 174.274.022)			
653.842	Glaxosmithkline plc	11.406.928	6,44				
75.918	Go-Ahead Group plc	1.528.989	0,86				
1.706.520	Hays plc	2.573.432	1,45				
156.185	Imi plc	1.499.688	0,85				
339.096	Imperial Brands plc	6.199.353	3,50				
2.930.316	ITV plc	3.689.268	2,08				
193.478	JD Wetherspoon plc	2.998.909	1,69				
115.024	Johnson Matthey plc	3.516.283	1,99				
1.701.887	Legal & General Group plc	4.227.487	2,39				
1.960.162	Marks & Spencer Group plc	3.615.519	2,04				
1.474.134	Melrose Industries plc	2.971.854	1,68				
383.208	Morgan Advanced Materials plc	997.874	0,56				
121.125	Morgan Sindall plc	1.475.303	0,83				
178.686	Oxford Instruments plc	2.283.607	1,29				
577.163	Pearson plc	4.259.463	2,40				
157.052	Pennon Group plc	1.298.820	0,73				
864.916	Phoenix Group Holdings plc	5.979.164	3,37				
782.116	Rank Group plc	1.482.892	0,84				
238.110	RELX plc	4.601.476	2,60				
1.749.710	Rentokil Initial plc	8.185.143	4,61				
236.869	Royal Dutch Shell plc - B	5.675.381	3,20				
1.214.314	RSA Insurance Group	6.486.866	3,66				
238.910	Smiths Group plc	3.750.887	2,12				
1.046.024	Stagecoach Group plc	1.398.534	0,79				
503.518	Tate & Lyle plc	3.705.892	2,09				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
ÄGYPTEN				NIGERIA (Fortsetzung)			
488.200	Cleopatra Hospital	181.579	2,37	140.400	Seplat Petroleum Development	198.967	2,59
151.406	Commercial International Bank	721.926	9,40	161.547.689	Standard Alliance Insurance*	0	0,00
115.852	Credit Agricole	295.573	3,85	4.823.000	Zenith Bank plc	249.466	3,25
279.117	Eastern Company SAE	291.879	3,80		Summe Nigeria	1.284.583	16,73
283.225	Edita Food Industries	295.827	3,85				
188.130	EISwedy Cables Holding Company	154.864	2,02				
242.386	Ibnsina Pharma SAE	148.714	1,94	87.300	Vivo Energy plc	134.475	1,75
128.809	Juhayna Food Industries	69.289	0,90		Summe Vereinigtes Königreich	134.475	1,75
368.000	Obour Land for Food Industries	118.774	1,55				
	Summe Ägypten	2.278.425	29,68				
JERSEY - KANALINSELN				Summe Aktien			
39.588	Centamin plc	61.322	0,80			7.377.359	96,09
	Summe Jersey - Kanalinseln	61.322	0,80				
KENIA				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			
1.202.000	Co-operative Bank of Kenya Limited	137.731	1,79			7.377.359	96,09
181.846	East African Breweries Limited	339.256	4,42	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
797.368	KCB Group Limited	322.470	4,20	Aktien			
2.830.045	Safaricom Limited	749.389	9,75	TANSANIA			
	Summe Kenia	1.548.846	20,16	1.340.500	CRDB Bank plc	58.312	0,76
				14.050	Tanzania Breweries Limited	69.674	0,91
					Summe Tansania	127.986	1,67
MAURITIUS				SIMBABWE			
51.000	MCB Group Limited	416.515	5,43	193.596	Afrasia Zimbabwe Holdings Limited*	0	0,00
	Summe Mauritius	416.515	5,43		Summe Simbabwe	0	0,00
MAROKKO				Summe Aktien			
7.470	Attijariwafa Bank	367.442	4,79			127.986	1,67
1.240	LafargeHolcim Maroc SA	216.247	2,82	Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
39.400	Maroc Telecom	573.937	7,48			127.986	1,67
930	Societe des Brasseries du Maroc	252.818	3,29	Wert der Anlagen insgesamt			
13.150	Societe d'Exploitation des Ports	242.749	3,16			7.505.345	97,76
	Summe Marokko	1.653.193	21,54	(Gesamtkosten: USD 7.644.932)			
NIGERIA				<i>*Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.</i>			
358.000	Dangote Cement plc	150.020	1,95				
3.900.000	Guaranty Trust Bank plc	314.992	4,10				
322.723	MTN Nigeria Communications plc	116.491	1,52				
66.000	Nestle Nigeria plc	254.647	3,32				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Aktien				Fonds			
NIEDERLANDE				IRLAND			
16.704	NXP Semiconductor NV	1.822.740	0,99	15.238.706	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	15.238.706	8,25
	Summe Niederlande	1.822.740	0,99		Summe Irland	15.238.706	8,25
VEREINIGTE STAATEN				Summe Fonds			
12.430	Activision Blizzard Inc.	657.796	0,36	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
8.786	Adobe Inc.	2.427.132	1,31	15.238.706			
15.518	Alexion Pharmaceuticals Inc.	1.519.833	0,82	Wert der Anlagen insgesamt			
5.557	Alphabet Inc. - A	6.785.875	3,68	102.809.409			
2.026	Amazon.com Inc.	3.516.954	1,90	(Gesamtkosten: USD 89.997.233)			
8.725	Analog Devices Inc.	974.844	0,53				
5.997	Apple Inc.	1.343.148	0,73				
86.134	Bank of America Corp.	2.512.529	1,36				
39.901	Berkshire Hathaway Inc.	8.300.206	4,49				
3.117	Biogen Idec Inc.	725.700	0,39				
24.813	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	1.672.396	0,92				
1.969	Booking Holdings Inc.	3.864.379	2,09				
387.852	Centennial Resource Development - A	1.751.152	0,95				
4.849	Charter Communications Inc. - A	1.998.370	1,08				
8.722	Colgate-Palmolive Company	641.154	0,35				
3.985	Curtiss-Wright Corp.	515.539	0,28				
8.274	Edwards Lifesciences Corp.	1.819.535	0,99				
30.203	Facebook Inc. - A	5.378.551	2,91				
3.158	Illumina Inc.	960.727	0,52				
29.351	JPMorgan Chase & Company	3.454.319	1,87				
5.640	L3Harris Technologies Inc.	1.176.730	0,64				
24.114	Lam Research Corp.	5.572.987	3,01				
15.040	Mastercard Inc. - A	4.084.413	2,21				
9.148	Microsoft Corp.	1.271.846	0,69				
34.269	Moderna Inc.	545.562	0,30				
14.406	Norfolk Southern Corp.	2.588.182	1,40				
127.947	Nutanix Inc. - A	3.358.609	1,82				
15.738	Phillips 66	1.611.571	0,87				
156.566	Uber Technologies Inc.	4.770.566	2,58				
1.909	UnitedHealth Group Inc.	414.864	0,22				
9.845	Vertex Pharmaceuticals Inc.	1.667.940	0,90				
17.251	Visa Inc. - A	2.967.345	1,61				
6.243	VMware Inc. - A	936.825	0,51				
15.885	Walt Disney Company	2.070.133	1,12				
178.494	WPX Energy Inc.	1.890.251	1,02				
	Summe Vereinigte Staaten	85.747.963	46,43				
	Summe Aktien	87.570.703	47,42				
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	87.570.703	47,42				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				FRANKREICH			
USD	3.672.000 APT Pipelines Limited 4.20% 23/03/2025	3.577.155	0,21	EUR	1.706.000 Altice France SA 2.50% 15/01/2025	1.734.432	0,10
GBP	3.392.000 APT Pipelines Limited 4.25% 26/11/2024	4.342.788	0,26	EUR	4.195.000 Altice France SA 3.38% 15/01/2028	4.270.439	0,25
USD	5.869.000 BHP Billiton Finance Limited FRN 19/10/2075	6.308.691	0,37	EUR	8.000.000 Altice France SA 5.88% 01/02/2027	8.876.240	0,52
EUR	6.350.000 BHP Billiton Finance Limited FRN 22/10/2079	7.769.330	0,46	GBP	9.100.000 Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.75% 19/12/2024	10.518.795	0,62
EUR	4.300.000 Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	4.504.596	0,27	USD	6.265.000 BNP Paribas SA Perp FRN	6.068.465	0,36
AUD	800.000 SGSP Australia Assets Pty Limited 5.50% 12/03/2021	524.294	0,03	EUR	4.800.000 Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	4.447.404	0,26
EUR	8.471.000 SGSP Australia Assets Pty Limited 2.00% 30/06/2022	8.933.887	0,52	EUR	5.100.000 Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	5.440.658	0,32
USD	8.152.000 SGSP Australia Assets Pty Limited 3.25% 29/07/2026	7.736.564	0,46	USD	4.500.000 Credit Agricole SA Perp FRN	4.459.686	0,26
	Summe Australien	43.697.305	2,58	EUR	9.900.000 Orange SA 0.00% 04/09/2026	9.767.322	0,58
				EUR	6.000.000 Sanofi 0.00% 13/01/2020	6.007.839	0,35
					Summe Frankreich	61.591.280	3,62
BELGIEN				DEUTSCHLAND			
EUR	6.700.000 Belfius Bank SA Perp FRN	7.112.050	0,42	EUR	6.600.000 Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	6.716.886	0,40
EUR	2.600.000 KBC Group NV Perp FRN	2.781.634	0,16	EUR	2.900.000 Adler Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	3.077.313	0,18
	Summe Belgien	9.893.684	0,58	EUR	4.400.000 Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	4.357.892	0,26
KANADA				EUR	7.097.000 BASF SE FRN 15/11/2019	7.100.737	0,42
USD	7.500.000 Cenovus Energy Inc. 3.80% 15/09/2023	7.098.617	0,42	EUR	3.798.000 Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	3.939.854	0,23
	Summe Kanada	7.098.617	0,42	EUR	8.275.000 Deutsche Bank AG 1.13% 30/08/2023	8.539.096	0,50
KAIMANINSELN				EUR	16.183.000 HeidelbergCement AG 8.50% 31/10/2019	16.294.370	0,96
USD	4.878.000 Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	4.871.831	0,29	EUR	3.159.000 Innogy Finance BV 5.75% 14/02/2033	5.151.793	0,30
USD	4.489.000 Noble Holding International Limited 8.95% 01/04/2045	2.105.119	0,12	EUR	5.630.000 Safari Verwaltungs GmbH 5.38% 30/11/2022	3.641.822	0,21
USD	1.172.000 Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	1.153.937	0,07	EUR	4.979.000 SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	4.726.067	0,28
GBP	5.506.000 Thames Water Utilities Cayman 2.88% 03/05/2027	6.333.316	0,37	EUR	5.073.000 Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	5.502.817	0,32
	Summe Kaimaninseln	14.464.203	0,85	EUR	1.940.000 Thyssenkrupp AG 2.75% 08/03/2021	1.988.750	0,12
FINNLAND				EUR	5.000.000 Vier Gas Transport GmbH 0.50% 10/09/2034	4.906.516	0,29
EUR	1.768.000 Sampo Oyj FRN 23/05/2049	1.999.396	0,12		Summe Deutschland	75.943.913	4,47
	Summe Finnland	1.999.396	0,12				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
INDIEN				LUXEMBURG			
USD	8.251.000 GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	7.041.429	0,42	USD	6.625.000 Altice Finco SA 8.13% 15/01/2024	6.286.302	0,37
	Summe Indien	7.041.429	0,42	EUR	197.000 Altice Finco SA 9.00% 15/06/2023	204.983	0,01
IRLAND				EUR	9.375.000 Altice Luxembourg SA 8.00% 15/05/2027	10.323.023	0,61
EUR	10.700.000 Abbott Ireland Financing DAC 0.00% 27/09/2020	10.712.631	0,63	EUR	14.880.000 Bevco Lux Sarl 1.75% 09/02/2023	15.565.953	0,92
EUR	8.380.000 AIB Group plc 2.25% 03/07/2025	9.007.880	0,53	EUR	8.245.000 Crystal Almond Sarl 10.00% 01/11/2021	8.530.882	0,50
EUR	2.707.000 Allied Irish Banks FRN 29/12/2049	2.882.206	0,17	EUR	2.750.000 DH Europe Finance II Sarl 0.45% 18/03/2028	2.759.920	0,16
EUR	2.941.000 Bank of Ireland Perp FRN	3.059.715	0,18	EUR	3.928.000 Fiat Chrysler Finance Europe SA 6.75% 14/10/2019	3.936.465	0,23
EUR	7.369.000 Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	7.881.027	0,47	EUR	15.300.000 Grand City Properties SA 1.38% 03/08/2026	15.954.852	0,94
EUR	2.352.000 ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	2.527.192	0,15	EUR	4.300.000 Grand City Properties SA Perp FRN	4.598.384	0,27
USD	10.665.000 GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	10.291.434	0,61	EUR	3.359.000 Groupe Ecore Holding SAS FRN 15/11/2023	3.248.663	0,19
GBP	4.150.000 GE Capital UK Funding Unlimited Company 5.88% 04/11/2020	4.907.805	0,29	EUR	10.174.000 Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/02/2022	10.425.637	0,62
EUR	3.500.000 Zurich Finance Ireland Designated Activity Company 1.63% 17/06/2039	3.937.583	0,23	EUR	914.000 Leonardo SpA 4.50% 19/01/2021	965.564	0,06
	Summe Irland	55.207.473	3,26	GBP	7.163.000 Leonardo SpA 8.00% 16/12/2019	8.204.878	0,48
ITALIEN				EUR	4.034.000 LSF10 Wolverine Investments SCA 5.00% 15/03/2024	4.154.363	0,25
EUR	3.870.000 Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	3.939.713	0,23	EUR	1.530.000 Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	1.564.152	0,09
EUR	11.599.000 Banco BPM SpA 2.00% 08/03/2022	11.904.006	0,71	EUR	1.855.000 Medtronic Global Holdings SCA FRN 07/03/2021	1.862.275	0,11
EUR	3.804.000 FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	3.808.299	0,22	EUR	1.069.000 Medtronic Global Holdings SCA 1.00% 02/07/2031	1.114.236	0,07
EUR	6.869.000 Nexi Capital SpA 4.13% 01/11/2023	7.074.864	0,42	EUR	15.479.000 Selp Finance Sarl 1.25% 25/10/2023	16.070.871	0,94
	Summe Italien	26.726.882	1,58		Summe Luxemburg	115.771.403	6,82
JERSEY - KANALINSELN				NIEDERLANDE			
GBP	3.840.000 CpuK Finance Limited 4.25% 28/08/2022	4.436.350	0,26	EUR	4.579.000 ABN Amro Bank NV 0.50% 15/04/2026	4.688.479	0,28
GBP	1.470.000 CpuK Finance Limited 4.88% 28/08/2025	1.716.955	0,10	EUR	5.000.000 Deutsche Telekom International Finance BV FRN 03/04/2020	5.008.032	0,30
EUR	7.125.000 Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	7.435.214	0,44	EUR	10.000.000 Deutsche Telekom International Finance BV 0.38% 30/10/2021	10.107.942	0,60
	Summe Jersey - Kanalinseln	13.588.519	0,80	EUR	3.678.000 Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	3.816.799	0,23
				GBP	7.450.000 Intergen NV 7.50% 30/06/2021	8.354.168	0,49
				GBP	3.615.000 Koninklijke KPN NV FRN 14/03/2073	4.180.843	0,25

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
NIEDERLANDE (Fortsetzung)				SCHWEIZ					
EUR	7.700.000	Nederlandse Gasunie NV 0.00% 18/11/2019	7.702.286	0,46	USD	6.600.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	6.658.598	0,39
EUR	9.000.000	Selecta Group BV 5.88% 01/02/2024	9.373.541	0,55	USD	9.000.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	8.351.297	0,49
EUR	2.985.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.00% 05/09/2021	3.000.730	0,18	USD	3.906.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	3.816.608	0,23
EUR	8.609.000	Stedin Holding NV Perp FRN	9.110.546	0,54	Summe Schweiz				
USD	19.696.000	Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	19.113.233	1,13	18.826.503 1,11				
EUR	8.400.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	8.573.145	0,51	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
GBP	1.400.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.674.917	0,10	GBP	4.453.000	Ardonagh Midco 3 Plc 8.38% 15/07/2023	4.848.155	0,29
EUR	10.541.000	TenneT Holding BV Perp FRN	11.284.811	0,66	GBP	6.945.000	Barclays Bank plc 5.75% 14/09/2026	9.516.197	0,56
EUR	1.516.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 0.38% 25/07/2020	1.479.195	0,09	EUR	200.000	Barclays Bank plc 6.63% 30/03/2022	229.083	0,01
USD	5.000.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 2.20% 21/07/2021	4.205.077	0,25	GBP	4.400.000	Barclays Bank plc Perp FRN	5.278.758	0,31
GBP	2.400.000	Volkswagen Financial Services NV 2.75% 10/07/2023	2.814.736	0,17	GBP	9.752.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	12.503.068	0,74
EUR	3.200.000	Vonovia Finance BV 0.13% 06/04/2023	3.207.736	0,19	EUR	3.572.000	Cadent Finance plc 0.63% 22/09/2024	3.647.601	0,22
Summe Niederlande			117.696.216	6,98	GBP	8.750.000	Cadent Finance plc 2.13% 22/09/2028	10.157.234	0,60
NORWEGEN				GBR					
EUR	5.299.000	DNB Bank ASA 0.25% 09/04/2024	5.356.129	0,32	GBP	15.547.000	Co-operative Group 6.88% 08/07/2020	18.304.937	1,08
Summe Norwegen			5.356.129	0,32	GBP	2.450.000	Cybg plc FRN 09/02/2026	2.748.163	0,16
SPANIEN				EUR					
EUR	3.200.000	Bankia SA FRN 15/02/2029	3.434.838	0,20	EUR	12.106.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	11.961.372	0,70
EUR	9.700.000	Caixabank SA 1.13% 17/05/2024	10.110.106	0,60	EUR	5.998.000	DS Smith plc 1.38% 26/07/2024	6.195.508	0,37
EUR	8.975.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	9.748.118	0,58	USD	16.724.044	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	12.674.961	0,75
Summe Spanien			23.293.062	1,38	GBP	8.970.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	11.494.319	0,68
SCHWEDEN				EUR					
EUR	6.145.000	Akelius Residential Property AB FRN 05/10/2078	6.604.345	0,39	EUR	10.015.000	G4S International Finance plc 1.50% 02/06/2024	10.326.876	0,61
EUR	6.327.000	Akelius Residential Property AB 1.50% 23/01/2022	6.537.541	0,39	EUR	8.485.000	G4S International Finance plc 1.88% 24/05/2025	8.864.404	0,52
EUR	15.400.000	Akelius Residential Property AB 1.75% 07/02/2025	16.239.493	0,96	GBP	9.441.000	GKN Holdings plc 4.63% 12/05/2032	10.880.640	0,64
EUR	3.582.000	Akelius Residential Property AB 3.38% 23/09/2020	3.703.297	0,22	GBP	3.919.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	4.813.350	0,28
Summe Schweden			33.084.676	1,96	GBP	7.733.000	GKN Holdings plc 6.75% 28/10/2019	8.772.627	0,52
				GBP					
				224.437					
				Greene King Finance plc FRN 15/09/2021				253.189	0,01
				EUR					
				6.500.000					
				HBOS plc FRN 18/03/2030				7.423.920	0,44
				GBP					
				2.920.000					
				HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033				4.296.938	0,25
				GBP					
				5.550.000					
				HSBC Holdings plc Perp FRN				6.643.033	0,39
				EUR					
				5.930.000					
				Imperial Brands Finance plc 1.13% 14/08/2023				6.062.175	0,36

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
GBP	1.834.233	Intu Debenture plc 5.56% 31/12/2027	1.679.652	0,10	GBP	819.390	Telereal Securitisation plc 5.55% 10/12/2031	1.146.053	0,07	
GBP	4.655.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.75% 24/01/2021	4.968.909	0,29	GBP	6.778.609	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	9.992.800	0,59	
GBP	4.630.000	Legal & General Group plc FRN 23/07/2041	6.015.715	0,36	GBP	8.021.217	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	11.721.593	0,69	
GBP	5.320.000	Lloyds Bank Corporate Markets plc 1.75% 11/07/2024	6.050.993	0,36	GBP	9.550.000	Thames Water Utilities Finance plc 5.05% 30/06/2020	11.074.752	0,65	
GBP	12.060.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	17.506.269	1,04	GBP	7.120.000	Tsb Banking Group plc FRN 06/05/2026	8.167.336	0,48	
GBP	1.279.000	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	1.321.619	0,08	USD	8.500.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	8.432.448	0,50	
GBP	79.590	Marston's Issuer plc FRN 15/07/2020	89.627	0,01	GBP	9.010.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	10.924.392	0,64	
GBP	1.967.182	Mitchells & Butlers Finance plc 5.57% 15/12/2030	2.571.673	0,15	Summe Vereinigtes Königreich				380.457.431	22,46
GBP	263.030	Mitchells & Butlers Finance plc 5.97% 15/12/2023	318.892	0,02	VEREINIGTE STAATEN					
EUR	5.941.000	National Express Group plc FRN 15/05/2020	5.937.510	0,35	USD	10.000.000	American Electric Power Company Inc. 3.20% 13/11/2027	9.589.487	0,57	
GBP	1.507.000	Nationwide Building Society Perp FRN	1.743.780	0,10	GBP	5.500.000	American International Group Inc. 5.00% 26/04/2023	7.018.678	0,41	
EUR	4.906.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	4.881.012	0,29	USD	14.650.000	Anheuser-Busch Companies LLC 3.65% 01/02/2026	14.419.041	0,85	
EUR	1.770.000	OTE plc 3.50% 09/07/2020	1.816.122	0,11	USD	5.380.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	6.259.799	0,37	
EUR	3.276.000	OTE plc 4.38% 02/12/2019	3.299.751	0,19	EUR	10.280.000	AT&T Inc. FRN 05/09/2023	10.427.797	0,61	
GBP	14.160.000	Pennon Group plc Perp FRN	16.122.645	0,95	USD	2.820.000	AT&T Inc. 3.80% 15/02/2027	2.742.476	0,16	
GBP	2.155.000	Prudential plc FRN 20/07/2049	2.499.155	0,15	EUR	9.081.000	Avantor Inc. 4.75% 01/10/2024	9.725.186	0,57	
EUR	2.341.000	Royal Bank of Scotland FRN 02/03/2026	2.447.521	0,14	USD	22.350.000	BAT Capital Corp. 3.22% 15/08/2024	20.745.144	1,22	
GBP	10.475.000	Royal Bank of Scotland Group plc FRN 19/09/2026	12.225.493	0,73	USD	11.328.000	Bayer USA Finance II LLC 4.25% 15/12/2025	11.101.669	0,66	
USD	7.700.000	Royal Bank of Scotland Group plc FRN 08/05/2030	7.574.608	0,45	EUR	15.265.000	Becton Dickinson and Company 1.40% 24/05/2023	15.866.063	0,94	
USD	4.600.000	Santander UK plc 2.88% 18/06/2024	4.288.765	0,25	USD	7.400.000	Becton Dickinson and Company 2.40% 05/06/2020	6.793.786	0,40	
GBP	3.100.000	Santander UK plc 10.06% 29/10/2049	5.663.442	0,33	USD	16.245.000	Becton Dickinson and Company FRN 06/06/2022	14.967.927	0,88	
GBP	8.612.000	Severn Trent Water 3.63% 16/01/2026	10.970.145	0,65	USD	6.629.000	Becton Dickinson and Company 3.70% 06/06/2027	6.453.446	0,38	
GBP	604.000	Stonegate Pub Company Financing plc FRN 15/03/2022	690.952	0,04	GBP	2.394.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 2.63% 19/06/2059	3.173.893	0,19	
EUR	5.370.000	Synlab Bondco plc FRN 01/07/2022	5.398.081	0,32	EUR	7.244.000	Berkshire Hathaway Inc. 0.25% 17/01/2021	7.285.600	0,42	
GBP	6.104.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	7.165.508	0,42	EUR	7.000.000	Berkshire Hathaway Inc. 0.50% 13/03/2020	7.021.005	0,41	
GBP	4.010.108	Telereal Securitisation plc 4.97% 10/09/2027	5.214.426	0,31	USD	12.782.000	Broadcom Cayman Finance 3.63% 15/01/2024	11.987.341	0,71	
GBP	1.891.095	Telereal Securitisation plc 5.43% 10/12/2031	2.639.284	0,16						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					BRITISCHE JUNGFERNINSELN				
USD	3.949.000	Continental Resources Inc. 5.00% 15/09/2022	3.656.447	0,22	GBP	5.330.000	Global Switch Holdings Limited 4.38% 13/12/2022	6.582.216	0,39
EUR	5.333.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	5.886.730	0,34	Summe Britische Jungfernseln 6.582.216 0,39				
GBP	10.701.000	Digital Stout Holding LLC 3.30% 19/07/2029	13.151.858	0,78	Summe Anleihen 1.359.540.439 80,24				
USD	6.000.000	Duke Energy Corp 3.40% 15/06/2029	5.788.775	0,34	Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen				
EUR	8.930.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	9.275.177	0,55	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
EUR	5.135.000	Equinix Inc. 2.88% 01/02/2026	5.360.752	0,32	GBP	7.841.436	Towd Point Mortgage Funding 2016 - Auburn 10 plc FRN 20/04/2045	8.866.213	0,52
EUR	4.401.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	4.716.996	0,28	Summe Vereinigtes Königreich 8.866.213 0,52				
EUR	6.233.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	6.940.533	0,41	Summe Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen 8.866.213 0,52				
EUR	1.969.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	2.431.017	0,14	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
EUR	854.000	Fiserv Inc. 0.38% 01/07/2023	862.615	0,05	MEXIKO				
EUR	1.408.000	Fiserv Inc. 1.13% 01/07/2027	1.466.636	0,09	GBP	1.955.000	Mexico (Govt of) Perp 5.63%	2.447.376	0,14
EUR	2.633.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	2.837.125	0,17	Summe Mexiko 2.447.376 0,14				
USD	4.725.000	Ford Motor Credit Company LLC 5.58% 18/03/2024	4.614.518	0,27	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente 2.447.376 0,14				
EUR	3.591.000	General Electric Company 2.13% 17/05/2037	3.706.060	0,22	Wandelanleihen				
EUR	9.318.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	9.513.388	0,56	FRANKREICH				
USD	17.750.000	Kinder Morgan Inc. 3.15% 15/01/2023	16.668.835	0,98	GBP	6.600.000	Orange SA 0.38% 27/06/2021	7.332.662	0,43
EUR	4.060.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	4.329.486	0,26	Summe Frankreich 7.332.662 0,43				
GBP	4.850.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	6.002.229	0,35	JERSEY - KANALINSELN				
EUR	7.360.000	Molson Coors Brewing Company 1.25% 15/07/2024	7.645.434	0,45	GBP	4.500.000	British Land White 2015 Limited 0.00% 09/06/2020	5.030.931	0,30
EUR	7.450.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	7.920.244	0,47	Summe Jersey - Kanalinseln 5.030.931 0,30				
USD	5.000.000	NiSource Inc. 3.49% 15/05/2027	4.816.089	0,28	MEXIKO				
USD	12.410.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	12.187.087	0,72	EUR	4.700.000	America Movil SAB de CV 0.00% 28/05/2020	4.692.428	0,28
USD	13.330.000	Qualcomm Inc. FRN 30/01/2023	12.284.398	0,73	Summe Mexiko 4.692.428 0,28				
USD	5.000.000	Teva Pharmaceutical Finance BV 3.65% 10/11/2021	4.259.769	0,25	Summe Wandelanleihen 17.056.021 1,01				
USD	4.310.000	Teva Pharmaceutical Finance IV LLC 2.25% 18/03/2020	3.905.598	0,23	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung 1.387.910.049 81,91				
EUR	3.362.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	3.380.054	0,20					
USD	6.410.000	Voya Financial Inc. 3.13% 15/07/2024	6.071.805	0,36					
GBP	4.336.000	Welltower Inc. 4.80% 20/11/2028	5.962.109	0,35					
Summe Vereinigte Staaten			341.220.102	20,12					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere				Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)			
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				PORTUGAL			
USD	9.912.000 APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	9.759.078	0,58	EUR	17.100.000 Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2020	3.570.053	0,21
	Summe Australien	9.759.078	0,58		Summe Portugal	3.570.053	0,21
BERMUDAS				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
USD	20.765.000 Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	20.361.370	1,20	GBP	5.119.000 Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	5.911.597	0,36
USD	27.250.000 Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	27.283.059	1,61		Summe Vereinigtes Königreich	5.911.597	0,36
	Summe Bermudas	47.644.429	2,81		Summe Anleihen	13.613.610	0,81
DÄNEMARK				Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
USD	4.907.000 Danske Bank A/S 2.70% 02/03/2022	4.525.147	0,27			13.613.610	0,81
	Summe Dänemark	4.525.147	0,27	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
FRANKREICH				Fonds			
USD	6.500.000 BPCE SA 2.70% 01/10/2029	5.934.762	0,35	IRLAND			
USD	6.470.000 Electricite de France SA 4.88% 21/09/2038	6.954.808	0,41	13.626.288	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	15.402.379	0,91
	Summe Frankreich	12.889.570	0,76	12.676.983	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	11.628.126	0,69
NIEDERLANDE				851.147	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	84.898.205	5,01
USD	3.625.000 NXP BV 3.88% 01/09/2022	3.433.922	0,20		Summe Irland	111.928.710	6,61
USD	4.036.000 Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	3.991.188	0,24		Summe Fonds	111.928.710	6,61
	Summe Niederlande	7.425.110	0,44	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
	Summe Anleihen	82.243.334	4,86			111.928.710	6,61
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt						Wert der Anlagen insgesamt	1.595.695.703
		82.243.334	4,86	(Gesamtkosten: EUR 1.529.092.917)			
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente							
Anleihen							
KANADA							
CAD	5.933.000 Canadian Natural Resources Limited 2.89% 14/08/2020	4.131.960	0,24				
	Summe Kanada	4.131.960	0,24				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)				
AUSTRALIEN				FRANKREICH (Fortsetzung)				
EUR	373.000 APT Pipelines Limited 2.00% 22/03/2027	408.359	0,46	EUR	700.000 Electricite de France SA 2.00% 02/10/2030	795.692	0,91	
USD	561.000 APT Pipelines Limited 4.20% 23/03/2025	546.510	0,62	EUR	400.000 HSBC France SA 0.10% 03/09/2027	396.106	0,45	
GBP	246.000 APT Pipelines Limited 4.25% 26/11/2024	314.955	0,36	EUR	1.000.000 Orange SA 0.00% 04/09/2026	986.599	1,12	
USD	200.000 APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	196.914	0,22	EUR	200.000 RCI Banque SA 2.00% 11/07/2024	213.974	0,24	
USD	1.000.000 AusNet Services Holdings Pty Limited FRN 17/03/2076	965.993	1,10	EUR	1.000.000 Sanofi 0.00% 21/03/2022	1.004.941	1,14	
USD	400.000 Bhp Billiton Finance FRN 19/10/2075	429.967	0,49	Summe Frankreich			6.395.152	7,27
EUR	400.000 Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	419.032	0,48	DEUTSCHLAND				
USD	20.000 Pacific National Finance Pty Limited 4.63% 23/09/2020	18.677	0,02	EUR	500.000 Adler Real Estate AG 1.50% 17/04/2022	504.864	0,58	
Summe Australien			3,75	EUR	100.000 Adler Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	106.114	0,12	
BELGIEN				EUR	400.000 Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	396.172	0,45	
GBP	175.000 Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.25% 24/05/2029	206.502	0,24	EUR	673.000 Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	698.136	0,79	
EUR	400.000 Belfius Bank SA 0.00% 28/08/2026	394.996	0,45	EUR	525.000 Deutsche Bank AG 1.13% 30/08/2023	541.755	0,62	
EUR	200.000 KBC Group NV Perp FRN	213.972	0,24	EUR	200.000 Eurogrid GmbH 1.50% 18/04/2028	218.914	0,25	
Summe Belgien			0,93	EUR	500.000 Eurogrid GmbH 1.88% 10/06/2025	548.413	0,62	
BERMUDAS				EUR	500.000 Vier Gas Transport GmbH 0.50% 10/09/2034	490.652	0,56	
EUR	810.000 Bacardi Limited 2.75% 03/07/2023	877.556	1,00	EUR	100.000 Volkswagen Bank GmbH 2.50% 31/07/2026	109.908	0,13	
Summe Bermudas			1,00	Summe Deutschland			3.614.928	4,12
FINNLAND				IRLAND				
EUR	139.000 Sampo Oyj FRN 23/05/2049	157.192	0,18	EUR	650.000 Abbott Ireland Financing DAC 0.00% 27/09/2020	650.767	0,74	
Summe Finnland			0,18	EUR	250.000 AIB Group plc 1.25% 28/05/2024	255.442	0,29	
FRANKREICH				EUR	440.000 AIB Group plc 2.25% 03/07/2025	472.967	0,54	
EUR	500.000 Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 08/06/2026	517.874	0,59	EUR	500.000 Bank of Ireland Group plc FRN 08/07/2024	500.103	0,57	
GBP	500.000 Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.75% 19/12/2024	577.956	0,66	EUR	188.000 ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	202.003	0,23	
USD	235.000 BNP Paribas SA Perp FRN	227.628	0,26	USD	600.000 GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	578.985	0,66	
EUR	700.000 Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	746.757	0,85	GBP	150.000 GE Capital UK Funding Unlimited Company 4.13% 13/09/2023	182.686	0,21	
USD	400.000 Credit Agricole SA Perp FRN	396.417	0,45	GBP	50.000 GE Capital UK Funding Unlimited Company 5.88% 04/11/2020	59.130	0,07	
EUR	500.000 Credit Mutuel Arkea SA 1.13% 23/05/2029	531.208	0,60					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
IRLAND (Fortsetzung)				MEXIKO			
GBP	100.000 Phoenix Group Holdings plc 4.13% 20/07/2022	118.111	0,13	GBP	310.000 America Movil SAB de CV FRN 06/09/2073	365.191	0,42
EUR	391.000 Zurich Finance Ireland Designated Activity Company 1.63% 17/06/2039	439.884	0,50	EUR	125.000 America Movil SAB de CV FRN 06/09/2073	151.015	0,17
	Summe Irland	3.460.078	3,94	USD	240.000 Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	229.436	0,26
					Summe Mexiko	745.642	0,85
ITALIEN				NIEDERLANDE			
EUR	100.000 Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	101.801	0,12	EUR	500.000 ABB Finance BV FRN 12/10/2020	501.561	0,57
EUR	202.000 Banco BPM SpA 2.00% 08/03/2022	207.312	0,24	EUR	325.000 ABN Amro Bank NV 0.50% 15/04/2026	332.770	0,38
EUR	250.000 FCA Bank SpA FRN 17/06/2021	249.896	0,28	GBP	72.000 Deutsche Telekom International Finance BV 2.50% 10/10/2025	86.498	0,10
EUR	380.000 FCA Bank SpA 0.50% 13/09/2024	380.429	0,43	EUR	509.000 Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	528.209	0,60
EUR	237.000 FCA Bank SpA 0.63% 24/11/2022	239.584	0,27	GBP	330.000 Innogy Finance BV 6.25% 03/06/2030	520.246	0,59
	Summe Italien	1.179.022	1,34	GBP	200.000 Innogy Finance BV 6.50% 20/04/2021	244.179	0,28
JAPAN				EUR	300.000 Nederlandse Gasunie NV 0.00% 18/11/2019	300.089	0,34
EUR	308.000 Sumitomo Mitsui Banking Corp 0.55% 06/11/2023	318.158	0,36	EUR	1.070.000 RELX Finance BV 0.38% 22/03/2021	1.077.656	1,23
	Summe Japan	318.158	0,36	EUR	765.000 Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.00% 05/09/2021	769.031	0,88
LUXEMBURG				USD	1.083.000 Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	1.050.957	1,20
EUR	300.000 Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.17% 04/06/2021	301.198	0,34	USD	200.000 Syngenta Finance NV 4.89% 24/04/2025	194.082	0,22
EUR	471.000 Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	486.715	0,55	EUR	100.000 Telefonica Europe BV Perp FRN	110.264	0,13
EUR	500.000 Bevco Lux Sarl 1.75% 09/02/2023	523.049	0,60	EUR	355.000 TenneT Holding BV 2.13% 01/11/2020	363.772	0,41
USD	200.000 CPI Property Group SA 4.75% 08/03/2023	193.045	0,22	GBP	400.000 Volkswagen Financial Services NV 2.75% 10/07/2023	469.123	0,53
EUR	291.000 DH Europe Finance II Sarl 0.45% 18/03/2028	292.050	0,33	EUR	100.000 Volkswagen International Finance NV 1.13% 02/10/2023	102.813	0,12
EUR	224.000 DH Europe Finance II Sarl 0.75% 18/09/2031	225.259	0,26	EUR	300.000 Vonovia Finance BV 0.13% 06/04/2023	300.725	0,34
EUR	500.000 Grand City Properties SA 1.38% 03/08/2026	521.400	0,59		Summe Niederlande	6.951.975	7,92
EUR	700.000 Medtronic Global Holdings SCA 0.00% 07/03/2021	701.607	0,79	NORWEGEN			
EUR	145.000 Medtronic Global Holdings SCA FRN 07/03/2021	145.569	0,17	EUR	1.039.000 DNB Bank ASA 0.25% 09/04/2024	1.050.201	1,19
EUR	101.000 Medtronic Global Holdings SCA 1.00% 02/07/2031	105.274	0,12		Summe Norwegen	1.050.201	1,19
EUR	1.300.000 Novartis Finance SA 0.00% 31/03/2021	1.307.267	1,49				
	Summe Luxemburg	4.802.433	5,46				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
USD	280.000	Royal Bank of Scotland Group plc FRN 08/05/2030	275.440	0,31	USD	325.000	BP Capital Markets America Inc. 4.23% 06/11/2028	337.787	0,38
USD	400.000	Santander UK plc 2.88% 18/06/2024	372.936	0,42	USD	165.000	Broadcom Cayman Finance 3.63% 15/01/2024	154.742	0,18
GBP	100.000	Santander UK plc 10.06% 29/10/2049	182.692	0,21	USD	210.000	Cardinal Health Inc. 4.37% 15/06/2047	185.403	0,21
GBP	200.000	Scottish Hydro Electric Transmission plc 2.25% 27/09/2035	227.686	0,26	USD	600.000	Charter Communications Operating LLC 3.58% 23/07/2020	555.350	0,63
GBP	75.000	Severn Trent Utilities Finance plc 6.13% 26/02/2024	102.098	0,12	EUR	400.000	Coca-Cola Company FRN 08/03/2021	401.716	0,46
GBP	78.975	Telereal Securitisation plc 4.97% 10/09/2027	102.693	0,12	EUR	400.000	Coca-Cola Company 0.13% 22/09/2022	403.408	0,46
GBP	158.725	Telereal Securitisation plc 5.43% 10/12/2031	221.523	0,25	EUR	540.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	596.069	0,68
GBP	429.549	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	712.489	0,81	EUR	200.000	Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	220.766	0,25
GBP	328.918	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	484.880	0,55	GBP	200.000	Digital Stout Holding LLC 3.75% 17/10/2030	254.726	0,29
GBP	122.000	TSB Bank plc FRN 15/02/2024	139.393	0,16	USD	185.000	Duke Energy Corp 2.65% 01/09/2026	170.630	0,19
GBP	700.000	TSB Banking Group plc FRN 06/05/2026	802.968	0,91	USD	540.000	Duke Energy Corp 3.40% 15/06/2029	520.990	0,59
GBP	75.000	Unite Group plc 6.13% 12/06/2020	87.063	0,10	EUR	500.000	Fidelity National Information Services Inc. FRN 21/05/2021	500.824	0,57
GBP	500.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	606.237	0,69	EUR	351.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	376.202	0,43
		Summe Vereinigtes Königreich	20.221.827	23,02	EUR	100.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	111.351	0,13
					EUR	486.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	541.169	0,61
					EUR	214.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	264.214	0,30
VEREINIGTE STAATEN									
USD	200.000	Anheuser-Busch Companies LLC 3.65% 01/02/2026	196.847	0,22	EUR	100.000	Fiserv Inc. 0.38% 01/07/2023	101.009	0,11
USD	140.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	162.894	0,19	EUR	112.000	Fiserv Inc. 1.13% 01/07/2027	116.664	0,13
EUR	500.000	AT&T Inc. 1.95% 15/09/2023	533.587	0,61	EUR	208.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	224.125	0,26
USD	600.000	AT&T Inc. 3.80% 15/02/2027	583.506	0,66	USD	275.000	Ford Motor Credit Company LLC 5.58% 18/03/2024	268.570	0,31
USD	1.100.000	BAT Capital Corp. 3.22% 15/08/2024	1.021.014	1,16	GBP	200.000	Goldman Sachs Group Inc. 3.13% 25/07/2029	246.468	0,28
USD	400.000	Bayer USA Finance II LLC 4.25% 15/12/2025	392.008	0,45	USD	410.000	Kinder Morgan Inc. 4.30% 01/06/2025	406.938	0,46
EUR	517.000	Becton Dickinson and Company 1.40% 24/05/2023	537.357	0,61	EUR	300.000	Kraft Heinz Foods Company 2.00% 30/06/2023	314.422	0,36
GBP	500.000	Becton Dickinson and Company 3.02% 24/05/2025	603.452	0,70	EUR	384.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	409.488	0,47
USD	75.000	Becton Dickinson and Company FRN 06/06/2022	69.104	0,08	GBP	461.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	570.522	0,64
GBP	139.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 2.63% 19/06/2059	184.282	0,21	EUR	394.000	Metropolitan Life Global Funding I 0.38% 09/04/2024	399.839	0,46

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				AUSTRALIEN					
USD	600.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc. 2.90% 01/04/2022	560.572	0,64	USD	500.000	Ausgrid Finance Pty Limited 3.85% 01/05/2023	477.714	0,54
USD	1.110.000	NiSource Inc. 3.49% 15/05/2027	1.069.172	1,22	USD	445.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	444.112	0,51
EUR	100.000	Petroleos Mexicanos 5.50% 24/02/2025	112.110	0,13	Summe Australien				
USD	1.260.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	1.237.367	1,42	921.826 1,05				
EUR	346.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	347.858	0,40	BERMUDAS				
EUR	1.000.000	Toyota Motor Credit Corp. 1.00% 10/09/2021	1.022.615	1,16	USD	900.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	882.507	0,99
USD	280.000	Williams Cos Inc. 4.30% 04/03/2024	273.108	0,31	USD	690.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	690.837	0,79
Summe Vereinigte Staaten			17.560.245	20,01	Summe Bermudas			1.573.344	1,78
BRITISCHE JUNGFERNINSELN				DÄNEMARK					
EUR	670.000	Global Switch Holdings Limited 1.50% 31/01/2024	698.210	0,79	USD	400.000	Danske Bank A/S 2.70% 02/03/2022	368.873	0,42
USD	240.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	232.930	0,27	Summe Dänemark				
Summe Britische Jungferinseln			931.140	1,06	368.873 0,42				
Summe Anleihen				FRANKREICH					
			77.583.762	88,33	USD	200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA FRN 20/07/2023	185.006	0,21
Wandelanleihen				FRANKREICH					
				FRANKREICH					
GBP	100.000	Orange SA 0.38% 27/06/2021	111.101	0,13	USD	1.000.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	913.040	1,03
Summe Frankreich			111.101	0,13	Summe Frankreich				
				1.098.046 1,24					
JERSEY - KANALINSELN				NIEDERLANDE					
GBP	400.000	British Land White 2015 Limited 0.00% 09/06/2020	447.193	0,51	USD	375.000	NXP BV 3.88% 01/09/2022	355.233	0,40
Summe Jersey - Kanalinseln			447.193	0,51	USD	50.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	49.445	0,06
				Summe Niederlande					
				404.678 0,46					
MEXIKO				VEREINIGTE STAATEN					
EUR	300.000	America Movil SAB de CV 0.00% 28/05/2020	299.517	0,34	USD	773.000	Broadcom Inc. 3.13% 15/04/2021	715.953	0,82
Summe Mexiko			299.517	0,34	Summe Vereinigte Staaten				
				715.953 0,82					
Summe Wandelanleihen				Summe Anleihen					
			857.811	0,98				5.082.720	5,77
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt					
			78.441.573	89,31				5.082.720	5,77

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
Anleihen				
SCHWEDEN				
USD	200.000	Nordea Bank Abp FRN 30/08/2023	182.384	0,21
		Summe Schweden	182.384	0,21
VEREINIGTE STAATEN				
USD	200.000	Metropolitan Life Global Funding I FRN 07/09/2020	183.968	0,21
CAD	800.000	Molson Coors International LP 2.75% 18/09/2020	555.857	0,63
		Summe Vereinigte Staaten	739.825	0,84
		Summe Anleihen	922.209	1,05
		Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	922.209	1,05
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren				
Fonds				
IRLAND				
	963	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	96.094	0,11
		Summe Irland	96.094	0,11
		Summe Fonds	96.094	0,11
		Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	96.094	0,11
		Wert der Anlagen insgesamt	84.542.596	96,24
(Gesamtkosten: EUR 81.709.104)				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BERMUDAS				SCHWEIZ			
82.744	IHS Markit Limited	5.076.058	4,91	12.097	Lonza Group AG - Reg	3.754.534	3,63
	Summe Bermudas	5.076.058	4,91	50.777	Nestle SA - Reg	5.057.647	4,89
				6.569	Partners Group Holding AG - Reg	4.627.516	4,48
					Summe Schweiz	13.439.697	13,00
DÄNEMARK				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
27.932	DSV A/S	2.438.432	2,36	320.561	3i Group plc	4.226.741	4,08
100.194	Novo-Nordisk A/S	4.725.673	4,56	271.358	Informa plc	2.613.319	2,52
	Summe Dänemark	7.164.105	6,92	23.397	Linde plc	4.164.666	4,02
				101.298	Smith & Nephew plc	2.243.084	2,17
					Summe Vereinigtes Königreich	13.247.810	12,79
FRANKREICH				Summe Aktien			
27.930	Air Liquide SA	3.647.658	3,52			101.759.445	98,30
58.076	Amundi SA	3.716.864	3,59	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			
94.129	Edenred	4.144.500	4,00			101.759.445	98,30
7.833	EssilorLuxottica SA	1.035.914	1,00	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
2.724	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	993.307	0,96	Fonds			
6.281	Pernod-Ricard SA	1.026.315	0,99	IRLAND			
42.461	Sanofi	3.611.733	3,49	25.155	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	2.509.145	2,42
32.465	Schneider Electric SE	2.613.433	2,52		Summe Irland	2.509.145	2,42
24.352	Teleperformance	4.843.613	4,68		Summe Fonds	2.509.145	2,42
	Summe Frankreich	25.633.337	24,75		Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	2.509.145	2,42
DEUTSCHLAND				Wert der Anlagen insgesamt			
3.639	Adidas AG	1.039.480	1,00			104.268.590	100,72
34.456	Deutsche Boerse AG	4.940.990	4,78				
	Summe Deutschland	5.980.470	5,78				
IRLAND				(Gesamtkosten: EUR 98.525.776)			
132.387	CRH plc	4.172.039	4,03				
33.285	Medtronic Inc.	3.316.288	3,20				
	Summe Irland	7.488.327	7,23				
NIEDERLANDE							
14.558	ASML Holding NV	3.308.306	3,20				
44.387	NXP Semiconductor NV	4.442.771	4,29				
34.990	Philips NV	1.487.075	1,44				
219.117	RELX plc	4.783.324	4,62				
34.980	Unilever NV	1.929.147	1,86				
72.018	Wolters Kluwer NV	4.823.766	4,66				
	Summe Niederlande	20.774.389	20,07				
SCHWEDEN							
104.477	Atlas Copco AB - A	2.955.252	2,85				
	Summe Schweden	2.955.252	2,85				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert GBP	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert GBP	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere			
Aktien				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			
JERSEY - KANALINSELN				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
299.566	Breedon Group plc	195.617	2,00	900.000	United Kingdom Treasury Bill 0.00% 11/11/2019	899.354	9,17
	Summe Jersey - Kanalinseln	195.617	2,00	900.000	United Kingdom Treasury Bill 0.00% 18/11/2019	899.130	9,17
VEREINIGTES KÖNIGREICH				Summe Vereinigtes Königreich			
34.441	Ascential plc	130.531	1,33			1.798.484	18,34
3.000	Associated British Foods plc	69.090	0,70	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			
2.714	Berkeley Group Holdings plc	113.418	1,16	1.798.484			
7.102	British American Tobacco plc	213.593	2,18	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt			
84.253	BT Group plc	150.459	1,53			1.798.484	18,34
9.316	Compass Group	194.984	1,99	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
9.913	Derwent London plc	334.068	3,41	Fonds			
7.274	Diageo plc	242.442	2,47	IRLAND			
32.612	DS Smith plc	117.534	1,20	755.695	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	755.695	7,71
11.538	Glaxosmithkline plc	201.292	2,05			Summe Irland	7,71
14.316	Informa plc	121.972	1,25	Summe Fonds			
10.325	Intermediate Capital Group plc	150.229	1,53			755.695	7,71
89.850	ITV plc	113.121	1,15	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
3.618	Johnson Matthey plc	110.602	1,13			755.695	7,71
81.634	Legal & General Group plc	202.779	2,07	Wert der Anlagen insgesamt			
4.496	London Stock Exchange Group plc	328.567	3,35			8.310.855	84,77
5.495	Persimmon plc	119.242	1,21	(Gesamtkosten: GBP 7.743.868)			
12.293	Prudential plc	181.322	1,85				
1.836	Reckitt Benckiser Group plc	116.476	1,19				
15.816	RELX plc	305.644	3,12				
73.754	Restaurant Group plc	104.878	1,07				
5.491	Rio Tinto plc	231.116	2,36				
13.225	Royal Dutch Shell plc - B	316.871	3,23				
9.454	Schroders plc	229.260	2,34				
5.287	Smith & Nephew plc	103.572	1,06				
14.865	SSP Group plc	92.163	0,94				
10.033	St James's Place plc	98.263	1,00				
158.693	Tesco plc	382.450	3,90				
4.404	Unilever plc	215.356	2,20				
80.490	Vodafone Group plc	130.394	1,33				
9.777	Weir Group plc	139.371	1,42				
	Summe Vereinigtes Königreich	5.561.059	56,72				
	Summe Aktien	5.756.676	58,72				
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	5.756.676	58,72				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Aktien				Fonds			
NIEDERLANDE				IRLAND			
27.897	NXP Semiconductor NV	3.044.121	2,72	5.091.146	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	5.091.146	4,55
	Summe Niederlande	3.044.121	2,72		Summe Irland	5.091.146	4,55
VEREINIGTE STAATEN				Summe Fonds			
13.858	Alexion Pharmaceuticals Inc.	1.357.253	1,21	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
8.123	Alphabet Inc. - A	9.919.320	8,87	5.091.146			
2.760	Amazon.com Inc.	4.791.112	4,29	Wert der Anlagen insgesamt			
15.698	Analog Devices Inc.	1.753.938	1,57	110.280.479			
5.205	Apple Inc.	1.165.764	1,04	(Gesamtkosten: USD 102.918.437)			
130.972	Bank of America Corp.	3.820.453	3,42				
42.235	Berkshire Hathaway Inc.	8.785.725	7,86				
5.312	Biogen Idec Inc.	1.236.740	1,11				
38.466	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	2.592.607	2,31				
1.974	Booking Holdings Inc.	3.874.192	3,46				
235.533	Centennial Resource Development - A	1.063.432	0,95				
2.409	Curtiss-Wright Corp.	311.652	0,28				
12.839	Edwards Lifesciences Corp.	2.823.424	2,52				
24.526	Facebook Inc. - A	4.367.590	3,91				
1.471	Illumina Inc.	447.508	0,40				
53.141	JPMorgan Chase & Company	6.254.165	5,60				
6.412	L3Harris Technologies Inc.	1.337.800	1,19				
22.228	Lam Research Corp.	5.137.112	4,60				
20.636	Mastercard Inc. - A	5.604.119	5,01				
56.204	Microsoft Corp.	7.814.042	7,00				
21.237	Moderna Inc.	338.093	0,30				
30.554	Mondelez International Inc.	1.690.247	1,51				
20.016	Norfolk Southern Corp.	3.596.075	3,22				
78.433	Nutanix Inc. - A	2.058.866	1,84				
34.267	Phillips 66	3.508.940	3,13				
112.421	Uber Technologies Inc.	3.425.468	3,06				
11.848	UnitedHealth Group Inc.	2.574.807	2,30				
6.111	Vertex Pharmaceuticals Inc.	1.035.326	0,93				
31.739	Visa Inc. - A	5.459.425	4,88				
3.833	VMware Inc. - A	575.180	0,51				
11.812	Walt Disney Company	1.539.340	1,38				
178.045	WPX Energy Inc.	1.885.497	1,69				
	Summe Vereinigte Staaten	102.145.212	91,35				
	Summe Aktien	105.189.333	94,07				
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	105.189.333	94,07				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BERMUDAS				INDONESIEN			
43.688	IHS Markit Limited	2.921.854	1,63	8.531.100	Bank Rakyat Indonesia	2.476.186	1,38
	Summe Bermudas	2.921.854	1,63		Summe Indonesien	2.476.186	1,38
KANADA				IRLAND			
62.903	Suncor Energy Inc.	1.986.477	1,11	52.070	CRH plc	1.793.261	1,00
	Summe Kanada	1.986.477	1,11	22.477	Ingersoll-Rand plc	2.769.391	1,55
				17.761	Medtronic Inc.	1.929.200	1,08
					Summe Irland	6.491.852	3,63
KAIMANINSELN				JAPAN			
18.584	Alibaba Group Holding Limited	3.107.802	1,74	12.100	Disco Corp.	2.290.686	1,28
85.600	Tencent Holdings Limited	3.605.527	2,02	5.000	Keyence Corp.	3.095.072	1,73
	Summe Kaimaninseln	6.713.329	3,76	3.400	Nintendo Company Limited	1.259.014	0,70
				31.300	Rohm Company Limited	2.389.312	1,34
					Summe Japan	9.034.084	5,05
CHINA				JERSEY - KANALINSELN			
52.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	597.317	0,33	19.124	Ferguson plc	1.400.793	0,78
	Summe China	597.317	0,33		Summe Jersey - Kanalinseln	1.400.793	0,78
DÄNEMARK				NIEDERLANDE			
50.843	Novo-Nordisk A/S	2.614.323	1,46	14.639	Lyondellbasell Industries NV - A	1.309.751	0,73
	Summe Dänemark	2.614.323	1,46	16.784	NXP Semiconductor NV	1.831.470	1,02
				118.539	RELX plc	2.821.118	1,58
					Summe Niederlande	5.962.339	3,33
FINNLAND				SÜDKOREA			
44.850	Upm-Kymmene Oyj	1.326.045	0,74	91.097	Samsung Electronics Company Limited	3.735.595	2,09
	Summe Finnland	1.326.045	0,74		Summe Südkorea	3.735.595	2,09
FRANKREICH				SCHWEIZ			
13.113	EssilorLuxottica SA	1.890.619	1,06	11.376	TE Connectivity Limited	1.060.016	0,59
10.134	Pernod-Ricard SA	1.805.257	1,01		Summe Schweiz	1.060.016	0,59
	Summe Frankreich	3.695.876	2,07				
DEUTSCHLAND				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
11.800	Adidas AG	3.674.704	2,05	14.014	Aon plc	2.712.690	1,52
	Summe Deutschland	3.674.704	2,05	22.720	Reckitt Benckiser Group plc	1.776.184	0,99
				38.253	Unilever plc	2.305.106	1,29
					Summe Vereinigtes Königreich	6.793.980	3,80
HONGKONG							
124.200	Aia Group Limited	1.173.180	0,66				
	Summe Hongkong	1.173.180	0,66				
INDIEN							
362.503	HDFC Bank Limited	6.278.750	3,52				
39.803	Matrimony.com Limited	334.497	0,19				
	Summe Indien	6.613.247	3,71				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Aktien (Fortsetzung)				Fonds			
VEREINIGTE STAATEN				IRLAND			
58.436	Activision Blizzard Inc.	3.092.433	1,73	11.171.292	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	11.171.292	6,25
4.251	Adobe Inc.	1.174.339	0,66		Summe Irland	11.171.292	6,25
4.167	Alphabet Inc. - A	5.088.490	2,84		Summe Fonds	11.171.292	6,25
3.597	Amazon.com Inc.	6.244.069	3,49		Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	11.171.292	6,25
20.989	Amphenol Corp.	2.025.438	1,14		Wert der Anlagen insgesamt	168.975.072	94,48
22.779	Baxter International Inc.	1.992.479	1,11		(Gesamtkosten: USD 156.831.302)		
3.323	Becton Dickinson & Company	840.586	0,47				
20.146	Berkshire Hathaway Inc.	4.190.771	2,34				
50.072	Centene Corp.	2.166.114	1,22				
34.541	Charles Schwab Corp.	1.444.850	0,81				
2.250	Charter Communications Inc. - A	927.270	0,52				
9.288	CME Group Inc.	1.962.926	1,10				
76.985	Comcast Corp.	3.470.484	1,94				
5.364	Cooper Companies Inc.	1.593.108	0,89				
47.829	Diamondback Energy Inc.	4.300.305	2,40				
11.412	Ecolab Inc.	2.260.033	1,27				
19.839	Electronic Arts Inc.	1.940.651	1,09				
32.181	Eog Resources Inc.	2.388.474	1,34				
3.235	Equinix Inc.	1.865.948	1,04				
13.622	Estee Lauder Companies Inc.	2.710.097	1,52				
131	Facebook Inc. - A	23.328	0,01				
15.070	Fidelity National Information Services Inc.	2.000.693	1,12				
49.055	Gilead Sciences Inc.	3.109.106	1,73				
42.577	Halliburton Company	802.576	0,45				
6.968	Illumina Inc.	2.119.805	1,19				
4.286	JPMorgan Chase & Company	504.419	0,28				
8.382	Lam Research Corp.	1.937.164	1,08				
10.995	Mastercard Inc. - A	2.985.912	1,67				
3.628	Microsoft Corp.	504.401	0,28				
19.011	Nvidia Corp.	3.309.245	1,85				
7.091	S&P Global Inc.	1.737.153	0,97				
48.039	Service Corp. International	2.296.745	1,28				
10.173	Transunion	825.132	0,46				
30.618	Trex Company Inc.	2.784.094	1,56				
3.982	Tyler Technologies Inc.	1.045.275	0,58				
33.592	Union Pacific Corp.	5.441.232	3,04				
6.030	UnitedHealth Group Inc.	1.310.440	0,73				
3.901	Vertex Pharmaceuticals Inc.	660.907	0,37				
25.906	Visa Inc. - A	4.456.091	2,49				
	Summe Vereinigte Staaten	89.532.583	50,06				
	Summe Aktien	157.803.780	88,23				
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	157.803.780	88,23				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			
VEREINIGTE STAATEN			
USD 500.000	United States Treasury Bill 0.00% 26/03/2020	495.537	0,13
	Summe Vereinigte Staaten	495.537	0,13
	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	495.537	0,13
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	495.537	0,13

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

Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente

VEREINIGTE STAATEN			
USD 110.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 07/11/2019	110.302.173	28,46
USD 106.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 05/12/2019	106.152.341	27,39
USD 82.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 30/01/2020	81.997.270	21,15
USD 67.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 27/02/2020	66.992.056	17,28
USD 500.000	United States Treasury Bill 0.00% 23/04/2020	494.839	0,13
USD 500.000	United States Treasury Bill 0.00% 21/05/2020	494.134	0,13
	Summe Vereinigte Staaten	366.432.813	94,54
	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	366.432.813	94,54
	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt	366.432.813	94,54
	Wert der Anlagen insgesamt	366.928.350	94,67

(Gesamtkosten: USD 365.015.663)

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2019

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				JERSEY - KANALINSELN			
1.631	CSL Limited	257.066	1,97	1.258	Aptiv plc	109.974	0,84
	Summe Australien	257.066	1,97	3.528	Ferguson plc	258.419	1,98
KANADA				Summe Jersey - Kanalinseln			
9.523	Suncor Energy Inc.	300.580	2,31			368.393	2,82
	Summe Kanada	300.580	2,31	NIEDERLANDE			
DÄNEMARK				1.173	ASML Holding NV	290.609	2,23
5.939	Novo-Nordisk A/S	305.382	2,35	1.956	NXP Semiconductor NV	213.439	1,64
1.128	Orsted A/S	104.852	0,80	Summe Niederlande			
	Summe Dänemark	410.234	3,15			504.048	3,87
FRANKREICH				SPANIEN			
1.528	EssilorLuxottica SA	220.305	1,69	6.503	Industria de Diseno Textil SA	201.344	1,54
730	L'Oreal SA	204.453	1,57	Summe Spanien			
	Summe Frankreich	424.758	3,26			201.344	1,54
DEUTSCHLAND				SCHWEDEN			
985	Adidas AG	306.744	2,35	3.623	Atlas Copco AB - A	111.725	0,85
1.995	BASF SE	139.458	1,07	5.978	Epiroc AB - A	64.874	0,50
	Summe Deutschland	446.202	3,42	Summe Schweden			
IRLAND						176.599	1,35
1.956	Ingersoll-Rand plc	240.999	1,85	SCHWEIZ			
813	Ryanair Holdings plc	53.967	0,41	1.131	Nestle SA - Reg	122.815	0,94
	Summe Irland	294.966	2,26	3.055	Novartis AG - Reg	265.135	2,03
JAPAN				1.040	Roche Holding AG	302.931	2,33
4.800	Bridgestone Corp.	185.827	1,43	660	Sika AG	96.635	0,74
10.600	Capcom Company Limited	280.803	2,15	1.970	TE Connectivity Limited	183.565	1,41
2.400	Hoya Corp.	195.841	1,50	Summe Schweiz			
200	Keyence Corp.	123.803	0,95			971.081	7,45
3.300	Koito Manufacturing Company Limited	161.221	1,24	VEREINIGTES KÖNIGREICH			
4.500	Murata Manufacturing Company Limited	215.891	1,66	2.769	Rio Tinto plc	143.621	1,10
1.500	Nidec Corp.	201.527	1,55	3.218	Unilever plc	193.915	1,49
700	Nintendo Company Limited	259.209	1,99	Summe Vereinigtes Königreich			
3.600	Pigeon Corp.	148.397	1,14			337.536	2,59
1.900	Rohm Company Limited	145.038	1,11	VEREINIGTE STAATEN			
8.600	Terumo Corp.	276.919	2,12	1.068	3M Company	175.579	1,35
900	Tokyo Electron Limited	171.256	1,31	3.524	Activision Blizzard Inc.	186.490	1,43
4.800	Yaskawa Electric Corp.	176.100	1,35	857	Adobe Inc.	236.746	1,82
	Summe Japan	2.541.832	19,50	106	Alphabet Inc. - A	129.441	0,99
				4.276	Applied Materials Inc.	213.372	1,64
				2.314	Baxter International Inc.	202.406	1,55
				4.005	Boston Scientific Corp.	162.963	1,25
				5.658	Bristol-Myers Squibb Company	286.917	2,20
				617	Cooper Companies Inc.	183.249	1,41
				2.093	Eog Resources Inc.	155.342	1,19
				1.048	Estee Lauder Companies Inc.	208.499	1,60
				743	Facebook Inc. - A	132.313	1,02

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
2.976	Gilead Sciences Inc.	188.619	1,45
5.818	Halliburton Company	109.669	0,84
778	Illumina Inc.	236.683	1,82
6.588	Microsoft Corp.	915.929	7,03
1.010	Mohawk Industries Inc.	125.311	0,96
1.183	PepsiCo Inc.	162.189	1,24
4.437	Pfizer Inc.	159.421	1,22
1.972	PTC Inc.	134.451	1,03
1.126	Salesforce.com Inc.	167.143	1,28
614	Stryker Corp.	132.808	1,02
354	Thermo Fisher Scientific Inc.	103.110	0,79
5.846	TJX Companies Inc.	325.856	2,50
1.808	Union Pacific Corp.	292.860	2,25
2.277	Valero Energy Corp.	194.091	1,49
	Summe Vereinigte Staaten	5.521.457	42,37
	Summe Aktien	12.756.096	97,86
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung	12.756.096	97,86
	Wert der Anlagen insgesamt	12.756.096	97,86
(Gesamtkosten: USD 11.748.882)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

1 ALLGEMEINES

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

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

Wesentliche Ereignisse während des Berichtszeitraums:

Neuer Prospekt

Im Juni 2019 wurde ein neuer Verkaufsprospekt veröffentlicht.

Nettoinventarwert (NIW)

Mit Wirkung zum 1. Juli 2019 wurde der NIW mit vier Dezimalstellen (bisher zwei) angegeben.

Auflegung und Schließung von Portfolios

Das Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond Portfolio wurde am 18. Juli 2019 aufgelegt.

Mit Wirkung zum 8. Mai 2019 wurde für das Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond Portfolio ein Liquidationsverfahren eingeleitet.

Mit Wirkung zum 27. Mai 2019 wurde für das Threadneedle (Lux) - Asian Focus Portfolio ein Liquidationsverfahren eingeleitet.

Änderung der Bezeichnung der Anteilklasse

Mit Wirkung zum 31. Juli 2019 wurde der Name der Anteilklasse 9GP des Threadneedle (Lux) - UK Equity Income Portfolios in 9G geändert.

Auflegung und Schließung von Anteilklassen

Im Berichtszeitraum zum 30. September 2019 wurden folgende Anteilklassen aufgelegt:

Anteilklasse	Portfolio	Auflegungsdatum
XGH	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	17. Mai 2019
4G	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	4. April 2019
XE	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	18. Juli 2019
AE	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18. Juli 2019
AEP	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18. Juli 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18. Juli 2019
ANH	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18. Juli 2019
IE	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18. Juli 2019
IEP	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18. Juli 2019
IGC	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18. Juli 2019
IGH	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18. Juli 2019
XE	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18. Juli 2019
XGH	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18. Juli 2019
ZE	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	18. Juli 2019
IKH	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	13. August 2019
ZEP	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	25. April 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	13. August 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	27. Juni 2019
ANH	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	27. Juni 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	27. Juni 2019
ANH	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	27. Juni 2019
IU	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	22. Mai 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	27. Juni 2019
ANH	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	27. Juni 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	13. August 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	13. August 2019
IEH	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	26. Juni 2019
AUM	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	6. September 2019
IU	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	22. Mai 2019
NE	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	3. Juli 2019
AD	Threadneedle (Lux) - American Select	27. Juni 2019
AN	Threadneedle (Lux) - American Select	27. Juni 2019
ID	Threadneedle (Lux) - American Select	27. Juni 2019
IE	Threadneedle (Lux) - American Select	26. Juni 2019
IN	Threadneedle (Lux) - American Select	27. Juni 2019

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

1 ALLGEMEINES

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Portfolio	Auflegungsdatum
IE	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	26. Juni 2019
XU	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	17. Mai 2019
IE	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	26. Juni 2019
IG	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	8. Mai 2019
IE	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	26. Juni 2019
IE	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	26. Juni 2019
XU	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	17. Mai 2019
9G	Threadneedle (Lux) - UK Equities	25. April 2019
9G (vormals 9GP)	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	25. April 2019
AKH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	27. Juni 2019
ANH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	27. Juni 2019
IU	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	22. Mai 2019

Im Berichtszeitraum zum 30. September 2019 wurden folgende Anteilklassen inaktiv:

Anteilklasse	Portfolio	Auflegungsdatum
3EP	Threadneedle (Lux) - UK Equities	13. August 2019

Zum 30. September 2019 lauteten die aktiven Portfolios der SICAV wie folgt:

Die Anleiheportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) - European Social Bond
- Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond¹
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds¹
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt¹
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds¹
- Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond¹
- Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Die Vermögensallokationsportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return¹
- Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income¹

Die Aktienportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Global Focus¹
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities¹
- Threadneedle (Lux) - Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) - Global Select
- Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - American¹
- Threadneedle (Lux) - American Select¹
- Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity¹
- Threadneedle (Lux) - Asia Equities
- Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income¹
- Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
- Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Equities¹
- Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend
- Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities¹
- Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - European Select
- Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income¹
- Threadneedle (Lux) - Global Technology¹
- Threadneedle (Lux) - UK Equities
- Threadneedle (Lux) - UK Equity Income
- Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

1 ALLGEMEINES

(Fortsetzung)

Die Absolute-Return-Portfolios:

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

Die Extended-Alpha-Portfolios:

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

Das Specialist-Portfolio:

- Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities¹

Das Shariah-Portfolio:

- Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity

¹Diese Portfolios wurden zum 30. September 2019 von der Securities and Futures Commission in Hongkong zugelassen und sind in Hongkong für die Öffentlichkeit verfügbar.

2 ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

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

Der Abschluss wird auf der Grundlage der Nettoinventarwerte der Portfolios erstellt, die zum 30. September 2019 berechnet werden. Der letzte offizielle Handelsnettoinventarwert der entsprechenden Portfolios wurde zum 30. September 2019 berechnet.

Der Abschluss wurde in Übereinstimmung mit den in Luxemburg für Investmentfonds geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Vorschriften nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt, außer bei den Portfolios Global Strategic Bond und Asian Focus. Wie in Erläuterung 1 angegeben, wurden diese Portfolios während des Berichtszeitraums zum 30. September 2019 liquidiert. Daher wurde der Abschluss für diese Portfolios nicht nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt.

Rechnungslegung ohne den Grundsatz der Unternehmensfortführung

Bei den Portfolios, für die der Abschluss nicht nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt wurde, weichen die folgenden Rechnungslegungsgrundsätze von den in den Erläuterungen 2 bis 20 beschriebenen Grundsätzen ab:

- Die erwarteten Liquidationskosten werden von der Verwaltungsgesellschaft getragen;
- Eventuell verbleibende Gründungskosten wurden vollständig als Aufwand erfasst;
- Die Bewertung der Anlagen der Portfolios basiert auf ihrem Nettoveräußerungswert.

Die Anwendung der Rechnungslegung ohne den Grundsatz der Unternehmensfortführung hat zu keinen wesentlichen Anpassungen am veröffentlichten Nettoinventarwert der Portfolios geführt.

1) Bewertung der Wertpapiere

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

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

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

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

Die Verwaltungsratsmitglieder der SICAV (die „Verwaltungsratsmitglieder“) können in eigenem Ermessen die Verwendung anderer Bewertungsmethoden genehmigen, wenn sie der Ansicht sind, dass sie den beizulegenden Zeitwert eines Vermögenswerts der SICAV besser wiedergeben.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

2 ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

(Fortsetzung)

II) Devisenterminkontrakte

Zur Absicherung besonderer Währungsrisiken bzw. zur Anlage in anderen Währungen darf die SICAV Devisenterminkontrakte eingehen. Zum Ende des Geschäftsjahres wurden die offenen Devisenterminkontrakte zu den Terminkursen bewertet, die für die Restlaufzeit bis Fälligkeit gültig waren. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus Devisenterminkontrakten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 30. September 2019 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

III) Terminkontrakte

Die SICAV kann Devisenterminkontrakte eingehen. Offene Terminkontrakte werden zu den Kursen an der Börse bewertet, an denen die Kontrakte gehandelt werden. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus Terminkontrakten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 30. September 2019 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 11 aufgeführt.

IV) Swap-Geschäfte

Die SICAV darf Aktienswaps, Zinsswaps („IRS“), Kreditausfallswaps („CDS“) und Total Return Swaps („TRS“) abschließen. Zinsswaps (IRS) werden auf Basis ihres Marktwerts bewertet, der sich aus der gültigen Zinskurve ergibt. Kreditausfallswaps werden unter Bezug auf den aktuellen Nettowert des erwarteten zukünftigen Cashflows basierend auf den marktüblichen Zinssätzen und der an dem Markt zu erwartenden Ausfall- und Rückgewinnungsrate der zugrunde liegenden Vermögenswerte bewertet. Eine gegebenenfalls von der SICAV geleistete Vorauszahlung wird in der Aufstellung des Nettovermögens als Vermögenswert ausgewiesen. Eine gegebenenfalls von der SICAV erhaltene Vorauszahlung wird in der Aufstellung des Nettovermögens als Verbindlichkeit ausgewiesen. TRS werden anhand ihres Marktwerts bewertet, der auf dem Marktwert des Basiswerts basiert. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus Swap-Geschäften ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 30. September 2019 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 10 aufgeführt. Die ggf. auf Swap-Short-Positionen zahlbaren Dividenden werden in der Aufstellung des Nettovermögens als Verbindlichkeit ausgewiesen.

V) Optionsgeschäfte

An einem geregelten Markt gehandelte Optionen werden zum Marktpreis am Tag der Bewertung bewertet. Solche zum 30. September 2019 offenen Optionen sind dem Anlageverzeichnis zu entnehmen. Over the Counter („OTC“)-Optionen werden zu Preisen bewertet, die von externen Preisagenturen/Modellen bereitgestellt werden. Solche zum 30. September 2019 offenen Optionen sind in Erläuterung 12 aufgeführt. Zum Zeitpunkt der Berichterstellung durch die Bewertung von Optionsgeschäften entstandene nicht realisierte Gewinne oder Verluste werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen.

VI) Währungsumrechnung

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

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

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

Die konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens sowie die konsolidierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und die Entwicklung des Nettovermögens werden in USD vorgelegt. Sie beruhen auf den Wechselkursen, die am Datum der Aufstellung des Nettovermögens gültig waren. Wechselkurse zum 30. September 2019: 1 USD = 1,482690 AUD, 1 USD = 0,917263 EUR, 1 USD = 0,811491 GBP, 1 USD = 0,997150 CHF, 1 USD = 9,832165 SEK, 1 USD = 6,848565 DKK, 1 USD = 9,085953 NOK und 1 USD = 1,382900 SGD.

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

VII) Bankguthaben

Das in der Aufstellung des Nettovermögens angegebene Bankguthaben beinhaltet auch die Margen auf Futures und von Maklern zahlbare Barsicherheiten für Swapgeschäfte und Devisenterminkontrakte.

Bankguthaben und Margen auf Futures werden zu Anschaffungskosten bewertet, was in etwa dem Marktwert entspricht.

VIII) Termineinlagen

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

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

2 ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

(Fortsetzung)

IX) Anlagetransaktionen und Anlageertrag

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

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

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

X) Ausschüttungspolitik

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

XI) Vermögensverwaltungsgebühr

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

3 BESTEUERUNG

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

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

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

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

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

4 SONSTIGE GEBÜHREN

Die sonstigen Gebühren umfassen hauptsächlich Devisengebühren, italienische Steuern, Verwässerungsanpassungen und Quellensteuern auf Erträge aus Derivaten. Die sonstigen Gebühren beim Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity Portfolio umfassen die unreinen Erträge, die gespendet werden müssen.

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

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

Für den Berichtszeitraum zum 30. September 2019 ging die SICAV keine Transaktionen mit verbundenen Personen ein.

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

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Weder die Verwaltungsgesellschaft noch TAML haben Provisionen für Brokertransaktionen erhalten.

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

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

Wie in Erläuterung 8 beschrieben, kann die Verwaltungsgesellschaft auch Performance-Gebühren für alle A-, D-, I- und Z-Anteile des Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolios, für alle J- und Y-Anteile des Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Portfolios, für alle A-, D-, I-, L- und Z-Anteile des Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolios, für alle A-, D-, I-, Z-, 2- und 9-Anteile des Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha, für alle A-, D-, I-, Z-, 2- und 9-Anteile des Threadneedle (Lux) – American Extended Alpha und für alle A-, D-, I-, Z- und 2-Anteile des Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha erhalten.

Sämtliche durch den Betrieb der SICAV entstandenen und nachstehend definierten Kosten (nachstehend die „Betriebskosten“, „Anlageverwaltungsgebühr“ oder „Portfoliogeühren“, zusammen die „Aufwendungen“) werden zu den in den Tabellen ab Seite 212 aufgeführten Sätzen festgelegt. Alle Aufwendungen fallen auf der Grundlage des Nettoinventarwerts der entsprechenden Anteilklasse im entsprechenden Portfolio täglich an.

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

Darüber hinaus hat die Verwaltungsgesellschaft Anspruch auf eine Anlageverwaltungsgebühr (die „Anlageverwaltungsgebühr“), die in den Tabellen ab Seite 212 näher beschrieben wird und die täglich anfällt und monatlich zahlbar ist. Für die X-Anteile wird keine Anlageverwaltungsgebühr fällig. Zur Klarstellung: Die Betriebskosten umfassen weder Anlageverwaltungsgebühren noch Performance-Gebühren, die hiervon unabhängig sind und gesondert erhoben werden.

Die SICAV kann B-Anteile in bestimmten Portfolios anbieten. Bei B-Anteilen fällt kein Ausgabeaufschlag an, jedoch wird eine fortlaufende Vertriebsgebühr von 1,00 % des gesamten Nettoinventarwerts der Klasse pro Jahr erhoben.

B-Anteile des Threadneedle (Lux) - Global Technology sind eine veraltete Anteilklasse, die nur von bestehenden Anteilinhabern gezeichnet werden können.

A-ANTEILE:

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

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

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond*	0,90 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,60 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,90 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	0,75 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,90 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,30 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,25 %	0,30 %	USD
Vermögensallokationsportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	1,25 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	1,25 %	0,30 %	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus*	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,55 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,50 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	1,65 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	1,50 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50 %	0,30 %	GBP
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,90 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	1,50 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	1,50 %	0,30 %	GBP
Extended-Alpha-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
Specialist-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,75 %	0,30 %	USD
Shariah-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	1,50 %	0,35 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

B-ANTEILE:

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

Portfolio- Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Aktienportfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00 %	0,35 %	USD

D-ANTEILE:

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

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

Portfolio- Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond*	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	1,35 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	1,45 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,45 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,45 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,45 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,45 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,45 %	0,30 %	USD
Vermögensallokationsportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	2,00 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset income	2,00 %	0,30 %	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	2,00 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,85 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus*	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	2,00 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,85 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,85 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	2,40 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	2,00 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	2,25 %	0,30 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Aktienportfolios				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	2,25 %	0,35 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	2,25 %	0,30 %	GBP
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	1,45 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	2,00 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	2,00 %	0,30 %	GBP
Extended-Alpha-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
Specialist-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	2,25 %	0,30 %	USD

I-ANTEILE:

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,50 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,65 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	0,40 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,40 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,65 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,65 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,65 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,60 %	0,20 %	USD
Vermögensallokationsportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,65 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	0,75 %	0,20 %	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,70 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,80 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus*	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	0,75 %	0,20 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Aktienportfolios (Fortsetzung)				
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,80 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,25 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,85 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,65 %	0,20 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,65 %	0,20 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	1,25 %	0,35 %	USD
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	0,75 %	0,20 %	GBP
Extended-Alpha-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,15 %	USD
Specialist-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,80 %	0,20 %	USD

J-ANTEILE:

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

Eine Performance-Gebühr wird auch für J-Anteile erhoben, wie im Abschnitt „Performance-Gebühr“ im Hauptteil des Prospekts beschrieben.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Absolute-Return-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,25 %	0,20 %	EUR

L-ANTEILE:

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

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Rentenportfolio				
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,10 %	EUR

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Vermögensallokationsportfolio				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,50 %	0,20 %	EUR
Aktienportfolio				
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,50 %	0,20 %	GBP
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,20 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,375 %	0,20 %	EUR

N-ANTEILE:

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

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,30 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,10 %	EUR
Aktienportfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,55 %	0,20 %	USD
Specialist-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,45 %	0,20 %	USD

S-ANTEILE:

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

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Rentenportfolio				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,50 %	0,30 %	USD

T-ANTEILE:

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

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Rentenportfolio				
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55 %	0,10 %	USD
Aktienportfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,90 %	0,19 %	USD

W-ANTEILE:

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

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond*	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,85 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,00 %	0,30 %	USD
Vermögensallokationsportfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,40 %	0,35 %	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,40 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,15 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,40 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,40 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,55 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,65 %	0,35 %	USD

X-ANTEILE

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios			
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,15 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Betriebskosten	Basiswährung
Aktienportfolios			
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus*	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,15 %	USD
Absolute-Return-Portfolios			
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,15 %	EUR
Specialist-Portfolio			
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,15 %	USD
Shariah-Portfolio			
	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	0,25 %	USD

Y-ANTEILE:

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

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Absolute-Return-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35 %	0,25 %	EUR

Z-ANTEILE

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

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,40 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	0,40 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,40 %	0,15 %	EUR

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,60 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,60 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,60 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,60 %	0,30 %	USD
Vermögensallokationsportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	0,75 %	0,30 %	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,75 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus*	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,30 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	1,25 %	0,35 %	USD
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,55 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,45 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	0,75 %	0,30 %	GBP
Extended-Alpha-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
Specialist-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,75 %	0,30 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

1-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	5,00 %	k. A.

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

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

2-ANTEILE:

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75 %	0,07 %	EUR
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00 %	0,06 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00 %	0,06 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Aktienportfolios				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00 %	0,09 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,00 %	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00 %	0,09 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00 %	0,06 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	EUR
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50 %	0,06 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	1,00 %	0,07 %	GBP
Extended-Alpha-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,08 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,08 %	USD

3-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	maximal 3,00 %	k. A.

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,19 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60 %	0,17 %	EUR
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75 %	0,13 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,12 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,75 %	0,19 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,16 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,13 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,18 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,12 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,13 %	GBP
Absolute-Return-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	0,75 %	0,18 %	GBP
Extended-Alpha-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,19 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

4-ANTEILE:

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Betriebskosten	Basiswährung
Rentenportfolio			
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,07 %	EUR
Aktienportfolios			
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,09 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,07 %	EUR
Absolute-Return-Portfolio			
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,06 %	EUR

8-ANTEILE:

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,12 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75 %	0,11 %	EUR
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00 %	0,14 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00 %	0,13 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,00 %	0,12 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00 %	0,13 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	EUR
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	1,00 %	0,11 %	GBP
Extended-Alpha-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,12 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,12 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

9-ANTEILE:

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

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

*Siehe Erläuterung 1.

6 PROVISIONSTEILUNGSVEREINBARUNGEN

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

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

Nur die Unterberater Columbia Management Investment Advisors, LLC und STANLIB Asset Management Limited dürfen Vereinbarungen über die Aufteilung von Provisionen abschließen.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

Die SICAV hat im Berichtszeitraum zum 30. September 2019 die folgenden Dividenden erklärt:

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamt-betrag
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond*	Klasse DEC	24.04.2019	USD	0,021	68
					USD 68
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Klasse AEC	24.06.2019	USD	0,069	2.098
	Klasse AEC	24.09.2019	USD	0,092	7.789
	Klasse AUP	24.06.2019	USD	0,092	23
	Klasse AUP	24.09.2019	USD	0,091	665
	Klasse DEC	24.06.2019	USD	0,085	8
	Klasse DEC	24.09.2019	USD	0,084	8
	Klasse DUP	24.06.2019	USD	0,082	8
	Klasse DUP	24.09.2019	USD	0,081	8
	Klasse IEC	24.06.2019	USD	0,091	9
	Klasse IEC	24.09.2019	USD	0,088	9
	Klasse IEP	24.06.2019	USD	0,098	10
	Klasse IEP	24.09.2019	USD	0,096	10
	Klasse IGC	24.06.2019	USD	0,105	11
	Klasse IGC	24.09.2019	USD	0,098	10
	Klasse IUP	24.06.2019	USD	0,083	8
	Klasse IUP	24.09.2019	USD	0,083	8
	Klasse NEC	24.06.2019	USD	0,091	9
	Klasse NEC	24.09.2019	USD	0,088	9
	Klasse NGC	24.06.2019	USD	0,103	98.518
	Klasse NGC	24.09.2019	USD	0,088	111.557
Klasse NUP	24.06.2019	USD	0,083	8	
Klasse NUP	24.09.2019	USD	0,083	8	
					USD 220.791
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Klasse 1UT	24.04.2019	EUR	0,035	15.560
	Klasse 1UT	23.05.2019	EUR	0,031	14.030
	Klasse 1UT	24.06.2019	EUR	0,033	14.614
	Klasse 1UT	25.07.2019	EUR	0,035	13.667
	Klasse 1UT	23.08.2019	EUR	0,030	11.443
	Klasse 1UT	24.09.2019	EUR	0,033	12.955
					EUR 82.269
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	Klasse IEP	24.06.2019	EUR	0,038	73.070
	Klasse IEP	24.09.2019	EUR	0,037	73.455
	Klasse NEP	24.06.2019	EUR	3,738	112.301
	Klasse NEP	24.09.2019	EUR	3,705	111.715
	Klasse ZEP	24.06.2019	EUR	0,023	2
	Klasse ZEP	24.09.2019	EUR	0,036	1.617
					EUR 372.160
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Klasse AEP	24.04.2019	EUR	0,025	9.395
	Klasse AEP	23.05.2019	EUR	0,025	9.563
	Klasse AEP	24.06.2019	EUR	0,025	9.710
	Klasse AEP	25.07.2019	EUR	0,025	9.536
	Klasse AEP	23.08.2019	EUR	0,025	9.483

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamt-betrag
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond (Fortsetzung)	Klasse AEP	24.09.2019	EUR	0,025	9.299
	Klasse DEP	24.04.2019	EUR	0,019	7.486
	Klasse DEP	23.05.2019	EUR	0,019	7.527
	Klasse DEP	24.06.2019	EUR	0,019	7.709
	Klasse DEP	25.07.2019	EUR	0,019	7.989
	Klasse DEP	23.08.2019	EUR	0,019	8.841
	Klasse DEP	24.09.2019	EUR	0,019	9.134
					EUR 105.672
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	Klasse AEC	24.04.2019	USD	0,065	24.118
	Klasse AEC	23.05.2019	USD	0,065	23.649
	Klasse AEC	24.06.2019	USD	0,066	23.877
	Klasse AEC	25.07.2019	USD	0,065	24.586
	Klasse AEC	23.08.2019	USD	0,064	25.239
	Klasse AEC	24.09.2019	USD	0,062	24.139
	Klasse AUP	24.04.2019	USD	0,036	27.485
	Klasse AUP	23.05.2019	USD	0,036	27.389
	Klasse AUP	24.06.2019	USD	0,036	27.593
	Klasse AUP	25.07.2019	USD	0,036	27.422
	Klasse AUP	23.08.2019	USD	0,036	26.906
	Klasse AUP	24.09.2019	USD	0,035	27.797
	Klasse DEC	24.04.2019	USD	0,047	2.336
	Klasse DEC	23.05.2019	USD	0,047	2.266
	Klasse DEC	24.06.2019	USD	0,048	2.365
	Klasse DEC	25.07.2019	USD	0,047	2.328
	Klasse DEC	23.08.2019	USD	0,047	2.315
	Klasse DEC	24.09.2019	USD	0,044	2.188
	Klasse XUP	24.06.2019	USD	0,158	16
	Klasse XUP	24.09.2019	USD	0,157	16
					USD 324.030
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	Klasse AEC	24.04.2019	USD	0,054	5.748
	Klasse AEC	23.05.2019	USD	0,054	5.810
	Klasse AEC	24.06.2019	USD	0,054	5.865
	Klasse AEC	25.07.2019	USD	0,053	5.494
	Klasse AEC	23.08.2019	USD	0,053	5.536
	Klasse AEC	24.09.2019	USD	0,052	5.158
	Klasse AUP	24.04.2019	USD	0,057	227.813
	Klasse AUP	23.05.2019	USD	0,057	226.178
	Klasse AUP	24.06.2019	USD	0,057	222.544
	Klasse AUP	25.07.2019	USD	0,057	219.754
	Klasse AUP	23.08.2019	USD	0,057	217.752
	Klasse AUP	24.09.2019	USD	0,057	216.044
	Klasse SUP	24.04.2019	USD	0,054	3.928
	Klasse SUP	23.05.2019	USD	0,054	3.928
	Klasse SUP	24.06.2019	USD	0,055	3.991
	Klasse SUP	25.07.2019	USD	0,055	3.740
	Klasse SUP	23.08.2019	USD	0,055	3.440
	Klasse SUP	24.09.2019	USD	0,055	3.394

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamt-betrag
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt (Fortsetzung)	Klasse XUP	24.06.2019	USD	0,168	17
	Klasse XUP	24.09.2019	USD	0,171	17
					USD 1.386.151
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	Klasse AEC	24.04.2019	USD	0,031	35.098
	Klasse AEC	23.05.2019	USD	0,031	35.678
	Klasse AEC	24.06.2019	USD	0,032	36.180
	Klasse AEC	25.07.2019	USD	0,031	35.213
	Klasse AEC	23.08.2019	USD	0,031	34.808
	Klasse AEC	24.09.2019	USD	0,030	32.685
	Klasse ASC	24.04.2019	USD	0,027	1.359
	Klasse ASC	23.05.2019	USD	0,027	1.254
	Klasse ASC	24.06.2019	USD	0,027	1.349
	Klasse ASC	25.07.2019	USD	0,027	1.375
	Klasse ASC	23.08.2019	USD	0,027	1.328
	Klasse ASC	24.09.2019	USD	0,026	1.439
	Klasse AUP	24.04.2019	USD	0,029	152.439
	Klasse AUP	23.05.2019	USD	0,029	161.177
	Klasse AUP	24.06.2019	USD	0,029	130.798
	Klasse AUP	25.07.2019	USD	0,029	129.645
	Klasse AUP	23.08.2019	USD	0,029	130.233
	Klasse AUP	24.09.2019	USD	0,028	123.095
	Klasse XUP	24.04.2019	USD	0,048	5
	Klasse XUP	23.05.2019	USD	0,048	5
	Klasse XUP	24.06.2019	USD	0,049	30.147
	Klasse XUP	25.07.2019	USD	0,049	30.147
	Klasse XUP	23.08.2019	USD	0,049	30.216
	Klasse XUP	24.09.2019	USD	0,048	30.097
					USD 1.165.770
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	Klasse AEC	24.04.2019	USD	0,063	4.096
	Klasse AEC	23.05.2019	USD	0,062	4.149
	Klasse AEC	24.06.2019	USD	0,065	4.287
	Klasse AEC	25.07.2019	USD	0,064	4.455
	Klasse AEC	23.08.2019	USD	0,063	4.430
	Klasse AEC	24.09.2019	USD	0,059	4.125
	Klasse AUP	24.04.2019	USD	0,058	21.250
	Klasse AUP	23.05.2019	USD	0,058	20.919
	Klasse AUP	24.06.2019	USD	0,059	21.191
	Klasse AUP	25.07.2019	USD	0,059	19.498
	Klasse AUP	23.08.2019	USD	0,059	19.127
	Klasse AUP	24.09.2019	USD	0,057	18.280
	Klasse DEC	24.04.2019	USD	0,048	2.538
	Klasse DEC	23.05.2019	USD	0,048	2.526
	Klasse DEC	24.06.2019	USD	0,049	2.343
	Klasse DEC	25.07.2019	USD	0,048	2.306
	Klasse DEC	23.08.2019	USD	0,048	2.293

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamt-betrag
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (Fortsetzung)	Klasse DEC	24.09.2019	USD	0,045	1.691
	Klasse IEC	24.04.2019	USD	0,045	2.025
	Klasse IEC	23.05.2019	USD	0,045	2.142
	Klasse IEC	24.06.2019	USD	0,046	2.181
	Klasse IEC	25.07.2019	USD	0,046	2.146
	Klasse IEC	23.08.2019	USD	0,045	1.785
	Klasse IEC	24.09.2019	USD	0,043	593
	Klasse XUP	24.06.2019	USD	0,156	16
	Klasse XUP	24.09.2019	USD	0,161	16
					USD 170.408
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Klasse ASC	24.04.2019	USD	0,027	235
	Klasse ASC	23.05.2019	USD	0,026	232
	Klasse ASC	24.06.2019	USD	0,027	236
	Klasse ASC	25.07.2019	USD	0,026	235
	Klasse ASC	23.08.2019	USD	0,026	303
	Klasse ASC	24.09.2019	USD	0,025	297
	Klasse AUP	24.04.2019	USD	0,037	257
	Klasse AUP	23.05.2019	USD	0,037	257
	Klasse AUP	24.06.2019	USD	0,038	264
	Klasse AUP	25.07.2019	USD	0,038	215
	Klasse AUP	23.08.2019	USD	0,038	215
	Klasse AUP	24.09.2019	USD	0,036	218
	Klasse AVC	24.04.2019	USD	0,024	2
	Klasse AVC	23.05.2019	USD	0,023	2
	Klasse AVC	24.06.2019	USD	0,024	2
	Klasse AVC	25.07.2019	USD	0,024	2
	Klasse AVC	23.08.2019	USD	0,024	2
	Klasse AVC	24.09.2019	USD	0,023	2
	Klasse ZUP	24.04.2019	USD	0,035	4
	Klasse ZUP	23.05.2019	USD	0,035	4
	Klasse ZUP	24.06.2019	USD	0,036	4
	Klasse ZUP	25.07.2019	USD	0,036	4
	Klasse ZUP	23.08.2019	USD	0,036	4
	Klasse ZUP	24.09.2019	USD	0,034	3
					USD 2.999
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	Klasse AEP	24.09.2019	EUR	0,012	580
	Klasse IEP	24.09.2019	EUR	0,013	628
	Klasse LEP	24.09.2019	EUR	0,013	628
	Klasse ZEP	24.09.2019	EUR	0,012	580
					EUR 2.416
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Klasse AEC	24.04.2019	USD	0,016	2.615
	Klasse AEC	23.05.2019	USD	0,016	2.463
	Klasse AEC	24.06.2019	USD	0,016	2.500
	Klasse AEC	25.07.2019	USD	0,016	2.219
	Klasse AEC	23.08.2019	USD	0,016	2.185
	Klasse AEC	24.09.2019	USD	0,015	2.265

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamt-betrag
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return (Fortsetzung)	Klasse AUP	24.04.2019	USD	0,015	8.173
	Klasse AUP	23.05.2019	USD	0,015	8.129
	Klasse AUP	24.06.2019	USD	0,016	8.483
	Klasse AUP	25.07.2019	USD	0,016	8.266
	Klasse AUP	23.08.2019	USD	0,016	8.115
	Klasse AUP	24.09.2019	USD	0,016	8.031
					USD 63.444
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Klasse AEC	24.06.2019	USD	0,121	1.255.651
	Klasse AEC	24.09.2019	USD	0,140	1.388.353
	Klasse AEP	24.06.2019	USD	0,138	215.616
	Klasse AEP	24.09.2019	USD	0,165	301.759
	Klasse ASC	24.06.2019	USD	0,090	457
	Klasse ASC	24.09.2019	USD	0,105	1.206
	Klasse ASP	24.06.2019	USD	0,089	471
	Klasse ASP	24.09.2019	USD	0,106	560
	Klasse AUP	24.06.2019	USD	0,122	115.178
	Klasse AUP	24.09.2019	USD	0,145	153.216
	Klasse DEC	24.06.2019	USD	0,118	772.504
	Klasse DEC	24.09.2019	USD	0,134	818.166
	Klasse DEP	24.06.2019	USD	0,132	76.647
	Klasse DEP	24.09.2019	USD	0,157	94.883
	Klasse DUP	24.06.2019	USD	0,113	253.033
	Klasse DUP	24.09.2019	USD	0,134	297.835
	Klasse ZEC	24.06.2019	USD	0,132	13
	Klasse ZEC	24.09.2019	USD	0,153	15
	Klasse ZUP	24.06.2019	USD	0,121	12
	Klasse ZUP	24.09.2019	USD	0,144	14
					USD 5.745.589
Threadneedle (Lux) - Global Focus	Klasse AEP	24.09.2019	USD	0,108	19.578
	Klasse AUP	24.09.2019	USD	0,072	370
	Klasse IUP	24.09.2019	USD	0,073	7
	Klasse ZEP	24.09.2019	USD	0,109	217.622
					USD 237.577
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	Klasse 1EP	24.06.2019	USD	0,164	309.832
	Klasse 1EP	24.09.2019	USD	0,111	207.359
	Klasse 1SC	24.06.2019	USD	0,108	78.283
	Klasse 1SC	24.09.2019	USD	0,072	46.582
	Klasse 1ST	24.04.2019	USD	0,041	18.671
	Klasse 1ST	23.05.2019	USD	0,033	14.770
	Klasse 1ST	24.06.2019	USD	0,031	13.470
	Klasse 1ST	25.07.2019	USD	0,021	8.427
	Klasse 1ST	23.08.2019	USD	0,029	11.761
	Klasse 1ST	24.09.2019	USD	0,023	7.513
	Klasse 1UP	24.06.2019	USD	0,148	109.664
	Klasse 1UP	24.09.2019	USD	0,099	69.808
	Klasse 1VT	24.04.2019	USD	0,038	1.165

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamt-betrag
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income (Fortsetzung)	Klasse 1VT	23.05.2019	USD	0,032	962
	Klasse 1VT	24.06.2019	USD	0,033	348
	Klasse 1VT	25.07.2019	USD	0,019	195
	Klasse 1VT	23.08.2019	USD	0,027	279
	Klasse 1VT	24.09.2019	USD	0,019	196
	Klasse 2EP	24.06.2019	USD	0,163	3.843.204
	Klasse 2EP	24.09.2019	USD	0,119	2.521.550
	Klasse 2UP	24.06.2019	USD	0,142	749.673
	Klasse 2UP	24.09.2019	USD	0,097	512.101
	Klasse 3EP	24.06.2019	USD	0,162	2.316.951
	Klasse 3EP	24.09.2019	USD	0,114	1.512.641
	Klasse 3UP	24.06.2019	USD	0,142	5.107
	Klasse 3UP	24.09.2019	USD	0,097	3.489
	Klasse 8EP	24.06.2019	USD	0,162	27
	Klasse 8EP	24.09.2019	USD	0,110	18
	Klasse 8UP	24.06.2019	USD	0,146	10.893
	Klasse 8UP	24.09.2019	USD	0,098	6.988
	Klasse 9EP	24.06.2019	USD	0,162	16
	Klasse 9EP	24.09.2019	USD	0,110	11
	Klasse 9UP	24.06.2019	USD	0,141	14
	Klasse 9UP	24.09.2019	USD	0,096	10
	Klasse AEC	24.06.2019	USD	0,155	16
	Klasse AEC	24.09.2019	USD	0,103	10
	Klasse AUP	24.06.2019	USD	0,140	14
	Klasse AUP	24.09.2019	USD	0,095	10
	Klasse DEC	24.06.2019	USD	0,154	15
	Klasse DEC	24.09.2019	USD	0,103	10
	Klasse DUP	24.06.2019	USD	0,140	14
	Klasse DUP	24.09.2019	USD	0,095	10
					USD 12.382.077
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	Klasse XUP	24.09.2019	USD	0,251	2.429.481
					USD 2.429.481
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	Klasse AEP	24.09.2019	USD	0,405	1.972
	Klasse AFP	24.09.2019	USD	0,365	36
	Klasse ASC	24.04.2019	USD	0,020	23.823
	Klasse ASC	23.05.2019	USD	0,020	22.612
	Klasse ASC	24.06.2019	USD	0,020	22.875
	Klasse ASC	25.07.2019	USD	0,020	22.312
	Klasse ASC	23.08.2019	USD	0,019	21.858
	Klasse ASC	24.09.2019	USD	0,019	18.454
	Klasse ASP	24.04.2019	USD	0,019	2
	Klasse ASP	23.05.2019	USD	0,019	2
	Klasse ASP	24.06.2019	USD	0,020	2
	Klasse ASP	25.07.2019	USD	0,020	2
	Klasse ASP	23.08.2019	USD	0,019	2
	Klasse ASP	24.09.2019	USD	0,019	2

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamt-betrag
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income (Fortsetzung)	Klasse AUP	24.04.2019	USD	0,028	2.839
	Klasse AUP	23.05.2019	USD	0,028	2.840
	Klasse AUP	24.06.2019	USD	0,028	2.840
	Klasse AUP	25.07.2019	USD	0,028	4.171
	Klasse AUP	23.08.2019	USD	0,028	3.664
	Klasse AUP	24.09.2019	USD	0,027	3.348
	Klasse AVC	24.04.2019	USD	0,019	3.121
	Klasse AVC	23.05.2019	USD	0,019	3.079
	Klasse AVC	24.06.2019	USD	0,019	3.107
	Klasse AVC	25.07.2019	USD	0,019	2.829
	Klasse AVC	23.08.2019	USD	0,018	2.705
	Klasse AVC	24.09.2019	USD	0,018	1.758
	Klasse IEP	24.09.2019	USD	0,410	41
	Klasse IFP	24.09.2019	USD	0,370	37
	Klasse IUP	24.09.2019	USD	0,367	37
	Klasse ZEP	24.09.2019	USD	0,410	41
	Klasse ZFP	24.09.2019	USD	0,375	38
	Klasse ZUP	24.09.2019	USD	0,368	37
					USD 170.486
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	Klasse AEC	24.09.2019	USD	0,136	1
	Klasse AUP	24.09.2019	USD	0,130	1.267
					USD 1.268
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	Klasse AUP	24.09.2019	USD	0,119	11.852
	Klasse IEC	24.09.2019	USD	0,125	22
					USD 11.874
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	Klasse 1EP	24.09.2019	EUR	0,034	455.988
	Klasse 1GP	24.09.2019	EUR	0,033	365.664
	Klasse 2EP	24.09.2019	EUR	0,321	1.509
	Klasse 2GP	24.09.2019	EUR	0,364	36
	Klasse 3EP	24.09.2019	EUR	0,051	3.654
	Klasse 3GP	24.09.2019	EUR	0,053	67.983
	Klasse 4GP	24.09.2019	EUR	0,044	137.438
	Klasse 8EP	24.09.2019	EUR	0,034	106.794
	Klasse 8GP	24.09.2019	EUR	0,034	14.315
	Klasse 9EP	24.09.2019	EUR	0,321	32
	Klasse 9GP	24.09.2019	EUR	0,365	37
	Klasse AEP	24.09.2019	EUR	0,319	32
	Klasse AUP	24.09.2019	EUR	0,290	29
	Klasse DEP	24.09.2019	EUR	0,319	32
	Klasse IEP	24.09.2019	EUR	0,321	896
	Klasse ZEP	24.09.2019	EUR	0,321	32
					EUR 1.154.471

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamt-betrag
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	Klasse AUP	24.09.2019	USD	0,338	226
	Klasse DUP	24.09.2019	USD	0,335	120
	Klasse IEP	24.09.2019	USD	0,380	5.745
	Klasse XUP	24.09.2019	USD	0,336	276.697
	Klasse ZGP	24.09.2019	USD	0,392	39
	Klasse ZUP	24.09.2019	USD	0,384	54.083
Threadneedle (Lux) - UK Equities	Klasse 9EP	24.09.2019	GBP	0,200	397.146
	Klasse AGP	24.09.2019	GBP	0,507	243.990
	Klasse IGP	24.09.2019	GBP	0,666	1.285.229
	Klasse ZGP	24.09.2019	GBP	0,252	271.906
					GBP 2.198.271
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	Klasse 9GP*	24.06.2019	GBP	0,107	11
	Klasse AEC	24.06.2019	GBP	0,122	47
	Klasse AEC	24.09.2019	GBP	0,077	54
	Klasse ASC	24.06.2019	GBP	0,082	14
	Klasse ASC	24.09.2019	GBP	0,051	9
	Klasse AUC	24.06.2019	GBP	0,115	15
	Klasse AUC	24.09.2019	GBP	0,072	9
	Klasse DEC	24.06.2019	GBP	0,120	14
	Klasse DEC	24.09.2019	GBP	0,075	9
	Klasse DGP	24.06.2019	GBP	0,148	15
	Klasse DGP	24.09.2019	GBP	0,088	9
	Klasse IGP	24.06.2019	GBP	0,147	205.341
	Klasse IGP	24.09.2019	GBP	0,089	97.918
	Klasse LGP	24.06.2019	GBP	0,147	878.464
	Klasse LGP	24.09.2019	GBP	0,083	563.277
	Klasse ZGP	24.06.2019	GBP	0,136	654
	Klasse ZGP	24.09.2019	GBP	0,093	448
					GBP 1.746.308
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Klasse IEP	24.06.2019	EUR	0,060	6
	Klasse IEP	24.09.2019	EUR	0,056	6
	Klasse LEP	24.06.2019	EUR	0,062	15.911
	Klasse LEP	24.09.2019	EUR	0,057	14.628
					EUR 30.551

*Siehe Erläuterung 1.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

8 PERFORMANCE-gebühren

Die Verwaltungsgesellschaft erhält in Bezug auf die Anteilklassen der in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Portfolios eine Performance-Gebühr. Für die Performance-Gebühr werden tägliche Rückstellungen im Hinblick auf den Saldo der Performance-Gebühr gebildet (wie nachstehend beschrieben), wobei der aufgelaufene Betrag am Ende jedes Kalenderjahres (d. h. am 31. Dezember) an die Verwaltungsgesellschaft ausbezahlt wird. Die Höhe dieser Performance-Gebühr hängt von der Wertentwicklung des Nettoinventarwertes (NIW) der betreffenden Anteilklasse innerhalb des betreffenden Portfolios im Vergleich zu der Wertentwicklung des jeweiligen Performance-Index ab (der „Performance-Index“, wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt). Es laufen nur dann Gebühren auf, wenn der Saldo der Performance-Gebühr positiv ist und die NIW High Water Mark (wie nachstehend definiert) überschritten wird. Zur Klarstellung: Die Wertentwicklung der Anteilklassen wird unter Berücksichtigung gezahlter Ausschüttungen ermittelt.

Portfolio	Anteilklassen	Performance-Index	Performance-Satz
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	A-Anteile	Der höhere Wert des 3-Monats-LIBOR (USD) ¹ oder Null	20 %
	D-Anteile		
	I-Anteile		
	Z-Anteile		
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	J-Anteile	Der höhere Wert des ICE BofAML Euro Currency Deposit Bid Rate Constant Maturity (1M) (Local Total Return) Index ² zuzüglich 1,00 % oder 1,00 %	10 %
	Y-Anteile		
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	A-Anteile	Der höhere Wert des 3-Monats-EURIBOR (EUR) ² oder Null	20 %
	D-Anteile		
	I-Anteile		
	Z-Anteile		
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	A-Anteile	Der höhere Wert des 3-Monats-LIBOR ¹ oder Null	max. 20 %
	D-Anteile		
	I-Anteile		
	Z-Anteile		
	2 Anteile		
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	A-Anteile	Rendite des S&P 500 Index ³	max. 20 %
	D-Anteile		
	I-Anteile		
	Z-Anteile		
	2 Anteile		
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	A-Anteile	Rendite des MSCI All Countries World Index ⁴	max. 20 %
	D-Anteile		
	I-Anteile		
	Z-Anteile		
	2 Anteile		

¹ Der Vergleichsindex wird von ICE Benchmark Administration Limited bereitgestellt, einem Administrator, der im ESMA-Register der Referenzwert-Administratoren eingetragen ist. Die Verwaltungsgesellschaft unterhält einen schriftlichen Plan, in dem die Maßnahmen festgelegt sind, die im Falle einer wesentlichen Änderung oder Einstellung des Vergleichsindex ergriffen werden.

² Aktualisierte Informationen darüber, ob der Vergleichsindex von einem Administrator bereitgestellt wird, der im ESMA-Register der Referenzwert-Administratoren eingetragen ist, werden spätestens am 1. Januar 2020 verfügbar sein. Die Verwaltungsgesellschaft unterhält einen schriftlichen Plan, in dem die Maßnahmen festgelegt sind, die im Falle einer wesentlichen Änderung oder Einstellung des Vergleichsindex ergriffen werden.

³ Der Vergleichsindex wird von S&P Dow Jones bereitgestellt, einem Administrator, der nicht im ESMA-Register der Referenzwert-Administratoren eingetragen ist. Die Verwaltungsgesellschaft unterhält einen schriftlichen Plan, in dem die Maßnahmen festgelegt sind, die im Falle einer wesentlichen Änderung oder Einstellung des Vergleichsindex ergriffen werden.

⁴ Der Vergleichsindex wird von MSCI Limited bereitgestellt, einem Administrator, der im ESMA-Register der Referenzwert-Administratoren eingetragen ist. Die Verwaltungsgesellschaft unterhält einen schriftlichen Plan, in dem die Maßnahmen festgelegt sind, die im Falle einer wesentlichen Änderung oder Einstellung des Vergleichsindex ergriffen werden.

Die Performance des Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, des Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Portfolio, des Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolio, des Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha Portfolio, des Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha und des Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha Portfolio wird unter Berücksichtigung aller anwendbaren Gebühren mit dem Performance-Index verglichen.

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

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

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

8 PERFORMANCE-GEBÜHREN

(Fortsetzung)

Ist der Saldo der Performance-Gebühr am Ende des Kalenderjahres positiv und wurde die NIW High Water Mark überschritten, so wird der aufgelaufene Betrag der Performance-Gebühr innerhalb des ersten Quartals des folgenden Kalenderjahres an die Verwaltungsgesellschaft gezahlt. Eine Performance-Gebühr wird an die Verwaltungsgesellschaft nur in dem Fall gezahlt, dass der Nettoinventarwert der betreffenden Anteilklasse über der NIW High Water Mark liegt.

Ist der Saldo der Performance-Gebühr am Ende des Kalenderjahres negativ und wurde die NIW High Water Mark überschritten, wird der negative Betrag zurückgesetzt. In diesem Fall wäre keine Performance-Gebühr zu zahlen.

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

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

NIW High Water Mark: Bezüglich der einzelnen Anteilklassen entspricht der Nettoinventarwert eines Anteils dieser Anteilklasse dem des letzten Bewertungsstichtags des letzten relevanten Kalenderjahres, in dem eine eventuell aufgelaufene Performance-Gebühr bezahlt oder der negative Saldo der Performance-Gebühr zurückgesetzt wurde. Wurde noch nie eine Performance-Gebühr gezahlt, entspricht die NIW High Water Mark dem Anfangspreis der jeweiligen Anteilklasse.

Zum 30. September 2019 beliefen sich die Performance-Gebühren auf USD 2 für den Threadneedle (Lux) – American Absolute Alpha, EUR 6 für den Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities, EUR 139.663 für den Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha, GBP 9.723 für den Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha und 0271.611 für den Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha.

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

Zum 30. September 2019 hielt die SICAV die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	31.10.2019	USD	114.231	EUR	104.320	Handel	Barclays	213
	31.10.2019	USD	68.477.569	EUR	62.436.095	Handel	Barclays	236.689
	31.10.2019	USD	843.756	EUR	770.000	Handel	Goldman Sachs	2.170
	31.10.2019	USD	3.199	EUR	2.920	Handel	Goldman Sachs	8
	18.10.2019	USD	127.157	GBP	101.934	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.444
	18.10.2019	USD	23.829	GBP	19.078	Absicherung	JP Morgan Chase New York	300
	31.10.2019	USD	30.451.967	GBP	24.662.648	Handel	Barclays	18.676
	18.10.2019	EUR	985	USD	1.087	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	18.10.2019	SEK	18.739	USD	1.950	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	18.10.2019	EUR	428.323	USD	475.326	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.688)
	18.10.2019	EUR	341.908	USD	379.429	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.137)
	18.10.2019	GBP	7.077.479	USD	8.829.154	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(100.734)
	18.10.2019	GBP	12.850.417	USD	16.030.894	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(182.900)
	18.10.2019	EUR	1.040	USD	1.155	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	18.10.2019	GBP	1.055	USD	1.316	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	18.10.2019	EUR	1.044	USD	1.159	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	18.10.2019	GBP	71.058.501	USD	88.645.478	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.011.377)
	18.10.2019	EUR	9.913	USD	11.013	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(190)
	18.10.2019	EUR	8.737	USD	9.706	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(167)
	18.10.2019	EUR	1.786	USD	1.968	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	18.10.2019	EUR	3.004	USD	3.309	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
	18.10.2019	GBP	7.275	USD	9.087	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(115)
	18.10.2019	EUR	1.460	USD	1.603	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	18.10.2019	EUR	6.467	USD	7.085	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
18.10.2019	GBP	128.378	USD	158.468	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(143)	
18.10.2019	EUR	248	USD	272	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)	
18.10.2019	GBP	16.862	USD	20.891	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(96)	

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond (Fortsetzung)								
	31.10.2019	CAD	40.627	USD	30.676	Handel	Barclays	25
	18.10.2019	EUR	3.871	USD	4.243	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	18.10.2019	GBP	1.787	USD	2.201	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	18.10.2019	GBP	186.506	USD	229.765	Absicherung	JP Morgan Chase New York	247
	18.10.2019	EUR	10	USD	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	70.511	USD	77.818	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(835)
	18.10.2019	GBP	501.641	USD	625.517	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.860)
	18.10.2019	SEK	198	USD	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	3.150	USD	3.927	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
	18.10.2019	EUR	4.475	USD	4.939	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(53)
	18.10.2019	EUR	3.641	USD	4.019	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
	18.10.2019	GBP	76.300	USD	95.141	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.043)
	18.10.2019	GBP	139.099	USD	173.449	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.902)
	18.10.2019	EUR	11	USD	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	11	USD	14	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	11	USD	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	769.948	USD	960.081	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10.529)
	18.10.2019	EUR	7.271	USD	8.021	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(82)
	18.10.2019	GBP	3.760	USD	4.706	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(68)
	18.10.2019	GBP	18.352	USD	22.967	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(334)
	18.10.2019	GBP	19.571	USD	24.413	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(277)
	18.10.2019	GBP	397.407	USD	495.765	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.656)
	18.10.2019	GBP	25.086	USD	31.199	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(261)
	18.10.2019	EUR	3.169	USD	3.509	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(49)
	18.10.2019	EUR	2.516	USD	2.786	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(39)
	18.10.2019	GBP	13.694	USD	17.117	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(228)
	18.10.2019	EUR	9.437	USD	10.458	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(155)
	18.10.2019	GBP	13.914	USD	17.390	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(230)
	18.10.2019	EUR	3.672	USD	4.068	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(59)
	18.10.2019	GBP	5.459	USD	6.825	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(93)
	18.10.2019	GBP	12.072	USD	15.094	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(206)
	18.10.2019	EUR	1.912	USD	2.111	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	18.10.2019	EUR	9.440	USD	10.418	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(112)
	18.10.2019	SEK	193	USD	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	181.647	USD	201.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.260)
	18.10.2019	EUR	886.408	USD	983.681	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15.910)
	18.10.2019	SEK	18.355	USD	1.911	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(41)
	18.10.2019	EUR	94.883	USD	105.296	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.703)
	18.10.2019	EUR	984	USD	1.092	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	18.10.2019	EUR	6.656.714	USD	7.387.207	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(119.481)
	18.10.2019	GBP	46.712.124	USD	58.273.373	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(664.855)
	31.10.2019	USD	79.110	AUD	116.907	Handel	Goldman Sachs	168
	31.10.2019	USD	697	AUD	1.030	Handel	Goldman Sachs	2
	31.10.2019	USD	14.714	CAD	19.502	Handel	Barclays	(23)
	31.10.2019	USD	1.434.279	CAD	1.899.298	Handel	Goldman Sachs	(959)
	18.10.2019	USD	5.864	EUR	5.279	Absicherung	JP Morgan Chase New York	101
								USD (1.885.134)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond								
	21.10.2019	EUR	997.585	USD	1.092.270	Handel	JPMorgan	(2.608)
	21.10.2019	EUR	424.378	USD	470.000	Handel	Royal Bank of Scotland	(6.010)
	21.10.2019	EUR	21.040	USD	23.125	Handel	Barclays	(136)
	21.10.2019	EUR	4.282.874	GBP	3.808.304	Handel	Barclays	(18.441)
	21.10.2019	EUR	3.587.131	USD	3.959.951	Handel	Barclays	(39.052)
								EUR (66.247)
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond								
	21.10.2019	EUR	73.766.831	GBP	65.592.995	Handel	Barclays	(317.623)
	21.10.2019	EUR	20.128.753	USD	22.220.787	Handel	Barclays	(219.134)
	21.10.2019	EUR	195.829	GBP	173.735	Handel	Lloyds	(397)
	21.10.2019	EUR	59.133	USD	65.491	Handel	Royal Bank of Scotland	(838)
	18.10.2019	EUR	50.429	CHF	55.500	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(633)
	21.10.2019	EUR	909.839	GBP	804.970	Handel	Lloyds	664
	18.10.2019	EUR	43.086	CHF	46.780	Absicherung	JP Morgan Chase New York	48
	18.10.2019	EUR	282	CHF	306	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	4.116.513	EUR	3.709.446	Absicherung	JP Morgan Chase New York	60.983
	18.10.2019	CHF	88.170	EUR	80.619	Absicherung	JP Morgan Chase New York	500
	18.10.2019	CHF	134.481	EUR	122.964	Absicherung	JP Morgan Chase New York	762
	18.10.2019	CHF	682.909	EUR	624.426	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.871
	18.10.2019	CHF	201.459	EUR	184.206	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.142
	18.10.2019	CHF	126.663	EUR	115.816	Absicherung	JP Morgan Chase New York	718
	18.10.2019	CHF	71.491	EUR	65.368	Absicherung	JP Morgan Chase New York	405
								EUR (469.532)
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*								
	21.10.2019	EUR	905.104	USD	999.092	Handel	Barclays	(9.779)
	21.10.2019	EUR	964.788	GBP	855.890	Handel	Barclays	(1.901)
	21.10.2019	EUR	162.442	USD	179.900	Handel	Citigroup Global Markets	(2.296)
	21.10.2019	EUR	564.041	GBP	500.000	Handel	Barclays	(686)
	21.10.2019	EUR	4.431	USD	4.913	Handel	Citigroup Global Markets	(67)
	21.10.2019	EUR	792.536	GBP	700.000	Handel	Barclays	1.920
	21.10.2019	EUR	4.215.455	GBP	3.748.431	Handel	Barclays	(18.236)
	21.10.2019	EUR	4.714	USD	5.193	Handel	Citigroup Global Markets	(41)
	21.10.2019	EUR	218.549	USD	239.260	Handel	Goldman Sachs	(542)
	21.10.2019	EUR	704.064	GBP	623.930	Handel	Barclays	(636)
	21.10.2019	EUR	173.974	GBP	154.440	Handel	Barclays	(460)
	18.10.2019	GBP	3.557.206	EUR	4.015.145	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.018
	21.10.2019	GBP	9.381	EUR	10.575	Handel	Citigroup Global Markets	20
	18.10.2019	GBP	3.430.390	EUR	3.871.973	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.941
	18.10.2019	GBP	1.009	EUR	1.133	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	18.10.2019	GBP	8.030.605	EUR	9.024.308	Absicherung	JP Morgan Chase New York	46.935
	18.10.2019	GBP	11.836.956	EUR	13.301.657	Absicherung	JP Morgan Chase New York	69.181
	18.10.2019	GBP	2.311.686	EUR	2.609.963	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.281
	18.10.2019	NOK	10.090	EUR	1.017	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	SEK	10.068	EUR	945	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	21.10.2019	USD	2.975	EUR	2.706	Handel	Barclays	17
	21.10.2019	USD	5.830	EUR	5.323	Handel	Barclays	15
								EUR 90.685

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	10.04.2019	GBP	29.000	EUR	32.121	Handel	HSBC	655
	10.04.2019	USD	20.000	EUR	17.690	Handel	Citigroup Global Markets	651
	10.04.2019	GBP	110.680	EUR	121.732	Handel	Citigroup Global Markets	3.359
	10.04.2019	GBP	29.943	EUR	32.842	Handel	HSBC	1.000
	10.04.2019	EUR	148.402	GBP	134.234	Handel	Citigroup Global Markets	(3.311)
	10.04.2019	EUR	20.665	GBP	18.630	Handel	HSBC	(390)
	10.04.2019	EUR	153.383	GBP	138.280	Handel	Citigroup Global Markets	(2.901)
	10.04.2019	EUR	16.214	USD	18.331	Handel	HSBC	(596)
	10.04.2019	EUR	15.846	USD	17.530	Handel	Citigroup Global Markets	(229)
	10.04.2019	EUR	122.547	GBP	112.411	Handel	HSBC	(4.501)
	10.04.2019	EUR	153.552	GBP	140.000	Handel	HSBC	(4.677)
	10.04.2019	EUR	182.966	USD	206.000	Handel	HSBC	(5.942)
	10.04.2019	EUR	542.522	GBP	499.375	Handel	Citigroup Global Markets	(21.876)
	10.04.2019	EUR	125.897	GBP	113.940	Handel	Citigroup Global Markets	(2.879)
	10.04.2019	EUR	401.637	GBP	359.334	Handel	Citigroup Global Markets	(4.484)
	18.10.2019	CHF	3.416	EUR	3.123	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	18.10.2019	CHF	3.418	EUR	3.125	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	10.04.2019	USD	261.580	EUR	233.510	Handel	HSBC	6.364
	18.10.2019	SEK	9.946	EUR	933	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	10.04.2019	EUR	3.891.013	GBP	3.499.999	Handel	Citigroup Global Markets	(64.705)
10.04.2019	EUR	2.386.671	USD	2.705.834	Handel	HSBC	(94.656)	
10.04.2019	EUR	108.297	GBP	97.960	Handel	Citigroup Global Markets	(2.418)	
10.04.2019	EUR	223.937	GBP	202.000	Handel	Citigroup Global Markets	(4.365)	
10.04.2019	EUR	91.512	USD	99.980	Handel	HSBC	(171)	
								EUR (206.039)
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	18.10.2019	EUR	21.065.890	GBP	18.670.803	Handel	Citigroup Global Markets	(24.365)
	18.10.2019	SEK	9.976	EUR	936	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	USD	1.071	EUR	965	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
	18.10.2019	USD	1.079	EUR	972	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
	18.10.2019	GBP	458.762	EUR	517.270	Handel	UBS	940
	18.10.2019	EUR	109.235	AUD	175.664	Handel	Lloyds	643
	18.10.2019	GBP	398.282	USD	495.742	Handel	Lloyds	(4.178)
	18.10.2019	EUR	14.671.803	USD	16.221.233	Handel	Lloyds	(185.947)
	18.10.2019	EUR	1.271.659	USD	1.388.221	Handel	Lloyds	149
								EUR (212.731)
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	18.10.2019	EUR	2.485.972	USD	2.758.777	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44.621)
	18.10.2019	EUR	12.799.990	USD	14.204.634	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(229.748)
	18.10.2019	EUR	5.208.161	USD	5.779.693	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(93.481)
	18.10.2019	EUR	151.382	USD	167.995	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.717)
	18.10.2019	EUR	480.497	USD	533.225	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.624)
	18.10.2019	EUR	49	USD	54	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	164	USD	180	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	EUR	61	USD	67	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	1.582	USD	1.758	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds (Fortsetzung)								
	18.10.2019	EUR	246	USD	272	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	18.10.2019	EUR	6.926	USD	7.635	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(73)
	18.10.2019	EUR	233	USD	258	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	18.10.2019	NOK	10.112	USD	1.131	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	18.10.2019	SEK	10.077	USD	1.049	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	18.10.2019	SGD	41.478	USD	30.215	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(215)
	18.10.2019	USD	28	EUR	26	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	370	EUR	336	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	18.10.2019	USD	2.430	EUR	2.206	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	18.10.2019	USD	2.450	EUR	2.236	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	18.10.2019	USD	3.250	EUR	2.967	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	18.10.2019	USD	39.547	EUR	36.082	Absicherung	JP Morgan Chase New York	153
	18.10.2019	USD	399	EUR	364	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	18.10.2019	USD	3.917	EUR	3.554	Absicherung	JP Morgan Chase New York	37
	18.10.2019	USD	620	EUR	560	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	18.10.2019	USD	4.246	EUR	3.833	Absicherung	JP Morgan Chase New York	61
	18.10.2019	USD	0**	EUR	0**	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	3.500	EUR	3.173	Absicherung	JP Morgan Chase New York	36
	18.10.2019	USD	11.017	EUR	10.003	Absicherung	JP Morgan Chase New York	96
	18.10.2019	EUR	65	USD	71	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	EUR	5.036.844	USD	5.589.576	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(90.406)
								USD (469.526)
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt								
	18.10.2019	EUR	455.674	USD	505.679	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.179)
	18.10.2019	EUR	388.907	USD	431.585	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.980)
	18.10.2019	EUR	667.686	USD	740.956	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11.984)
	18.10.2019	EUR	983.616	USD	1.091.556	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17.656)
	18.10.2019	EUR	29.850	USD	33.162	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(572)
	18.10.2019	EUR	19	USD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	5.000	USD	5.480	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	18.10.2019	EUR	196	USD	215	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	NOK	9.967	USD	1.114	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	18.10.2019	SEK	9.935	USD	1.034	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	18.10.2019	SGD	180.196	USD	131.265	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(935)
	16.10.2019	USD	782.952	ZAR	11.955.001	Handel	Royal Bank of Scotland	(3.755)
	10.09.2019	USD	560.479	EUR	507.490	Handel	JP Morgan	6.821
								USD (43.301)
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds								
	18.10.2019	SGD	42	USD	30	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	729	USD	799	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	18.10.2019	SGD	32.729	USD	23.763	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(91)
	18.10.2019	SGD	2.554	USD	1.854	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	18.10.2019	USD	2	SGD	2	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	565	SGD	775	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds (Fortsetzung)								
	18.10.2019	USD	18.245	EUR	16.646	Absicherung	JP Morgan Chase New York	70
	18.10.2019	USD	44.227	EUR	40.370	Absicherung	JP Morgan Chase New York	151
	18.10.2019	USD	180	EUR	165	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	USD	23.340	EUR	21.268	Absicherung	JP Morgan Chase New York	119
	18.10.2019	USD	29.801	EUR	27.052	Absicherung	JP Morgan Chase New York	265
	18.10.2019	USD	2.178	EUR	1.974	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	18.10.2019	USD	22.429	EUR	20.247	Absicherung	JP Morgan Chase New York	323
	18.10.2019	USD	1.084	EUR	979	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	18.10.2019	USD	33.915	EUR	30.766	Absicherung	JP Morgan Chase New York	325
	18.10.2019	USD	3.888	EUR	3.527	Absicherung	JP Morgan Chase New York	37
	18.10.2019	USD	5.184	EUR	4.666	Absicherung	JP Morgan Chase New York	89
	18.10.2019	USD	10.670	EUR	9.604	Absicherung	JP Morgan Chase New York	184
	16.10.2019	USD	1.134.315	ZAR	17.320.001	Handel	Royal Bank of Scotland	(5.440)
	18.10.2019	SGD	554	USD	402	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	SGD	556	USD	404	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	18.10.2019	SGD	1.715	USD	1.249	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	18.10.2019	SGD	99	USD	72	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	SGD	385.247	USD	280.637	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.998)
	18.10.2019	SGD	946.449	USD	689.449	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.909)
	18.10.2019	SEK	9.854	USD	1.026	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	18.10.2019	NOK	9.886	USD	1.105	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	18.10.2019	EUR	13	USD	14	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	118.478	USD	130.516	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.163)
	18.10.2019	EUR	11.039.474	USD	12.250.925	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(198.148)
	18.10.2019	EUR	6.327.013	USD	7.021.327	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(113.564)
	18.10.2019	EUR	3.186.034	USD	3.535.663	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(57.186)
	18.10.2019	EUR	3.352.954	USD	3.720.900	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(60.182)
	18.10.2019	EUR	15.639.840	USD	17.356.126	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(280.718)
								USD (721.854)
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond								
	18.10.2019	EUR	791.618	USD	878.489	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14.209)
	18.10.2019	EUR	773.255	USD	858.110	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13.879)
	18.10.2019	EUR	131.815.848	USD	146.281.056	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.365.964)
	18.10.2019	EUR	909.446	USD	1.009.247	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16.324)
	18.10.2019	EUR	368.175	USD	408.578	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.608)
	18.10.2019	CHF	1.053	USD	1.068	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	18.10.2019	EUR	191.233	USD	212.219	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.432)
	18.10.2019	EUR	159.344	USD	176.830	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.860)
	18.10.2019	EUR	2.498	USD	2.751	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	18.10.2019	EUR	490	USD	538	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	18.10.2019	EUR	4.996	USD	5.482	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(28)
	18.10.2019	EUR	0**	USD	0**	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	1.145	USD	1.429	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	18.10.2019	SGD	15.000	USD	10.930	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(81)
	18.10.2019	SGD	504.459	USD	367.478	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.616)
	18.10.2019	SGD	1.150	USD	833	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	USD	1.599	SGD	2.203	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (Fortsetzung)								
	18.10.2019	USD	9.491	EUR	8.567	Absicherung	JP Morgan Chase New York	137
	18.10.2019	USD	33.313	EUR	30.200	Absicherung	JP Morgan Chase New York	340
	18.10.2019	USD	2.266	EUR	2.057	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	18.10.2019	USD	16.065	EUR	14.658	Absicherung	JP Morgan Chase New York	62
								USD (2.425.491)
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond								
	18.10.2019	AUD	1.076	USD	740	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	18.10.2019	EUR	24.713	USD	27.365	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(384)
	18.10.2019	EUR	400.996	USD	445.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.197)
	18.10.2019	EUR	187.348	USD	207.908	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.363)
	18.10.2019	EUR	3.035	USD	3.368	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(54)
	18.10.2019	GBP	2.545	USD	3.174	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(36)
	16.10.2019	KRW	3.000.000.000	USD	2.457.365	Handel	Citigroup Global Markets	46.136
	16.10.2019	PHP	65.890.215	USD	1.259.605	Handel	UBS	11.680
	18.10.2019	SEK	10.099	USD	1.051	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	18.10.2019	SGD	3.282	USD	2.391	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	18.10.2019	SGD	3.000	USD	2.182	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	16.10.2019	SGD	2.000.000	USD	1.441.232	Handel	UBS	5.274
	18.10.2019	SGD	1.633.049	USD	1.189.610	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.470)
	18.10.2019	SGD	130.375	USD	94.973	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(676)
	18.10.2019	SGD	45.909	USD	33.357	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(152)
	18.10.2019	SGD	103.902	USD	75.222	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(72)
	18.10.2019	SGD	190	USD	138	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	16.10.2019	THB	55.000.000	USD	1.783.398	Handel	Citigroup Global Markets	15.377
	16.10.2019	USD	660.920	IDR	9.600.000.000	Handel	Barclays	(15.212)
	16.10.2019	USD	3.060.255	PHP	161.000.000	Handel	Citigroup Global Markets	(46.079)
	18.10.2019	AUD	1.131	USD	778	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
								USD (3.310)
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return								
	11.08.2019	EUR	1.591.312	USD	1.794.792	Handel	Barclays	(50.116)
	11.08.2019	EUR	2.748.757	GBP	2.534.944	Handel	Barclays	(112.689)
	11.08.2019	JPY	30.604.800	EUR	256.885	Handel	Barclays	2.782
								EUR (160.023)
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return								
	11.08.2019	JPY	574.422.202	USD	5.438.064	Handel	Lloyds	(108.495)
	18.10.2019	EUR	10.536.902	USD	11.693.202	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(189.126)
	18.10.2019	EUR	2.284.380	USD	2.535.063	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(41.002)
	18.10.2019	EUR	1.811.712	USD	2.010.525	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(32.518)
	18.10.2019	EUR	1.003	USD	1.113	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	18.10.2019	EUR	58	USD	63	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	49.990	USD	55.398	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(820)
	18.10.2019	EUR	39.990	USD	44.299	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(639)
	18.10.2019	GBP	316.213	USD	394.476	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.501)
	18.10.2019	SEK	10.079	USD	1.049	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	18.10.2019	USD	13.262	EUR	11.937	Absicherung	JP Morgan Chase New York	228

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return (Fortsetzung)								
	18.10.2019	USD	11.743	EUR	10.714	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
	18.10.2019	USD	253	EUR	230	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	18.10.2019	USD	29	EUR	26	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	28.746	EUR	25.940	Absicherung	JP Morgan Chase New York	425
	18.10.2019	USD	31.175	EUR	28.142	Absicherung	JP Morgan Chase New York	449
	18.10.2019	USD	7.721	EUR	7.010	Absicherung	JP Morgan Chase New York	67
	18.10.2019	USD	1.247	EUR	1.132	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	18.10.2019	USD	6.576	EUR	5.993	Absicherung	JP Morgan Chase New York	34
	18.10.2019	USD	52.447	EUR	47.852	Absicherung	JP Morgan Chase New York	203
								USD (375.678)
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income								
	18.10.2019	USD	143.395	EUR	129.396	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.119
	18.10.2019	USD	92.651	EUR	83.606	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.369
	18.10.2019	USD	16.991	EUR	15.503	Absicherung	JP Morgan Chase New York	66
	18.10.2019	USD	14.734	EUR	13.427	Absicherung	JP Morgan Chase New York	75
	18.10.2019	USD	193.546	EUR	176.369	Absicherung	JP Morgan Chase New York	986
	18.10.2019	USD	58.728	EUR	53.607	Absicherung	JP Morgan Chase New York	200
	18.10.2019	USD	37.258	EUR	34.009	Absicherung	JP Morgan Chase New York	127
	18.10.2019	USD	19.473	EUR	17.775	Absicherung	JP Morgan Chase New York	66
	18.10.2019	USD	5.468	EUR	4.991	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	18.10.2019	USD	179.177	EUR	161.685	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.648
	18.10.2019	USD	5.547	EUR	5.006	Absicherung	JP Morgan Chase New York	82
	18.10.2019	USD	37.358	EUR	33.724	Absicherung	JP Morgan Chase New York	538
	21.10.2019	USD	47.356	GBP	37.792	Handel	HSBC	742
	18.10.2019	USD	102.080	EUR	92.543	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.041
	18.10.2019	USD	103.200	EUR	93.558	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.053
	18.10.2019	USD	26.879	EUR	24.368	Absicherung	JP Morgan Chase New York	274
	21.10.2019	USD	605.745	EUR	551.180	Handel	Lloyds	3.814
	18.10.2019	USD	32.157	EUR	29.196	Absicherung	JP Morgan Chase New York	281
	18.10.2019	USD	7.594	EUR	6.895	Absicherung	JP Morgan Chase New York	66
	18.10.2019	USD	89.889	EUR	81.612	Absicherung	JP Morgan Chase New York	785
	18.10.2019	USD	11.463	EUR	10.408	Absicherung	JP Morgan Chase New York	100
	18.10.2019	USD	4.744	EUR	4.307	Absicherung	JP Morgan Chase New York	42
	18.10.2019	USD	158.299	EUR	143.698	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.409
	18.10.2019	USD	34.182	EUR	31.029	Absicherung	JP Morgan Chase New York	304
	18.10.2019	USD	1.979.861	EUR	1.805.052	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9.111
	18.10.2019	USD	1.182.232	EUR	1.077.849	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.441
	18.10.2019	USD	22	EUR	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	163.799	EUR	148.590	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.568
	18.10.2019	USD	76.405	EUR	69.624	Absicherung	JP Morgan Chase New York	389
	21.10.2019	USD	89.077.418	EUR	80.700.453	Handel	Goldman Sachs	945.742
	18.10.2019	USD	52.189	EUR	47.131	Absicherung	JP Morgan Chase New York	731
	18.10.2019	USD	99.690	EUR	90.028	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.396
	18.10.2019	USD	128.662	EUR	116.192	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.802
	18.10.2019	USD	75.400	EUR	67.869	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.299
	18.10.2019	USD	27.688	EUR	24.923	Absicherung	JP Morgan Chase New York	477
	18.10.2019	USD	146.282	EUR	132.700	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.400
	18.10.2019	USD	91.480	EUR	82.986	Absicherung	JP Morgan Chase New York	875

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income (Fortsetzung)								
	21.10.2019	USD	370.008	GBP	297.300	Handel	Barclays	3.304
	21.10.2019	USD	15.563.384	GBP	12.523.700	Handel	JP Morgan	116.108
	18.10.2019	USD	1.680	SGD	2.318	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	18.10.2019	EUR	84.288.623	USD	93.538.288	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.512.896)
	18.10.2019	EUR	50.300.092	USD	55.819.923	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(902.836)
	18.10.2019	EUR	926	USD	1.028	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	18.10.2019	EUR	6.437.143	USD	7.143.542	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(115.540)
	18.10.2019	SGD	111.160	USD	80.975	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(577)
	18.10.2019	SGD	200	USD	145	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	EUR	91.010	USD	100.390	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.026)
	18.10.2019	SGD	224	USD	163	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	21.10.2019	EUR	415.000	USD	458.734	Handel	Barclays	(5.527)
	21.10.2019	GBP	58.000	USD	72.162	Handel	Royal Bank of Scotland	(622)
	18.10.2019	EUR	12.988	USD	14.382	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(202)
	21.10.2019	EUR	121.900	USD	133.531	Handel	Lloyds	(409)
	21.10.2019	GBP	492.930	USD	607.139	Handel	Lloyds	858
	18.10.2019	EUR	26.931	USD	29.517	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(114)
	18.10.2019	EUR	66.214	USD	72.572	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(281)
	18.10.2019	SGD	932	USD	675	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	EUR	28.793.399	USD	31.953.130	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(516.813)
	18.10.2019	SGD	23.764	USD	17.311	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(123)
	18.10.2019	EUR	6.174	USD	6.859	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(118)
	18.10.2019	EUR	13.688	USD	15.163	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(219)
	18.10.2019	EUR	24.988	USD	27.681	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(399)
	18.10.2019	EUR	48.883	USD	54.150	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(781)
	21.10.2019	EUR	600.000	USD	665.113	Handel	Lloyds	(9.875)
	21.10.2019	EUR	348.712	USD	381.847	Handel	Royal Bank of Scotland	(1.032)
	18.10.2019	EUR	39.450	USD	43.292	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(221)
	18.10.2019	EUR	167.984	USD	186.418	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.015)
	18.10.2019	CHF	1.010	USD	1.025	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
								USD (1.963.946)
Threadneedle (Lux) - Global Focus								
	18.10.2019	EUR	50.149	USD	55.713	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(961)
	18.10.2019	EUR	679.890	USD	754.500	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12.203)
	18.10.2019	EUR	4.444.314	USD	4.932.024	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(79.771)
	18.10.2019	EUR	16.561	USD	18.151	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(70)
	18.10.2019	EUR	37	USD	40	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	128.197	USD	140.682	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(718)
	18.10.2019	EUR	99.975	USD	110.114	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(963)
	18.10.2019	EUR	110.952	USD	122.204	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.068)
	18.10.2019	EUR	2.131	USD	2.351	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	18.10.2019	EUR	29.975	USD	33.205	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(479)
	18.10.2019	EUR	260.427	USD	288.376	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.044)
	18.10.2019	EUR	198.690	USD	219.027	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.099)
	18.10.2019	EUR	65.954	USD	72.704	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(697)
	18.10.2019	EUR	16.899	USD	18.629	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(179)
	18.10.2019	EUR	31.253.038	USD	34.682.685	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(560.960)
	18.10.2019	USD	4.149	EUR	3.780	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
	18.10.2019	USD	9.641	EUR	8.752	Absicherung	JP Morgan Chase New York	86

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Focus								
<i>(Fortsetzung)</i>	18.10.2019	USD	11.844	EUR	10.738	Absicherung	JP Morgan Chase New York	121
	18.10.2019	USD	7.080	EUR	6.392	Absicherung	JP Morgan Chase New York	102
	18.10.2019	USD	9.559	EUR	8.626	Absicherung	JP Morgan Chase New York	141
	18.10.2019	USD	1.804	EUR	1.628	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27
	18.10.2019	USD	1.079	EUR	974	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	18.10.2019	USD	1.065	EUR	958	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
								USD (663.705)
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities								
	18.10.2019	EUR	928.885	USD	1.030.819	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16.673)
	18.10.2019	EUR	11.388	USD	12.637	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(204)
	18.10.2019	USD	5	EUR	5	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	1.807	EUR	1.640	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
	18.10.2019	USD	20.689	EUR	18.777	Absicherung	JP Morgan Chase New York	189
	18.10.2019	USD	248	EUR	225	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	18.10.2019	USD	0**	EUR	0**	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	25	EUR	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	82.057	USD	91.062	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.473)
	18.10.2019	EUR	250	USD	277	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
								USD (18.146)
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income								
	18.10.2019	EUR	1.012	USD	1.123	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	18.10.2019	EUR	1.008	USD	1.119	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	18.10.2019	SGD	174	USD	126	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	SGD	45	USD	33	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	SGD	14.697	USD	10.678	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(49)
	18.10.2019	SGD	37	USD	27	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	AUD	10	USD	7	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	AUD	106.009	USD	72.941	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.393)
	18.10.2019	SGD	6.717.596	USD	4.893.496	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(34.841)
	18.10.2019	SGD	3.331.362	USD	2.426.762	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17.278)
	18.10.2019	SGD	1.495.111	USD	1.089.128	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.754)
	18.10.2019	USD	24	EUR	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	24	EUR	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	104.525	SGD	144.244	Absicherung	JP Morgan Chase New York	197
								USD (61.154)
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies								
	18.10.2019	CHF	1.157	EUR	1.058	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	18.10.2019	EUR	90	GBP	80	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	1	GBP	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	661	GBP	588	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	18.10.2019	GBP	411.376	EUR	462.279	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.404
	18.10.2019	GBP	1.603	EUR	1.802	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	18.10.2019	GBP	5.000	EUR	5.614	Absicherung	JP Morgan Chase New York	34

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies (Fortsetzung)								
	18.10.2019	GBP	2.915	EUR	3.289	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	18.10.2019	GBP	2.878	EUR	3.248	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	18.10.2019	GBP	1.717	EUR	1.934	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
								EUR 2.462
Threadneedle (Lux) - American								
	18.10.2019	EUR	14.008.667	USD	15.545.950	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(251.442)
	18.10.2019	EUR	145.476	USD	159.447	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(617)
	18.10.2019	EUR	3.125	USD	3.424	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	18.10.2019	EUR	92.299	USD	101.677	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(906)
	18.10.2019	EUR	11.258	USD	12.399	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(108)
	18.10.2019	EUR	33.519	USD	36.721	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(126)
	18.10.2019	EUR	1.729	USD	1.898	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	18.10.2019	EUR	855	USD	938	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	EUR	62.656	USD	68.758	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(351)
	18.10.2019	EUR	801	USD	882	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	18.10.2019	EUR	437	USD	481	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	18.10.2019	EUR	16.128	USD	17.764	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(155)
	18.10.2019	EUR	48.463	USD	53.458	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(546)
	18.10.2019	EUR	6.661	USD	7.381	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(109)
	18.10.2019	EUR	148	USD	163	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	18.10.2019	EUR	5.828	USD	6.456	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(93)
	18.10.2019	EUR	23.775.312	USD	26.384.367	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(426.743)
	18.10.2019	EUR	2.585.726	USD	2.869.479	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(46.411)
	18.10.2019	EUR	46.289.751	USD	51.369.495	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(830.854)
	18.10.2019	EUR	4.378	USD	4.826	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(46)
	18.10.2019	EUR	4.600	USD	5.110	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(88)
	18.10.2019	USD	1.137	EUR	1.038	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	18.10.2019	USD	91	EUR	83	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	11.740	EUR	10.711	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
	18.10.2019	USD	23.021	EUR	21.015	Absicherung	JP Morgan Chase New York	78
	18.10.2019	USD	2.445	EUR	2.232	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	18.10.2019	USD	144.497	EUR	131.902	Absicherung	JP Morgan Chase New York	487
	18.10.2019	USD	308.369	EUR	281.491	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.038
	18.10.2019	USD	523.511	EUR	477.881	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.763
	18.10.2019	USD	57.863	EUR	52.820	Absicherung	JP Morgan Chase New York	195
	18.10.2019	USD	1.037.608	EUR	947.170	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.494
	18.10.2019	USD	849	EUR	775	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	18.10.2019	USD	24.736	EUR	22.541	Absicherung	JP Morgan Chase New York	126
	18.10.2019	USD	19.768	EUR	18.014	Absicherung	JP Morgan Chase New York	101
	18.10.2019	USD	3.043	EUR	2.762	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27
	18.10.2019	USD	2.109	EUR	1.915	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	18.10.2019	USD	10.011	EUR	9.089	Absicherung	JP Morgan Chase New York	87
	18.10.2019	USD	6.282	EUR	5.703	Absicherung	JP Morgan Chase New York	55
	18.10.2019	USD	4.152	EUR	3.764	Absicherung	JP Morgan Chase New York	42
	18.10.2019	USD	10.673	EUR	9.676	Absicherung	JP Morgan Chase New York	109
	18.10.2019	USD	7.789	EUR	7.062	Absicherung	JP Morgan Chase New York	79
	18.10.2019	USD	854	EUR	771	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	18.10.2019	USD	9.129	EUR	8.238	Absicherung	JP Morgan Chase New York	135
	18.10.2019	USD	15.593	EUR	14.082	Absicherung	JP Morgan Chase New York	218

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - American								
<i>(Fortsetzung)</i>	18.10.2019	USD	3.234	EUR	2.921	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
	18.10.2019	USD	5.712	EUR	5.158	Absicherung	JP Morgan Chase New York	80
	18.10.2019	USD	94.377	EUR	85.230	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.322
	18.10.2019	USD	7.635	EUR	6.926	Absicherung	JP Morgan Chase New York	73
	18.10.2019	USD	409	EUR	371	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	18.10.2019	EUR	6.466.802	USD	7.176.455	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(116.073)
	18.10.2019	EUR	111.060	USD	123.247	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.993)
	18.10.2019	USD	8.828	EUR	7.947	Absicherung	JP Morgan Chase New York	152
	18.10.2019	USD	11.420	EUR	10.309	Absicherung	JP Morgan Chase New York	164
	18.10.2019	EUR	1.046.429	USD	1.161.262	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18.782)
	18.10.2019	EUR	19.776	USD	21.970	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(379)
	18.10.2019	EUR	92	USD	103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
								USD (1.685.900)
Threadneedle (Lux) - American Select								
	18.10.2019	EUR	5.071.851	USD	5.628.428	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(91.034)
	18.10.2019	EUR	1.041	USD	1.155	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	18.10.2019	USD	116.959	EUR	106.146	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.068
	18.10.2019	USD	318.683	EUR	290.761	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.231
	18.10.2019	USD	24	EUR	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	18.497	EUR	16.787	Absicherung	JP Morgan Chase New York	169
	18.10.2019	USD	25	EUR	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	20.395	EUR	18.509	Absicherung	JP Morgan Chase New York	186
	18.10.2019	USD	32.191	EUR	29.384	Absicherung	JP Morgan Chase New York	110
	18.10.2019	USD	33	EUR	29	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	1.937	EUR	1.748	Absicherung	JP Morgan Chase New York	29
	18.10.2019	USD	22.489	EUR	20.410	Absicherung	JP Morgan Chase New York	205
	18.10.2019	USD	7.988	EUR	7.250	Absicherung	JP Morgan Chase New York	73
	18.10.2019	EUR	794.913	USD	882.146	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14.268)
	18.10.2019	EUR	1.074	USD	1.192	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	18.10.2019	EUR	883.436	USD	980.383	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15.857)
	18.10.2019	EUR	972	USD	1.071	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	18.10.2019	EUR	4.026	USD	4.458	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(63)
	18.10.2019	EUR	1.132	USD	1.247	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	18.10.2019	EUR	2.694	USD	2.956	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	18.10.2019	EUR	963.447	USD	1.069.173	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17.292)
	18.10.2019	EUR	339.089	USD	376.300	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.086)
								USD (141.603)
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies								
	18.10.2019	EUR	43.464	USD	48.233	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(780)
	18.10.2019	EUR	1.088	USD	1.208	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
	18.10.2019	EUR	1.084	USD	1.203	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	18.10.2019	EUR	1.099	USD	1.219	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
	18.10.2019	USD	26	EUR	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	1.022	EUR	935	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	USD	26	EUR	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	26	EUR	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								USD (838)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	18.10.2019	USD	147	SGD	202	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	USD	121	EUR	110	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	USD	598	SGD	823	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	18.10.2019	USD	11.842	SGD	16.306	Absicherung	JP Morgan Chase New York	49
	18.10.2019	SGD	665.907	USD	485.086	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.454)
	18.10.2019	SGD	8.319	USD	6.060	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
	18.10.2019	EUR	4.457	USD	4.946	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(80)
	10.02.2019	SGD	1.101.659	USD	799.928	Handel	Citigroup Global Markets	(3.289)
	18.10.2019	SGD	14.840	USD	10.768	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(35)
								USD (6.848)
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	18.10.2019	USD	17.941	AUD	26.435	Absicherung	JP Morgan Chase New York	100
	18.10.2019	AUD	309	USD	210	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	18.10.2019	SGD	8.352	USD	6.084	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
	18.10.2019	AUD	1.386.149	USD	953.762	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18.220)
	18.10.2019	AUD	1.750.130	USD	1.204.204	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23.004)
	18.10.2019	EUR	4.480	USD	4.972	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(80)
	18.10.2019	AUD	382	USD	259	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	SGD	385	USD	279	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	SGD	856.448	USD	623.888	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.442)
	18.10.2019	SGD	11.888.075	USD	8.659.979	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(61.656)
	18.10.2019	USD	65.554	SGD	90.342	Absicherung	JP Morgan Chase New York	213
	18.10.2019	USD	16.473	SGD	22.672	Absicherung	JP Morgan Chase New York	75
	18.10.2019	USD	118	SGD	163	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	188.969	SGD	259.558	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.237
	18.10.2019	USD	119	SGD	164	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	12.282	SGD	16.931	Absicherung	JP Morgan Chase New York	36
	18.10.2019	USD	167.367	SGD	230.723	Absicherung	JP Morgan Chase New York	492
	18.10.2019	USD	277.427	SGD	381.363	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.598
	18.10.2019	USD	189.611	SGD	260.679	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.068
	18.10.2019	USD	13.992	SGD	19.203	Absicherung	JP Morgan Chase New York	103
	18.10.2019	USD	12.190	SGD	16.784	Absicherung	JP Morgan Chase New York	50
	18.10.2019	USD	170.677	SGD	235.003	Absicherung	JP Morgan Chase New York	705
	18.10.2019	USD	70.130	SGD	96.592	Absicherung	JP Morgan Chase New York	267
	18.10.2019	USD	262.413	SGD	361.079	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.254
	18.10.2019	USD	87.319	SGD	120.304	Absicherung	JP Morgan Chase New York	306
	18.10.2019	USD	787	SGD	1.087	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	USD	2.159	SGD	2.976	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	18.10.2019	USD	98	EUR	89	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	USD	98	EUR	89	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	USD	15.867	AUD	23.391	Absicherung	JP Morgan Chase New York	80
	18.10.2019	USD	5.165	AUD	7.615	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26
	18.10.2019	USD	141.716	AUD	206.958	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.034
18.10.2019	USD	22.141	AUD	32.322	Absicherung	JP Morgan Chase New York	326	
18.10.2019	USD	801.628	AUD	1.167.937	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13.352	
18.10.2019	USD	52.396	AUD	76.292	Absicherung	JP Morgan Chase New York	904	
18.10.2019	USD	24.329	AUD	35.899	Absicherung	JP Morgan Chase New York	100	
18.10.2019	USD	173.336	AUD	253.136	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.487	
								USD (80.626)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities								
	18.10.2019	EUR	105	USD	117	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	18.10.2019	CHF	2.675	USD	2.715	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(27)
	18.10.2019	EUR	16.164.069	USD	17.937.882	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(290.129)
	18.10.2019	EUR	370.103	USD	410.717	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.643)
	18.10.2019	EUR	4.127	USD	4.521	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	18.10.2019	EUR	20.165	USD	22.128	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(113)
	18.10.2019	EUR	6.553	USD	7.219	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(64)
	18.10.2019	EUR	19.891	USD	21.941	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(224)
	18.10.2019	EUR	2.818	USD	3.122	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(45)
	18.10.2019	EUR	40.857	USD	45.277	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(670)
	18.10.2019	EUR	7.188	USD	7.960	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(112)
	18.10.2019	EUR	10.692	USD	11.786	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(113)
	18.10.2019	GBP	2.825	USD	3.525	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40)
	18.10.2019	SGD	352.855.757	USD	257.041.112	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.830.071)
	18.10.2019	USD	26.052	EUR	23.740	Absicherung	JP Morgan Chase New York	133
	18.10.2019	USD	3	EUR	2	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	19.247	EUR	17.325	Absicherung	JP Morgan Chase New York	332
	18.10.2019	USD	2.418	EUR	2.206	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
								USD (2.127.794)
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities								
	18.10.2019	CHF	1.894	USD	1.921	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	18.10.2019	CHF	1.888	USD	1.916	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	18.10.2019	EUR	2.056	USD	2.281	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37)
	18.10.2019	EUR	2.046	USD	2.271	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37)
	18.10.2019	EUR	2.069	USD	2.297	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37)
	18.10.2019	EUR	1.997	USD	2.216	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(36)
	18.10.2019	EUR	2.066	USD	2.294	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37)
	18.10.2019	USD	49	EUR	44	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								USD (222)
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities								
	18.10.2019	EUR	2.447	SGD	3.731	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	18.10.2019	EUR	9.128	SGD	13.893	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(76)
	18.10.2019	EUR	1.323	SGD	2.007	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	18.10.2019	EUR	1.972	SGD	2.990	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	18.10.2019	EUR	16.269	SGD	24.620	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(41)
	18.10.2019	SGD	5.440.821	EUR	3.572.555	Absicherung	JP Morgan Chase New York	31.801
	18.10.2019	SGD	8.772	EUR	5.789	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23
	18.10.2019	USD	2.715	EUR	2.447	Absicherung	JP Morgan Chase New York	40
	18.10.2019	USD	825.613	EUR	743.971	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12.231
								EUR 43.938

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	18.10.2019	USD	1.042	EUR	939	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	18.10.2019	SGD	22.801.865	EUR	14.972.180	Absicherung	JP Morgan Chase New York	133.275
	18.10.2019	SGD	2.609	EUR	1.720	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	18.10.2019	SGD	29.943	EUR	19.729	Absicherung	JP Morgan Chase New York	107
	18.10.2019	SGD	25.695	EUR	16.881	Absicherung	JP Morgan Chase New York	141
	18.10.2019	SGD	76.825	EUR	50.695	Absicherung	JP Morgan Chase New York	198
	18.10.2019	SGD	33.137	EUR	21.735	Absicherung	JP Morgan Chase New York	217
	18.10.2019	EUR	301.077	SGD	455.801	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(877)
	18.10.2019	EUR	3.095	SGD	4.693	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	18.10.2019	EUR	30.192	SGD	46.078	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(334)
	18.10.2019	EUR	10.877	SGD	16.557	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(92)
	18.10.2019	EUR	124.697	SGD	188.583	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(233)
	18.10.2019	EUR	9.402	SGD	14.227	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	18.10.2019	EUR	41.346	SGD	62.531	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(78)
	18.10.2019	EUR	19	USD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	19	USD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	1.030	EUR	928	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	18.10.2019	EUR	18	CHF	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	CHF	983	EUR	899	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
								EUR 132.332
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	18.10.2019	USD	9.078.149	EUR	8.180.444	Absicherung	JP Morgan Chase New York	134.487
	18.10.2019	CHF	38.674	EUR	35.362	Absicherung	JP Morgan Chase New York	219
	18.10.2019	USD	1.313.903	EUR	1.183.976	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19.465
	18.10.2019	EUR	8.715	USD	9.564	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(45)
	18.10.2019	EUR	62.310	USD	68.263	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(214)
	18.10.2019	EUR	95.356	USD	105.936	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.676)
	18.10.2019	EUR	129.957	USD	144.016	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.955)
	18.10.2019	EUR	38.613	USD	42.773	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(566)
	18.10.2019	EUR	598.701	USD	656.682	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.776)
	18.10.2019	CHF	9.640	EUR	8.896	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(28)
	18.10.2019	CHF	2.024.669	EUR	1.851.282	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11.476
	18.10.2019	CHF	1.344.984	EUR	1.229.803	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.624
	18.10.2019	EUR	40.527	CHF	44.022	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25
	18.10.2019	EUR	26.601	CHF	28.895	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
	18.10.2019	EUR	171.780	USD	188.416	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(797)
	18.10.2019	EUR	764	CHF	830	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	24.847	USD	27.253	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(115)
	18.10.2019	EUR	240.646	USD	264.083	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.236)
	18.10.2019	USD	3.263	EUR	2.977	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	18.10.2019	USD	31.516.379	EUR	28.399.839	Absicherung	JP Morgan Chase New York	466.894
								EUR 630.810

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - European Select	18.10.2019	EUR	1.754	GBP	1.562	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	18.10.2019	EUR	25.796	SGD	39.092	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(101)
	18.10.2019	EUR	162.620	SGD	248.190	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.799)
	18.10.2019	EUR	1.692	GBP	1.500	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	18.10.2019	EUR	17	GBP	15	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	701	GBP	621	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	112.851	SGD	171.198	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(562)
	18.10.2019	EUR	98.727	SGD	149.693	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(441)
	18.10.2019	EUR	5.005	GBP	4.433	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	18.10.2019	EUR	2	USD	2	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	46.755	GBP	41.498	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(120)
	18.10.2019	GBP	9.646	EUR	10.840	Absicherung	JP Morgan Chase New York	56
	18.10.2019	GBP	10.157.965	EUR	11.414.906	Absicherung	JP Morgan Chase New York	59.369
	18.10.2019	GBP	10.182	EUR	11.493	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	18.10.2019	SGD	28.888.071	EUR	18.968.507	Absicherung	JP Morgan Chase New York	168.848
	18.10.2019	SGD	26.418	EUR	17.328	Absicherung	JP Morgan Chase New York	173
	18.10.2019	SGD	5.017	EUR	3.296	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
	18.10.2019	SGD	8.771	EUR	5.762	Absicherung	JP Morgan Chase New York	48
	18.10.2019	SGD	20.832	EUR	13.726	Absicherung	JP Morgan Chase New York	75
	18.10.2019	SGD	39.805	EUR	26.320	Absicherung	JP Morgan Chase New York	50
	18.10.2019	SGD	34.796	EUR	22.994	Absicherung	JP Morgan Chase New York	57
	18.10.2019	SGD	55.908	EUR	36.968	Absicherung	JP Morgan Chase New York	69
	18.10.2019	USD	663.432	EUR	597.828	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9.828
	18.10.2019	USD	1.122	EUR	1.011	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
	18.10.2019	USD	3.444.601	EUR	3.103.977	Absicherung	JP Morgan Chase New York	51.029
	18.10.2019	USD	10.460	EUR	9.415	Absicherung	JP Morgan Chase New York	165
	18.10.2019	USD	13.501	EUR	12.247	Absicherung	JP Morgan Chase New York	119
	18.10.2019	USD	3.900	EUR	3.519	Absicherung	JP Morgan Chase New York	53
	18.10.2019	USD	6.950	EUR	6.274	Absicherung	JP Morgan Chase New York	92
	18.10.2019	USD	2.000	EUR	1.813	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	18.10.2019	USD	18.877	EUR	17.139	Absicherung	JP Morgan Chase New York	151
	18.10.2019	USD	7.800	EUR	7.081	Absicherung	JP Morgan Chase New York	64
18.10.2019	USD	11.000	EUR	10.041	Absicherung	JP Morgan Chase New York	34	
18.10.2019	USD	26.070	EUR	23.786	Absicherung	JP Morgan Chase New York	92	
18.10.2019	GBP	100	EUR	113	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0	
18.10.2019	GBP	1.737	EUR	1.959	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3	
								EUR 287.410
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	18.10.2019	CHF	491.466	EUR	449.378	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.786
	18.10.2019	CHF	1.921.412	EUR	1.756.868	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10.891
	18.10.2019	CHF	1.631	EUR	1.491	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	18.10.2019	CHF	4.163	EUR	3.793	Absicherung	JP Morgan Chase New York	37
	18.10.2019	CHF	39.670	EUR	36.537	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40)
	18.10.2019	EUR	10.960	CHF	11.906	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	18.10.2019	EUR	42.495	CHF	46.160	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26
	18.10.2019	EUR	36	CHF	39	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								EUR 13.716

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	18.10.2019	EUR	363.806	USD	403.730	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.531)
	18.10.2019	EUR	343.224	USD	380.888	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.161)
	18.10.2019	EUR	3.000	USD	3.325	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(49)
	18.10.2019	GBP	135.133	USD	168.579	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.923)
	18.10.2019	USD	115	EUR	103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	18.10.2019	USD	40.467	EUR	36.425	Absicherung	JP Morgan Chase New York	697
	18.10.2019	USD	8.933	EUR	8.107	Absicherung	JP Morgan Chase New York	82
	18.10.2019	USD	7.530	EUR	6.834	Absicherung	JP Morgan Chase New York	69
	18.10.2019	USD	3.620	GBP	2.899	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
								USD (13.769)
Threadneedle (Lux) - Global Technology	18.10.2019	USD	79.117	EUR	72.218	Absicherung	JP Morgan Chase New York	270
	18.10.2019	USD	9.805	EUR	8.950	Absicherung	JP Morgan Chase New York	33
	18.10.2019	USD	3.365	EUR	3.070	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	18.10.2019	CHF	221.908	USD	225.168	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.266)
	18.10.2019	EUR	9.903.193	USD	10.989.951	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(177.751)
	18.10.2019	EUR	1.076	USD	1.194	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	18.10.2019	EUR	139.099	USD	154.532	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.666)
	18.10.2019	EUR	95.854	USD	105.665	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.013)
	18.10.2019	EUR	111.760	USD	124.024	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.006)
	18.10.2019	EUR	6.248	USD	6.888	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(66)
	18.10.2019	EUR	41.131	USD	45.545	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(639)
	18.10.2019	EUR	380.000	USD	417.008	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.128)
	18.10.2019	EUR	48.470	USD	53.125	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(206)
	18.10.2019	EUR	873	USD	967	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	18.10.2019	EUR	37.547	USD	41.593	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(600)
	18.10.2019	EUR	25.139	USD	27.848	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(402)
	18.10.2019	EUR	55.209	USD	60.899	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(622)
	18.10.2019	EUR	19.164.683	USD	21.267.777	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(343.986)
	18.10.2019	USD	0**	EUR	0**	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	489.183	EUR	443.957	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.469
	18.10.2019	USD	248.643	EUR	225.655	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.271
	18.10.2019	USD	27	EUR	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	5.104	CHF	5.027	Absicherung	JP Morgan Chase New York	54
	18.10.2019	USD	40.796	EUR	37.033	Absicherung	JP Morgan Chase New York	363
	18.10.2019	USD	23.168	EUR	21.112	Absicherung	JP Morgan Chase New York	118
	18.10.2019	USD	239	EUR	218	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	USD	6.191	EUR	5.587	Absicherung	JP Morgan Chase New York	91
	18.10.2019	USD	2.165	EUR	1.954	Absicherung	JP Morgan Chase New York	32
	18.10.2019	USD	23.607	EUR	21.401	Absicherung	JP Morgan Chase New York	241
	18.10.2019	USD	189.048	EUR	171.641	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.650
	18.10.2019	USD	12	EUR	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	2.838	EUR	2.576	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26
								USD (524.752)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - UK Equities								
	18.10.2019	GBP	1.447	EUR	1.641	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	GBP	22.871	EUR	25.787	Absicherung	JP Morgan Chase New York	42
	18.10.2019	GBP	16.462	EUR	18.561	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	18.10.2019	GBP	6.645	EUR	7.494	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	18.10.2019	GBP	488	EUR	551	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	1.819	EUR	2.064	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	18.10.2019	GBP	4.763	EUR	5.374	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	18.10.2019	GBP	14.724	EUR	16.611	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	18.10.2019	GBP	47.003	EUR	52.996	Absicherung	JP Morgan Chase New York	86
	18.10.2019	GBP	342.323	EUR	385.976	Absicherung	JP Morgan Chase New York	625
	18.10.2019	GBP	1.968	EUR	2.222	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	GBP	23.828	EUR	26.902	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	18.10.2019	GBP	10.186	EUR	11.476	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26
	18.10.2019	GBP	7.680	EUR	8.653	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	18.10.2019	GBP	1.755	EUR	1.973	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	18.10.2019	CHF	507	GBP	414	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	18.10.2019	EUR	1.278	GBP	1.137	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	18.10.2019	EUR	15.239	GBP	13.558	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(67)
	18.10.2019	EUR	16.968.108	GBP	15.099.682	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(78.126)
	18.10.2019	CHF	7.794.282	GBP	6.342.039	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.302
	18.10.2019	USD	18.410.482	GBP	14.757.901	Absicherung	JP Morgan Chase New York	170.320
	18.10.2019	EUR	2.884	GBP	2.569	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	18.10.2019	EUR	3.170	GBP	2.823	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	18.10.2019	EUR	7.989	GBP	7.115	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	18.10.2019	CHF	1.017	GBP	827	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	EUR	1.128.886	GBP	1.004.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.198)
	18.10.2019	EUR	1.349.787	GBP	1.201.157	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.215)
	18.10.2019	USD	87.950	GBP	70.501	Absicherung	JP Morgan Chase New York	814
	18.10.2019	EUR	813.982	GBP	724.351	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.748)
	18.10.2019	CHF	35.048	GBP	28.518	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
	18.10.2019	EUR	1.002	GBP	892	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	EUR	2.334.467	GBP	2.077.411	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10.749)
	18.10.2019	USD	11.401	GBP	9.167	Absicherung	JP Morgan Chase New York	77
	18.10.2019	EUR	1.046	GBP	927	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	EUR	11.226	GBP	9.946	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	18.10.2019	CHF	8.711	GBP	7.138	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
	18.10.2019	GBP	37.416	USD	46.259	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(93)
	18.10.2019	GBP	325.131	USD	401.973	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(811)
	18.10.2019	GBP	12.049	USD	14.928	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(56)
	18.10.2019	GBP	5.374	USD	6.633	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	GBP	4.225	USD	5.215	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	18.10.2019	GBP	3.506	USD	4.361	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31)
	18.10.2019	GBP	438	USD	545	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	18.10.2019	GBP	3.325	USD	4.153	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	18.10.2019	GBP	182.110	USD	227.457	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.327)
	18.10.2019	GBP	15.733	USD	19.663	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(211)
	18.10.2019	GBP	3.008	USD	3.761	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	18.10.2019	GBP	143.831	CHF	176.168	Absicherung	JP Morgan Chase New York	344
	18.10.2019	GBP	19	CHF	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	6.073	CHF	7.523	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(54)
	18.10.2019	GBP	172	CHF	213	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - UK Equities (Fortsetzung)								
	18.10.2019	GBP	2.162	CHF	2.664	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	18.10.2019	GBP	29.466	CHF	36.530	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(287)
	18.10.2019	GBP	651	CHF	797	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	18.10.2019	GBP	27	CHF	33	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	106	EUR	120	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	1.738	EUR	1.963	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	23.263	EUR	26.372	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(84)
	18.10.2019	EUR	2.230	GBP	1.974	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	CHF	7.521	GBP	6.122	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	18.10.2019	EUR	1.581	GBP	1.395	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	18.10.2019	EUR	391	GBP	345	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	CHF	1.737	GBP	1.410	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	18.10.2019	EUR	3.116	GBP	2.763	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	CHF	853	GBP	687	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	18.10.2019	EUR	1.212	GBP	1.074	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	GBP	17	EUR	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	73.441	GBP	64.735	Absicherung	JP Morgan Chase New York	281
	18.10.2019	EUR	2.401	GBP	2.116	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	18.10.2019	CHF	7.717	GBP	6.308	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	18.10.2019	CHF	1.458	GBP	1.186	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	USD	2.111.511	GBP	1.692.594	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19.534
	18.10.2019	USD	4.539	GBP	3.627	Absicherung	JP Morgan Chase New York	53
	18.10.2019	GBP	4.152	USD	5.189	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(56)
	18.10.2019	GBP	1.216	USD	1.512	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	18.10.2019	GBP	9.159	USD	11.425	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(105)
	18.10.2019	GBP	896	USD	1.116	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	18.10.2019	GBP	25.960	USD	32.488	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(383)
	18.10.2019	GBP	27.980	USD	34.983	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(387)
	18.10.2019	EUR	2.570	GBP	2.281	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	18.10.2019	EUR	100	GBP	89	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								GBP 89.376
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income								
	18.10.2019	EUR	6.816	GBP	6.066	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31)
	18.10.2019	EUR	694.294	GBP	617.843	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.197)
	18.10.2019	EUR	353	GBP	313	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	6.249	EUR	7.054	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	18.10.2019	GBP	10.560	EUR	11.920	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	18.10.2019	GBP	3.196	EUR	3.589	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	18.10.2019	CHF	412.148	GBP	335.356	Absicherung	JP Morgan Chase New York	333
	18.10.2019	CHF	277.849	GBP	226.079	Absicherung	JP Morgan Chase New York	225
	18.10.2019	CHF	1.053	GBP	857	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	CHF	134.240	GBP	109.229	Absicherung	JP Morgan Chase New York	109
	18.10.2019	EUR	9.657	GBP	8.594	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
	18.10.2019	EUR	1.349.740	GBP	1.201.115	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.215)
	18.10.2019	EUR	1.218	GBP	1.084	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	18.10.2019	EUR	1.190	GBP	1.059	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	GBP	7	EUR	8	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income (Fortsetzung)								
	18.10.2019	GBP	49.490	USD	61.549	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(418)
	18.10.2019	GBP	22	USD	27	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	21	SGD	36	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	130	EUR	146	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	21	EUR	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	10.685	EUR	12.039	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27
	18.10.2019	SGD	1.740	GBP	1.016	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	18.10.2019	USD	169.272	GBP	135.689	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.566
	18.10.2019	USD	1.118	GBP	896	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	18.10.2019	USD	706.413	GBP	566.263	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.535
	18.10.2019	USD	3.051.677	GBP	2.446.233	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28.231
	18.10.2019	USD	11.607	GBP	9.286	Absicherung	JP Morgan Chase New York	125
	18.10.2019	USD	1.319	GBP	1.057	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	18.10.2019	USD	1.085	GBP	869	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	18.10.2019	USD	1.949	GBP	1.562	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	18.10.2019	USD	1.943	GBP	1.562	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	18.10.2019	USD	7.327	GBP	5.860	Absicherung	JP Morgan Chase New York	81
	18.10.2019	USD	5.777	GBP	4.663	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	18.10.2019	EUR	2.487.095	GBP	2.213.231	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11.451)
	18.10.2019	EUR	1.082	GBP	963	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	EUR	37.812	GBP	33.648	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(174)
								GBP 15.808
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha								
	18.10.2019	USD	21.725	EUR	19.797	Absicherung	JP Morgan Chase New York	111
	18.10.2019	USD	54.364	EUR	49.624	Absicherung	JP Morgan Chase New York	186
	18.10.2019	USD	22.260	EUR	20.309	Absicherung	JP Morgan Chase New York	86
	18.10.2019	EUR	1.093.260	USD	1.213.232	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19.623)
	18.10.2019	CHF	84.385	USD	85.625	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(862)
	18.10.2019	GBP	45.805	USD	57.142	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(652)
	18.10.2019	EUR	291.718	USD	323.731	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.236)
	18.10.2019	EUR	2.134.532	USD	2.368.772	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(38.313)
	18.10.2019	GBP	2.172.900	USD	2.710.693	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30.927)
	18.10.2019	GBP	135.509.466	USD	169.048.057	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.928.706)
	18.10.2019	GBP	203.210	USD	253.505	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.892)
	18.10.2019	EUR	979	USD	1.087	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	18.10.2019	EUR	500	USD	551	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	EUR	2.986	USD	3.289	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
	18.10.2019	USD	688	EUR	624	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
								USD (2.026.874)
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities								
	21.10.2019	EUR	550.138	AUD	888.094	Handel	Royal Bank of Scotland	1.212
	21.10.2019	EUR	4.140.213	CAD	6.057.422	Handel	Citigroup Global Markets	(50.703)
	18.10.2019	GBP	23.092	EUR	26.065	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	21.10.2019	USD	1.152.176	EUR	1.040.684	Handel	Royal Bank of Scotland	14.360
	18.10.2019	GBP	15.797	EUR	17.922	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(77)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities (Fortsetzung)								
	18.10.2019	USD	8.046.647	EUR	7.250.943	Absicherung	JP Morgan Chase New York	119.205
	18.10.2019	GBP	974.668	EUR	1.095.273	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.697
	18.10.2019	GBP	2.971.360	EUR	3.339.035	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17.366
	18.10.2019	GBP	993	EUR	1.116	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	18.10.2019	GBP	388.084	EUR	436.105	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.268
	18.10.2019	GBP	119.318.920	EUR	134.083.378	Absicherung	JP Morgan Chase New York	697.366
	18.10.2019	GBP	2.476.580	EUR	2.783.031	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14.475
	18.10.2019	GBP	99.341	EUR	112.073	Absicherung	JP Morgan Chase New York	141
	21.10.2019	EUR	133.916.866	GBP	119.000.000	Handel	Royal Bank of Scotland	(488.426)
	21.10.2019	EUR	135.757.067	GBP	120.619.787	Handel	Citigroup Global Markets	(477.690)
	21.10.2019	EUR	133.921.794	GBP	119.000.000	Handel	Barclays	(483.494)
	18.10.2019	EUR	20.863	GBP	18.500	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(34)
	18.10.2019	EUR	3.230	GBP	2.864	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	EUR	87	GBP	77	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	232.614	GBP	206.085	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(177)
	18.10.2019	EUR	55.466	GBP	49.127	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(27)
	18.10.2019	EUR	6.687	GBP	5.935	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	18.10.2019	EUR	19.039	GBP	16.898	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(49)
	18.10.2019	EUR	14.101	GBP	12.515	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(36)
	18.10.2019	EUR	74.803	GBP	66.549	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(370)
	18.10.2019	EUR	51.614	GBP	45.728	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(39)
	18.10.2019	EUR	5.965	GBP	5.258	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26
	18.10.2019	EUR	30.137	GBP	26.565	Absicherung	JP Morgan Chase New York	130
	18.10.2019	EUR	35.949	GBP	31.827	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	18.10.2019	EUR	11.000	GBP	9.739	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	EUR	563.995	GBP	497.459	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.076
	18.10.2019	EUR	34.791	GBP	30.984	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(209)
	18.10.2019	EUR	26.949	GBP	24.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(162)
	18.10.2019	EUR	11.198	GBP	9.972	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(67)
	18.10.2019	EUR	85.094	GBP	75.427	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(107)
	18.10.2019	EUR	251.683	GBP	223.091	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(317)
	21.10.2019	EUR	128.468.824	USD	141.854.427	Handel	Barclays	(1.429.326)
	21.10.2019	EUR	127.693.564	USD	140.999.999	Handel	Goldman Sachs	(1.422.176)
	21.10.2019	EUR	127.696.687	USD	141.000.000	Handel	Citigroup Global Markets	(1.419.048)
	21.10.2019	EUR	1.323.650	USD	1.467.164	Handel	Royal Bank of Scotland	(19.862)
	21.10.2019	EUR	1.170.724	USD	1.289.682	Handel	Barclays	(10.251)
								EUR (4.928.324)
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities								
	21.10.2019	CAD	9.252	EUR	6.306	Handel	Barclays	95
	18.10.2019	CHF	1.884	EUR	1.723	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	18.10.2019	CHF	202.328	EUR	185.001	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.147
	21.10.2019	EUR	78.704	GBP	69.630	Handel	Barclays	60
	21.10.2019	EUR	103.863	USD	114.415	Handel	Citigroup Global Markets	(908)
	21.10.2019	EUR	349.567	GBP	310.970	Handel	Barclays	(1.661)
	21.10.2019	EUR	1.675.665	USD	1.833.230	Handel	Barclays	(3.024)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities (Fortsetzung)								
	21.10.2019	EUR	553.177	CAD	809.336	Handel	Citigroup Global Markets	(6.775)
	21.10.2019	EUR	15.675.111	GBP	13.938.488	Handel	Barclays	(67.809)
	21.10.2019	EUR	17.776.429	USD	19.622.379	Handel	Barclays	(192.057)
	21.10.2019	EUR	112.715	GBP	100.000	Handel	JPMorgan	(230)
	21.10.2019	EUR	45.147	USD	50.000	Handel	Barclays	(639)
	21.10.2019	EUR	180.419	USD	200.000	Handel	Barclays	(2.725)
	18.10.2019	GBP	40.140.628	EUR	45.107.607	Absicherung	JP Morgan Chase New York	234.605
	18.10.2019	GBP	1.447	EUR	1.626	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	18.10.2019	GBP	1.444	EUR	1.623	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	21.10.2019	GBP	74.799	EUR	84.227	Handel	JP Morgan	255
	18.10.2019	GBP	1.449	EUR	1.629	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	18.10.2019	GBP	1.445	EUR	1.623	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	18.10.2019	NOK	10.016	EUR	1.010	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	SEK	9.983	EUR	937	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	USD	1.044	EUR	941	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	18.10.2019	USD	9.134.471	EUR	8.231.196	Absicherung	JP Morgan Chase New York	135.321
	18.10.2019	USD	1.050	EUR	946	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
	18.10.2019	USD	1.048	EUR	944	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
	18.10.2019	USD	1.051	EUR	947	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
								EUR 95.756
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha								
	18.10.2019	CHF	1.133	EUR	1.036	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	18.10.2019	EUR	1.082	GBP	959	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	GBP	1.157.897	EUR	1.301.174	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.767
	18.10.2019	GBP	59.489.538	EUR	66.850.740	Absicherung	JP Morgan Chase New York	347.690
	18.10.2019	GBP	2.393	EUR	2.690	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
	18.10.2019	GBP	23.624	EUR	26.782	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(96)
	18.10.2019	GBP	1.229.306	EUR	1.393.602	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.998)
	18.10.2019	GBP	2.311.686	EUR	2.609.963	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.281
	18.10.2019	GBP	1.161.485	EUR	1.305.548	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.447
	18.10.2019	USD	2.429	EUR	2.189	Absicherung	JP Morgan Chase New York	36
								EUR 357.146
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha								
	18.10.2019	GBP	14.574	EUR	16.382	Absicherung	JP Morgan Chase New York	72
	18.10.2019	GBP	6.255	EUR	7.023	Absicherung	JP Morgan Chase New York	37
	18.10.2019	GBP	95.064	EUR	107.248	Absicherung	JP Morgan Chase New York	120
	18.10.2019	GBP	8.330	EUR	9.403	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	18.10.2019	CHF	1.031	GBP	839	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	CHF	99.106	GBP	80.640	Absicherung	JP Morgan Chase New York	80
	18.10.2019	EUR	2.740.678	GBP	2.438.890	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12.619)
	18.10.2019	EUR	7	GBP	7	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	1.031	GBP	917	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	EUR	1.032	GBP	918	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha								
<i>(Fortsetzung)</i>	18.10.2019	EUR	1.025	GBP	912	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	EUR	1.028	GBP	915	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	EUR	284	GBP	253	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	18.10.2019	EUR	4.378.678	GBP	3.896.523	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20.160)
	18.10.2019	EUR	208.388	GBP	185.442	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(959)
	18.10.2019	GBP	1.006	EUR	1.135	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	GBP	1.631	EUR	1.841	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	GBP	14.357	EUR	16.288	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(62)
	18.10.2019	GBP	3.976	EUR	4.491	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	1	EUR	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	GBP	29.118	EUR	32.876	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
	18.10.2019	GBP	52.808	EUR	59.622	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26
								GBP (33.464)
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha								
	18.10.2019	EUR	2.859	USD	3.173	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(51)
	18.10.2019	EUR	1.076	USD	1.194	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	18.10.2019	USD	5.232	EUR	4.723	Absicherung	JP Morgan Chase New York	75
	18.10.2019	USD	74.684	EUR	67.780	Absicherung	JP Morgan Chase New York	682
	18.10.2019	USD	63	EUR	58	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	USD	24	EUR	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	1	EUR	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	4.007	EUR	3.635	Absicherung	JP Morgan Chase New York	38
	18.10.2019	USD	4	EUR	4	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	3.382.714	USD	3.753.924	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(60.716)
								USD (59.990)
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha								
	18.10.2019	EUR	136.989	USD	152.022	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.460)
	18.10.2019	EUR	1.136	USD	1.261	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
	18.10.2019	EUR	25	USD	28	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	EUR	226.746	USD	249.741	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.183)
	18.10.2019	USD	150.464	EUR	135.882	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.107
	18.10.2019	USD	6.090	EUR	5.559	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
	18.10.2019	USD	28	EUR	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								USD (2.535)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities								
	18.10.2019	USD	3.983	EUR	3.631	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	18.10.2019	USD	180	EUR	164	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	18.10.2019	USD	539	EUR	492	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	18.10.2019	USD	42.378	EUR	38.146	Absicherung	JP Morgan Chase New York	730
	18.10.2019	USD	48.717	EUR	43.971	Absicherung	JP Morgan Chase New York	709
	18.10.2019	USD	36.547	EUR	32.987	Absicherung	JP Morgan Chase New York	532
	18.10.2019	USD	95.433	EUR	86.136	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.389
	18.10.2019	USD	14.281	GBP	11.425	Absicherung	JP Morgan Chase New York	190
	18.10.2019	USD	623	GBP	498	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	18.10.2019	USD	81.801	GBP	65.424	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.115
	18.10.2019	USD	46.767	GBP	37.404	Absicherung	JP Morgan Chase New York	637
	18.10.2019	USD	0**	GBP	0**	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	1.486	GBP	1.195	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	18.10.2019	USD	44.174	GBP	35.367	Absicherung	JP Morgan Chase New York	556
	18.10.2019	USD	4.144	GBP	3.352	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	18.10.2019	USD	921.493	GBP	745.339	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.289
	18.10.2019	USD	8.253	GBP	6.676	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	18.10.2019	USD	227	GBP	184	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	91	GBP	74	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	18.10.2019	USD	525	GBP	426	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	USD	440	GBP	353	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	18.10.2019	USD	73.948	GBP	59.460	Absicherung	JP Morgan Chase New York	618
	18.10.2019	USD	7.928	GBP	6.343	Absicherung	JP Morgan Chase New York	106
	18.10.2019	USD	1.597.255	GBP	1.277.876	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21.277
	18.10.2019	USD	8.280	SGD	11.384	Absicherung	JP Morgan Chase New York	47
	18.10.2019	USD	1.663	SGD	2.287	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	18.10.2019	USD	3.645	SGD	5.007	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24
	18.10.2019	SGD	3.422.095	USD	2.477.488	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.379)
	18.10.2019	EUR	9.129	USD	10.006	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(39)
	18.10.2019	SGD	779.260	USD	564.779	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.162)
	18.10.2019	EUR	2.392.081	USD	2.654.583	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42.935)
	18.10.2019	CHF	896.877	USD	910.054	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9.160)
	18.10.2019	GBP	344.109	USD	429.276	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.898)
	18.10.2019	EUR	1.831.960	USD	2.032.995	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(32.882)
	18.10.2019	EUR	4.687.490	USD	5.201.886	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(84.136)
	18.10.2019	CHF	218.732	USD	221.946	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.234)
	18.10.2019	GBP	69.491.641	USD	86.690.822	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(989.074)
	18.10.2019	SGD	616.976	USD	449.442	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.200)
	18.10.2019	GBP	620.727	USD	774.357	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.835)
	18.10.2019	EUR	326.784	USD	362.645	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.865)
	18.10.2019	CHF	31.586	USD	32.050	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(323)
	18.10.2019	EUR	6.996	USD	7.772	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(134)
	18.10.2019	EUR	78.278	USD	86.296	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(834)
	18.10.2019	CHF	29.260	USD	29.538	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(147)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (Fortsetzung)								
	18.10.2019	GBP	11.240	USD	13.984	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(122)
	18.10.2019	EUR	58.610	USD	64.614	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(624)
	18.10.2019	EUR	154.042	USD	169.822	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.641)
	18.10.2019	CHF	7.155	USD	7.223	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(36)
	18.10.2019	USD	57.206	EUR	52.155	Absicherung	JP Morgan Chase New York	263
	18.10.2019	USD	22.189	EUR	20.230	Absicherung	JP Morgan Chase New York	102
	18.10.2019	USD	29.744	EUR	27.118	Absicherung	JP Morgan Chase New York	137
	18.10.2019	USD	4.267	EUR	3.873	Absicherung	JP Morgan Chase New York	38
	18.10.2019	USD	2.450	CHF	2.427	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	18.10.2019	USD	10.262	CHF	10.163	Absicherung	JP Morgan Chase New York	53
	18.10.2019	USD	21.572	EUR	19.586	Absicherung	JP Morgan Chase New York	188
	18.10.2019	USD	9.520	EUR	8.594	Absicherung	JP Morgan Chase New York	137
	18.10.2019	USD	588	CHF	583	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	18.10.2019	USD	6.644	EUR	5.996	Absicherung	JP Morgan Chase New York	97
	18.10.2019	USD	4.073	CHF	4.039	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	18.10.2019	USD	16.738	CHF	16.600	Absicherung	JP Morgan Chase New York	63
	18.10.2019	USD	354	CHF	351	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	18.10.2019	SGD	20.084	USD	14.597	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(71)
	18.10.2019	SGD	798.350	USD	579.305	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.880)
	18.10.2019	SGD	179.992	USD	130.778	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(594)
	18.10.2019	GBP	20.325	USD	25.286	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(220)
	18.10.2019	GBP	2.275.946	USD	2.831.524	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24.676)
	18.10.2019	GBP	235	USD	295	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	18.10.2019	GBP	100	USD	125	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	18.10.2019	GBP	444	USD	556	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	18.10.2019	EUR	750	USD	826	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	18.10.2019	EUR	10.721	USD	11.819	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(114)
	18.10.2019	EUR	98	USD	108	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	18.10.2019	EUR	3.004	USD	3.309	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
	18.10.2019	EUR	1.568	USD	1.737	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(25)
	18.10.2019	EUR	200	USD	222	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	18.10.2019	EUR	245	USD	272	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	18.10.2019	CHF	731	USD	738	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	18.10.2019	CHF	1.033	USD	1.043	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	18.10.2019	CHF	309	USD	311	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
								USD (1.186.893)

*Siehe Erläuterung 1.

**Bruchbetrag gerundet auf 0.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 24	Kauf	EUR	750.000	20.06.2021	(11.887)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Metro AG	Kauf	EUR	100.000	20.06.2021	(1.181)	0,00
CDS	JPMorgan	RWE Finance II	Kauf	EUR	260.000	20.06.2021	(4.623)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	55.000	20.06.2022	(2.624)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	55.000	20.06.2022	(2.624)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	60.000	20.06.2022	(2.862)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	80.000	20.06.2022	(3.816)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	580.000	20.12.2023	(29.753)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	200.000	20.12.2023	(10.260)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Innogy SE	Kauf	EUR	50.000	20.06.2021	(889)	0,00
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Kauf	EUR	4.200.000	20.12.2024	(593.545)	(0,27)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Kauf	EUR	1.650.000	20.12.2024	(65.751)	(0,03)
CDS	JPMorgan	BBVA SA	Kauf	EUR	1.200.000	20.12.2024	(15.094)	(0,01)
CDS	JPMorgan	EDF	Kauf	EUR	1.500.000	20.12.2024	(36.824)	(0,02)
CDS	Barclays	PostNL NV	Kauf	EUR	50.000	20.12.2020	(586)	0,00
CDS	Barclays	Metro AG	Kauf	EUR	75.000	20.06.2021	(886)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	74.000	20.06.2022	(4.253)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	150.000	20.06.2022	(8.622)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	295.000	20.06.2022	(16.956)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	185.000	20.06.2022	(10.633)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	146.000	20.06.2022	(8.392)	0,00
CDS	Barclays	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	10.050.000	20.12.2024	(115.838)	(0,05)
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Series 32	Kauf	EUR	2.500.000	20.12.2024	(63.762)	(0,03)
CDS	Barclays	Veolia Environnment	Kauf	EUR	1.600.000	20.12.2024	(59.610)	(0,03)
CDS	Barclays	SSE Plc	Kauf	EUR	1.400.000	20.12.2024	(22.791)	(0,01)
CDS	Barclays	Auchan	Kauf	EUR	800.000	20.12.2024	34.865	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Kauf	EUR	80.000	20.12.2020	(937)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Pearson plc	Kauf	EUR	225.000	20.09.2020	(2.201)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Metro AG	Kauf	EUR	165.000	20.06.2021	(1.949)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Deutsche Bank AG	Kauf	EUR	3.300.000	20.09.2024	416.055	0,19
CDS	Goldman Sachs	PostNL NV	Kauf	EUR	58.000	20.12.2020	(679)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Tesco plc	Kauf	EUR	200.000	20.06.2021	(2.652)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	50.000	20.12.2023	(2.385)	0,00
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	4.050.000	20.12.2024	(46.681)	(0,02)
							USD (700.626)	(0,32)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Series 32	Kauf	EUR	17.000.000	20.12.2024	(397.707)	(0,30)
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Kauf	EUR	4.200.000	20.12.2024	(544.437)	(0,40)
							EUR (942.144)	(0,70)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond* die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 31	Verkauf	EUR	1.000.000	20.06.2022	69.243	0,18
CDS	Goldman Sachs	Cellnex Telecom SA	Verkauf	EUR	300.000	20.06.2022	34.639	0,09
							EUR 103.882	0,27

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	61.000	20.06.2022	(3.216)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	120.000	20.06.2022	(6.327)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	245.000	20.06.2022	(12.917)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	150.000	20.06.2022	(7.908)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	124.000	20.06.2022	(6.538)	0,00
CDS	Barclays	ITRAXX Finsub 32	Kauf	EUR	5.100.000	20.12.2024	104.680	0,08
CDS	Barclays	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	7.730.000	20.12.2024	(81.725)	(0,06)
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Series 32	Kauf	EUR	6.500.000	20.12.2024	(152.065)	(0,11)
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Series 32	Kauf	EUR	7.000.000	20.12.2024	(163.762)	(0,12)
CDS	Barclays	Veolia Environnment	Kauf	EUR	1.250.000	20.12.2024	(42.717)	(0,03)
CDS	Barclays	SSE Plc	Kauf	EUR	970.000	20.12.2024	(14.485)	(0,01)
CDS	Barclays	Auchan	Kauf	EUR	580.000	20.12.2024	23.186	0,02
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	165.000	20.06.2022	(7.220)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	165.000	20.06.2022	(7.220)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	165.000	20.06.2022	(7.220)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	235.000	20.06.2022	(10.283)	(0,01)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Kauf	USD	800.000	20.06.2023	(106.854)	(0,08)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	325.000	20.12.2023	(15.292)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Novafives SAS	Kauf	EUR	500.000	20.12.2024	55.313	0,04
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Kauf	EUR	11.400.000	20.12.2024	(1.477.757)	(1,11)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Kauf	EUR	1.330.000	20.12.2024	(48.614)	(0,04)
CDS	JPMorgan	BBVA SA	Kauf	EUR	800.000	20.12.2024	(9.230)	(0,01)
CDS	JPMorgan	EDF	Kauf	EUR	1.000.000	20.12.2024	(22.518)	(0,02)
CDS	Citigroup Global Markets	Deutsche Bank AG	Kauf	EUR	2.200.000	20.12.2024	254.421	0,19
CDS	Citigroup Global Markets	Daimler AG	Kauf	EUR	650.000	20.12.2024	(11.141)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	3.120.000	20.12.2024	(32.986)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	7.250.000	20.12.2024	(76.651)	(0,06)
							EUR (1.887.046)	(1,42)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return den folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakt:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Verkauf	EUR	3.370.000	20.12.2024	476.249	0,84
							USD 476.249	0,84

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Bank of America Merrill Lynch	Nordamerika Aktienkorb	Zahlung von US-1M- LIBOR +0,30 % und Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 4 Aktien.	USD	8.977.314	22.03.2021	(40.631)	(0,02)
TRS	Bank of America Merrill Lynch	Nordamerika Aktienkorb	Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 33 Aktien und Erhalt des US-1M-LIBOR.	USD	33.630.374	22.03.2021	121.081	0,07
							USD 80.450	0,05

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Kauf	EUR	300.000	20.12.2020	(3.223)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Kauf	EUR	100.000	20.12.2020	(1.074)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Pearson plc	Kauf	EUR	200.000	20.09.2020	(1.795)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Pearson plc	Kauf	EUR	300.000	20.09.2020	(2.692)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	ING Bank NV	Verkauf	EUR	300.000	20.06.2020	1.839	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Pearson plc	Kauf	EUR	1.000.000	20.09.2020	(8.973)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Kauf	EUR	700.000	20.12.2020	(7.520)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	ING Bank NV	Verkauf	EUR	500.000	20.06.2020	3.064	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Pearson plc	Kauf	EUR	17.725.000	20.09.2020	(159.038)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV	Kauf	EUR	5.150.000	20.12.2020	(55.323)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Metro AG	Kauf	EUR	10.680.000	20.06.2021	(115.716)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	ING Bank NV	Verkauf	EUR	9.200.000	20.06.2020	56.386	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Iceland Bondco plc	Kauf	EUR	9.000.000	20.12.2024	369.476	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	Deutsche Bank AG	Kauf	EUR	24.780.000	20.12.2024	2.865.710	0,17

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	12.220.000	20.12.2024	(113.833)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	Daimler AG	Kauf	EUR	33.320.000	20.12.2024	(571.077)	(0,03)
CDS	Barclays	ITRAXX FINSR 25	Kauf	EUR	900.000	20.06.2021	(13.084)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	400.000	20.06.2022	(21.089)	0,00
CDS	Barclays	ITRAXX FINSR 25	Kauf	EUR	500.000	20.06.2021	(7.269)	0,00
CDS	Barclays	Innogy SE	Kauf	EUR	700.000	20.03.2020	(3.208)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	100.000	20.06.2022	(5.272)	0,00
CDS	Barclays	Tesco plc	Kauf	EUR	300.000	20.06.2020	(1.965)	0,00
CDS	Barclays	Tesco plc	Kauf	EUR	600.000	20.06.2020	(3.930)	0,00
CDS	Barclays	Innogy SE	Kauf	EUR	1.400.000	20.03.2020	(6.415)	0,00
CDS	Barclays	ITRAXX FINSR 25	Kauf	EUR	2.900.000	20.06.2021	(42.161)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	1.000.000	20.06.2022	(52.723)	0,00
CDS	Barclays	RWE Finance II	Kauf	EUR	25.300.000	20.03.2020	(115.930)	(0,01)
CDS	Barclays	PostNL NV	Kauf	EUR	3.370.000	20.12.2020	(36.202)	0,00
CDS	Barclays	Metro AG	Kauf	EUR	3.850.000	20.06.2021	(41.714)	0,00
CDS	Barclays	ITRAXX Europe SNR FIN	Kauf	EUR	52.000.000	20.06.2021	(755.983)	(0,04)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	2.855.000	20.06.2022	(150.524)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	5.810.000	20.06.2022	(306.320)	(0,02)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	3.645.000	20.06.2022	(192.175)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	1.477.000	20.06.2022	(77.872)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	2.853.000	20.06.2022	(150.418)	(0,01)
CDS	Barclays	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	65.440.000	20.12.2024	(691.863)	(0,04)
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Series 32	Kauf	EUR	15.000.000	20.12.2024	(350.918)	(0,02)
CDS	Barclays	NA IG 33	Kauf	USD	150.000.000	20.12.2024	(2.703.683)	(0,16)
CDS	Barclays	Veolia Environnement	Kauf	EUR	17.000.000	20.12.2024	(580.958)	(0,03)
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Kauf	EUR	300.000	20.03.2020	(1.309)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	500.000	20.06.2022	(21.879)	0,00
CDS	JPMorgan	Naturgy Energy Group	Kauf	EUR	500.000	20.03.2020	(2.264)	0,00
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Kauf	USD	600.000	20.12.2022	(73.154)	0,00
CDS	JPMorgan	Matalan Finance Plc	Kauf	EUR	100.000	20.06.2023	9.913	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	900.000	20.06.2022	(39.383)	0,00
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Kauf	USD	1.200.000	20.12.2022	(146.309)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Matalan Finance Plc	Kauf	EUR	400.000	20.06.2023	39.651	0,00
CDS	JPMorgan	Naturgy Energy Group	Kauf	EUR	1.100.000	20.03.2020	(4.981)	0,00
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Kauf	EUR	800.000	20.03.2020	(3.491)	0,00
CDS	JPMorgan	Gas Natural Capital	Kauf	EUR	19.500.000	20.03.2020	(88.305)	(0,01)
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Kauf	EUR	13.750.000	20.03.2020	(60.004)	0,00
CDS	JPMorgan	Metro AG	Kauf	EUR	7.650.000	20.06.2021	(82.886)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	3.765.000	20.06.2022	(164.753)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	3.765.000	20.06.2022	(164.753)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	3.765.000	20.06.2022	(164.753)	(0,01)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	5.185.000	20.06.2022	(226.890)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Matalan Finance Plc	Kauf	EUR	2.800.000	20.06.2023	277.554	0,02
CDS	JPMorgan	Matalan Finance Plc	Kauf	EUR	3.200.000	20.06.2023	317.204	0,02
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Kauf	USD	21.150.000	20.12.2022	(2.578.688)	(0,15)
CDS	JPMorgan	Selecta Group	Kauf	EUR	9.000.000	20.06.2024	(1.129.902)	(0,07)
CDS	JPMorgan	ITRAXX FINSR 32	Kauf	EUR	27.000.000	20.12.2024	(500.170)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Novafives SAS	Kauf	EUR	9.600.000	20.12.2024	1.062.015	0,06
CDS	JPMorgan	TDC A/S	Kauf	EUR	17.000.000	20.12.2024	436.814	0,03
CDS	JPMorgan	ITRAXX FINSR 32	Kauf	EUR	68.500.000	20.12.2024	(8.879.502)	(0,53)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Kauf	EUR	18.560.000	20.12.2024	(678.409)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Lafargeholcim	Verkauf	EUR	8.750.000	20.12.2024	130.604	0,01
CDS	JPMorgan	Heidelbergcement	Kauf	EUR	7.240.000	20.12.2024	(1.601.292)	(0,09)
CDS	JPMorgan	Westpac banking Corp.	Kauf	USD	23.030.000	20.12.2024	(667.290)	(0,04)
CDS	JPMorgan	BHP Billiton	Kauf	USD	12.080.000	20.12.2024	(328.309)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Banco bilbao Vizcaya Argentaria	Kauf	EUR	9.700.000	20.12.2024	(111.918)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Crédit Agricole SA	Kauf	EUR	8.550.000	20.12.2024	(23.802)	0,00
CDS	JPMorgan	BNP Paribas	Kauf	EUR	8.590.000	20.12.2024	20.984	0,00
CDS	JPMorgan	EDF	Kauf	EUR	10.050.000	20.12.2024	(226.308)	(0,01)
CDS	Credit Suisse	Rexel SA	Kauf	EUR	7.000.000	20.12.2024	(1.391.513)	(0,08)
CDS	Goldman Sachs	Vattenfall AB	Kauf	EUR	200.000	20.06.2021	(3.155)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Pernod-Ricard SA	Kauf	EUR	1.600.000	20.12.2019	(3.474)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Pernod-Ricard SA	Kauf	EUR	800.000	20.12.2019	(1.737)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Vattenfall AB	Kauf	EUR	400.000	20.06.2021	(6.309)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Pernod-Ricard SA	Kauf	EUR	29.500.000	20.12.2019	(64.056)	0,00
CDS	Goldman Sachs	PostNL NV	Kauf	EUR	3.595.000	20.12.2020	(38.619)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Vattenfall AB	Kauf	EUR	7.800.000	20.06.2021	(123.027)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Arcelormittal	Kauf	EUR	7.500.000	20.12.2023	(1.160.959)	(0,07)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	26.360.000	20.12.2024	(278.690)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	BMW AG	Kauf	EUR	14.480.000	20.12.2024	(320.232)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Kauf	EUR	13.660.000	20.12.2024	39.771	0,00
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Kauf	EUR	10.490.000	20.12.2024	391.423	0,02
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Kauf	EUR	9.830.000	20.12.2024	(40.134)	0,00
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Kauf	EUR	4.115.000	20.12.2024	(88.348)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	BMW AG	Kauf	EUR	8.300.000	20.12.2024	(183.558)	(0,01)
							EUR (23.004.047)	(1,36)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Kauf	EUR	60.000	20.06.2023	(558)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(1.266)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(1.500)	0,00
CDS	JPMorgan	Pearson plc	Kauf	EUR	40.000	20.06.2023	(906)	0,00
CDS	JPMorgan	Banca Popolare Di Milano	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(1.500)	0,00

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(1.266)	0,00
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Kauf	EUR	80.000	20.12.2023	(1.706)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	145.000	20.12.2023	(6.823)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Kauf	EUR	260.000	20.12.2023	(1.416)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	250.000	20.12.2023	(11.763)	(0,01)
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 32	Kauf	EUR	3.500.000	20.12.2024	(453.697)	(0,52)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Kauf	EUR	850.000	20.12.2024	(31.069)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Naturgy Energy Group	Kauf	EUR	800.000	20.12.2024	(20.548)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Lafargeholcim	Verkauf	EUR	800.000	20.12.2024	11.941	0,0100
CDS	JPMorgan	Heidelbergcement AG	Kauf	EUR	800.000	20.12.2024	(176.938)	(0,20)
CDS	JPMorgan	Westpac banking Corp.	Kauf	USD	1.700.000	20.12.2024	(49.257)	(0,06)
CDS	JPMorgan	Banco bilbao Vizcaya Argentaria	Kauf	EUR	650.000	20.12.2024	(7.500)	(0,01)
CDS	JPMorgan	BHP Group Ltd.	Kauf	USD	820.000	20.12.2024	(22.286)	(0,03)
CDS	JPMorgan	BNP Paribas SA	Kauf	EUR	310.000	20.12.2024	757	0,00
CDS	JPMorgan	Crédit Agricole	Kauf	EUR	750.000	20.12.2024	(2.088)	0,00
CDS	Barclays	Tesco plc	Kauf	EUR	100.000	20.12.2023	(545)	0,00
CDS	Barclays	Credit Suisse group AG	Kauf	EUR	400.000	20.06.2024	(4.058)	0,00
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Finsub Series 32	Kauf	EUR	2.700.000	20.12.2024	55.419	0,06
CDS	Barclays	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	4.990.000	20.12.2024	(52.757)	(0,06)
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Series 32	Kauf	EUR	6.800.000	20.12.2024	(159.083)	(0,18)
CDS	Barclays	Veolia Environment	Kauf	EUR	830.000	20.12.2024	(28.364)	(0,03)
CDS	Barclays	SSE plc	Kauf	EUR	960.000	20.12.2024	(14.335)	(0,02)
CDS	Barclays	Auchan	Kauf	EUR	370.000	20.12.2024	14.791	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Kauf	EUR	60.000	20.06.2023	(558)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Kauf	EUR	80.000	20.06.2023	(744)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Deutsche Bank AG	Kauf	EUR	1.400.000	20.12.2024	161.905	0,18
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	930.000	20.12.2024	(8.663)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	General Motors Company	Kauf	USD	1.150.000	20.12.2024	(181.365)	(0,21)
CDS	Citigroup Global Markets	Daimler AG	Verkauf	EUR	1.710.000	20.12.2024	(29.308)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	EDF	Kauf	EUR	750.000	20.12.2024	(16.889)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	2.010.000	20.12.2024	(21.251)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Asia XJ IG 32	Kauf	USD	4.750.000	20.12.2024	(50.219)	(0,06)
CDS	Goldman Sachs	Fortum OYJ	Kauf	EUR	850.000	20.12.2024	(22.339)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	BMW AG	Kauf	EUR	850.000	20.12.2024	(18.798)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings plc	Kauf	EUR	940.000	20.12.2024	2.737	0,00
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings plc	Kauf	EUR	735.000	20.12.2024	(15.780)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Kauf	EUR	750.000	20.12.2024	(3.062)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Kauf	EUR	990.000	20.12.2024	36.941	0,04
CDS	Goldman Sachs	BMW AG	Kauf	EUR	430.000	20.12.2024	(9.510)	(0,01)
							EUR (1.145.224)	(1,30)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 4 Aktien und Erhalt des 1M-TOIS -0,35 %.	CHF	5.598.363	vom 29.12.2027 bis 28.09.2029	(79.024)	(0,08)
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 5 Aktien und Erhalt des DKDRA -0,35 %.	DKK	55.214.130	vom 18.08.2027 bis 31.08.2029	67.331	0,06
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 26 Aktien und Erhalt des 1M-EONIA von -0,35 % bis -0,45 %.	EUR	30.771.911	vom 17.03.2027 bis 03.10.2029	(390.210)	(0,38)
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 7 Aktien und Erhalt des 1M-SONIA -0,35 %.	GBP	6.049.116	vom 19.05.2027 bis 24.09.2029	16.262	0,02
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien und Erhalt des NKDRA -0,35 %.	NOK	22.486.542	vom 04.04.2029 bis 15.08.2029	17.520	0,02
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 4 Aktien und Erhalt des 1M-STIBOR -0,35 %.	SEK	39.364.513	vom 24.02.2027 bis 19.07.2029	(49.310)	(0,05)
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 5 Aktien und Erhalt des 1M-LIBOR von -0,80 % bis -0,35 %.	USD	5.170.100	vom 16.08.2028 bis 01.10.2029	38.287	0,04
							EUR (379.144)	(0,37)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha den folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakt:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 24 Aktien und Erhalt des 1M-LIBOR.	GBP	2.101.396	vom 24.01.2022 bis 03.06.2022	(33.518)	(0,34)
							GBP (33.518)	(0,34)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
TRS	Bank of America Merrill Lynch	Nordamerika Aktienkorb	Zahlung von US-1M-LIBOR +0,30 % und Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 16 Aktien.	USD	22.801.395	27.07.2020	(96.214)	(0,09)
TRS	Bank of America Merrill Lynch	Nordamerika Aktienkorb	Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 33 Aktien und Erhalt des US-1M-LIBOR.	USD	21.397.420	27.07.2020	74.502	0,07
							USD (21.712)	(0,02)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Performance der zugrunde liegenden Aktie und Erhalt des AUD-1M-LIBOR.	AUD	2.965.110	24.01.2022	(33.294)	(0,02)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von DKDRA +0,30 % und Erhalt der Performance der zugrunde liegenden Aktie.	DKK	2.209.121	24.01.2022	(2.635)	0,00
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von 1M-EURIBOR +0,35 % und Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien. Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien und Erhalt des 1M-EONIA.	EUR	5.537.063	24.01.2022	(221.619)	(0,12)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von 1M-LIBOR und Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien. Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 4 Aktien und Erhalt des 1M-LIBOR.	GBP	9.666.698	24.01.2022	(366.621)	(0,20)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von HIBOR +0,40 % und Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien.	HKD	19.594.680	24.01.2022	(100.690)	(0,06)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von JPY-1M-LIBOR und Erhalt der Performance der zugrunde liegenden Aktie.	JPY	261.201.920	24.01.2022	(55.465)	(0,03)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von US-1M-LIBOR +0,35 % und Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 23 Aktien. Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 15 Aktien und Erhalt des US-1M-LIBOR.	USD	83.977.052	24.01.2022	(926.135)	(0,52)
							USD (1.706.459)	(0,95)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
TRS	Citigroup	Nordamerika Rohstoffkorb	Zahlung von 0,11 % und Erhalt der Performance des BCOM BBG COMDTY Index.	USD	32.810.525	30.09.2019	330.345	0,08
TRS	Credit Suisse	Nordamerika Rohstoffkorb	Zahlung von 0 % bis 0,25 % und Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 3 Indizes. Zahlung der Performance der zugrunde liegenden 2 Indizes.	USD	115.463.987	30.09.2019	292.965	0,08
TRS	Goldman Sachs	Nordamerika Rohstoffkorb	Zahlung von 0,11 % und Erhalt der Performance der zugrunde liegenden 2 Indizes.	USD	106.802.758	30.09.2019	970.598	0,25
TRS	JPMorgan	Nordamerika Rohstoffkorb	Zahlung von 0 % bis 0,25 % und Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 19 Indizes. Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 20 Indizes.	USD	1.420.093.770	30.09.2019	2.007.662	0,52
TRS	Macquarie	Nordamerika Rohstoffkorb	Zahlung von 0 bis 0,17 % und Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 3 Indizes. Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 3 Indizes.	USD	158.240.692	30.09.2019	1.513.161	0,39
							USD 5.114.731	1,32

*Siehe Erläuterung 1.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS FUTURES

Zum 30. September 2019 ist die Gegenpartei von ausstehenden Terminkontrakten UBS.

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bund Future	Verkauf	(81)	EUR	(15.387.355)	06.12.2019	85.461	0,04
Euro-Bobl Future	Verkauf	(187)	EUR	(27.654.614)	06.12.2019	119.006	0,05
Euro-Buxl Future	Verkauf	(2)	EUR	(474.237)	06.12.2019	5.138	0,00
10-Year Australian Treasury Bond Future	Kauf	4	AUD	397.519	16.12.2019	4.076	0,00
10 Year Government of Canada Bond Future (MSE)	Kauf	35	CAD	3.769.637	18.12.2019	(31.986)	(0,01)
10-Year US Treasury Note Future	Kauf	16	USD	2.085.000	19.12.2019	5.719	0,00
US Ultra Bond	Verkauf	(7)	USD	(1.343.344)	19.12.2019	(1.750)	0,00
20-Year US Long Bond	Verkauf	(8)	USD	(1.298.500)	19.12.2019	(945)	0,00
10-Year US Treasury Ultra Future	Kauf	2	USD	284.813	19.12.2019	(750)	0,00
Long Gilt Future	Verkauf	(100)	GBP	(16.542.395)	27.12.2019	(158.720)	(0,07)
5-Year US Treasury Note Future	Kauf	56	USD	6.672.313	31.12.2019	(7.875)	0,00
2-Year US Treasury Note Future	Kauf	78	USD	16.809.000	31.12.2019	(12.188)	(0,01)
						USD 5.186	0,00

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bund Future	Verkauf	(18)	EUR	(3.136.500)	06.12.2019	(2.400)	0,00
Euro-Bobl Future	Verkauf	(79)	EUR	(10.716.350)	06.12.2019	35.811	0,02
Euro-OAT Future	Verkauf	(15)	EUR	(2.554.650)	06.12.2019	12.900	0,01
Euro-Buxl Future	Verkauf	(1)	EUR	(217.500)	06.12.2019	2.357	0,00
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(5)	USD	(597.654)	19.12.2019	(5.733)	0,00
20-Year US Long Bond	Verkauf	(3)	USD	(446.650)	19.12.2019	709	0,00
10-Year US Treasury Ultra Future	Verkauf	(7)	USD	(914.368)	19.12.2019	1.480	0,00
Long Gilt Future	Verkauf	(11)	GBP	(1.669.110)	27.12.2019	(15.791)	(0,01)
5-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(21)	USD	(2.295.099)	31.12.2019	2.558	0,00
						EUR 31.891	0,02

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS FUTURES

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond den folgenden ausstehenden Terminkontrakt:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Long Gilt Future	Verkauf	(50)	GBP	(7.586.862)	27.12.2019	5.652	0,00
						EUR 5.652	0,00

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - European Social Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bobl Future	Verkauf	(46)	EUR	(6.239.900)	06.12.2019	15.820	0,02
Mid-Term Euro-BTP Future	Verkauf	(3)	EUR	(437.520)	06.12.2019	(750)	0,00
Short-Term Euro-BTP Future	Verkauf	(6)	EUR	(676.140)	06.12.2019	(480)	0,00
Long Gilt Future	Verkauf	(26)	GBP	(3.945.168)	27.12.2019	(36.781)	(0,05)
						EUR (22.191)	(0,03)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bund Future	Verkauf	(131)	EUR	(22.826.750)	06.12.2019	116.980	0,09
Euro-Bobl Future	Verkauf	(283)	EUR	(38.388.950)	06.12.2019	157.510	0,12
Euro-OAT Future	Verkauf	(16)	EUR	(2.724.960)	06.12.2019	14.880	0,01
Euro-Buxl Future	Verkauf	(5)	EUR	(1.087.500)	06.12.2019	10.750	0,01
Euro-Schatz Future	Verkauf	(24)	EUR	(2.695.920)	06.12.2019	5.880	0,00
Mid-Term Euro-BTP Future	Verkauf	(17)	EUR	(2.479.280)	06.12.2019	(7.310)	(0,01)
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(3)	USD	(358.592)	19.12.2019	(3.440)	0,00
US Ultra Bond	Kauf	12	USD	2.112.342	19.12.2019	3.010	0,00
20-Year US Long Bond	Kauf	9	USD	1.339.949	19.12.2019	(1.935)	0,00
10-Year US Treasury Ultra Future	Verkauf	(4)	USD	(522.496)	19.12.2019	745	0,00
Long Gilt Future	Verkauf	(101)	GBP	(15.325.462)	27.12.2019	(144.989)	(0,11)
5-Year US Treasury Note Future	Kauf	48	USD	5.245.941	31.12.2019	(6.192)	0,00
						EUR 145.889	0,11

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS FUTURES

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(65)	USD	(8.470.313)	19.12.2019	19.297	0,01
5-Year US Treasury Note Future	Kauf	185	USD	22.042.462	31.12.2019	(24.570)	(0,01)
						USD (5.273)	0,00

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return den folgenden ausstehenden Terminkontrakt:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
E-mini S&P 500 Future (CME)	Kauf	5	USD	683.017	20.12.2019	(5.247)	(0,02)
						EUR (5.247)	(0,02)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Topix Index Future	Kauf	36	JPY	5.289.658	12.12.2019	171.547	0,30
E-mini S&P 500 Future (CME)	Verkauf	(91)	USD	(13.552.175)	20.12.2019	105.105	0,19
						USD 276.652	0,49

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
E-mini S&P 500 Future (CME)	Verkauf	(208)	USD	(30.976.401)	20.12.2019	(447.725)	(0,24)
						USD (447.725)	(0,24)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bund Future	Verkauf	(752)	EUR	(131.036.000)	06.12.2019	747.440	0,04
Euro-Bobl Future	Verkauf	(1.266)	EUR	(171.732.900)	06.12.2019	722.930	0,04
Euro-Buxl Future	Verkauf	(42)	EUR	(9.135.000)	06.12.2019	92.561	0,01

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS FUTURES

(Fortsetzung)

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(971)	USD	(116.064.426)	19.12.2019	263.885	0,02
20-Year US Long Bond	Verkauf	(221)	USD	(32.903.194)	19.12.2019	52.263	0,00
10-Year US Treasury Ultra Future	Verkauf	(516)	USD	(67.401.968)	19.12.2019	151.177	0,01
Long Gilt Future	Verkauf	(1.283)	GBP	(194.678.885)	27.12.2019	(1.826.974)	(0,11)
5-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(284)	USD	(31.038.485)	31.12.2019	34.598	0,00
						EUR 237.880	0,01

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bund Future	Verkauf	(85)	EUR	(14.811.251)	06.12.2019	50.270	0,06
Euro-Bobl Future	Verkauf	(105)	EUR	(14.243.250)	06.12.2019	58.950	0,06
Euro-OAT Future	Verkauf	(13)	EUR	(2.214.030)	06.12.2019	11.180	0,01
Euro-Buxl Future	Verkauf	(2)	EUR	(435.000)	06.12.2019	4.713	0,01
Euro-Schatz Future	Verkauf	(2)	EUR	(224.660)	06.12.2019	530	0,00
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(55)	USD	(6.574.195)	19.12.2019	14.734	0,02
20-Year US Long Bond	Verkauf	(2)	USD	(297.766)	19.12.2019	473	0,00
10-Year US Treasury Ultra Future	Verkauf	(24)	USD	(3.134.975)	19.12.2019	7.450	0,01
Long Gilt Future	Verkauf	(69)	GBP	(10.469.870)	27.12.2019	(99.867)	(0,12)
5-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(41)	USD	(4.480.908)	31.12.2019	4.995	0,01
						EUR 53.428	0,06

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha Fund den folgenden ausstehenden Terminkontrakt:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
FTSE 100 Index Future (LIF)	Verkauf	(13)	GBP	(959.856)	20.12.2019	(10.530)	(0,11)
						GBP (10.530)	(0,11)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

12 OPTIONEN ZUM MARKTWERT

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income die folgenden ausstehenden Optionen:

Beschreibung	Kontrahent	Basis	Währung	Kontrakte	Fälligkeitsdatum	Commitment in der Portfolio-Basiswährung	Marktwert in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Optionen auf Futures								
Call S&P 500 Index	UBS	3.065	USD	(128)	18.10.2019	39.232.000*	(42.240)	(0,02)
Call DJ Euro Stoxx 50	UBS	3.600	EUR	(368)	18.10.2019	14.442.970*	(93.077)	(0,03)
Call FTSE 100 Index	UBS	7.475	GBP	(126)	18.10.2019	11.606.418*	(69.871)	(0,03)
							USD (205.188)	(0,08)

Zum 30. September 2019 hatte Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Optionen:

Beschreibung	Kontrahent	Basis	Währung	Kontrakte	Fälligkeitsdatum	Commitment in der Portfolio-Basiswährung	Marktwert in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Optionen auf Futures								
Put NASDAQ 100 Stock Index	UBS	7.500	USD	6	17.12.2020	4.500.000	342.000	0,18
Put NASDAQ 100 Stock Index	UBS	7.500	USD	15	18.06.2020	11.250.000	622.500	0,34
							USD 964.500	0,52

*Das Engagement in Short-Call-Positionen ist unbegrenzt.

13 POOLING

Die SICAV kann die Gesamtheit oder einen Teil des Vermögens zweier oder mehrerer Portfolios („teilnehmende Portfolios“) in Form eines Pools anlegen und verwalten. Ein solcher Vermögenspool wird durch Übertragung von Barmitteln oder anderen Vermögenswerten der jeweiligen teilnehmenden Portfolios gebildet (wobei diese Vermögenswerte im Hinblick auf die Anlagepolitik des betreffenden Pools geeignet sein müssen).

Der Anteil eines teilnehmenden Portfolios an einem Vermögenspool wird anhand von rechnerischen Anteilen (Units) gleichen Werts an dem Vermögenspool bestimmt.

Zum 30. September 2019 verfügte die SICAV über kein Pooling von Vermögenswerten, jedoch ist das Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio zu Anlageverwaltungszwecken nach Anlageklassen in mehrere Körbe aufgeteilt, die ausschließlich von ihm selbst gehalten werden.

14 ÄNDERUNGEN BEI DER ZUSAMMENSETZUNG DER AUFSTELLUNGEN DER WERTPAPIERANLAGE

Änderungen bei den Aufstellungen der Wertpapieranlage werden den Anteilinhabern auf Anfrage am Sitz der SICAV kostenlos zur Verfügung gestellt.

15 VERWÄSSERUNGSANPASSUNG

In einem Portfolio kann es zu einer Verwässerung des Nettoinventarwerts je Anteil kommen, wenn Anleger Anteile an einem Portfolio zu einem Preis kaufen oder verkaufen, der die Handels- und weitere Kosten nicht widerspiegelt, welche entstehen, wenn Wertpapiergeschäfte vom Anlageverwalter getätigt werden, um Barmittelzuflüsse oder -abflüsse auszugleichen. Um diesem Effekt entgegenzuwirken, kann eine Verwässerungsanpassung (gemäß der Definition dieses Begriffs im Verkaufsprospekt) vorgenommen werden, um die Interessen der Anteilinhaber der SICAV zu schützen. Wenn an einem Bewertungstag sämtliche Nettotransaktionen in Anteilen eines Portfolios eine zuvor festgelegte Schwelle übersteigen, die von der Verwaltungsgesellschaft regelmäßig für jedes Portfolio festgelegt und geprüft wird, kann der Nettoinventarwert je Anteil nach oben oder unten angepasst werden, um Nettozuflüsse bzw. Nettoabflüsse widerzuspiegeln.

Eine Verwässerungsanpassung kann auf sämtliche Portfolios mit Ausnahme des Portfolios von Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities angewendet werden. Das Ausmaß der Preisanpassung wird von der Verwaltungsgesellschaft festgelegt, um Handels- und sonstige Kosten zu berücksichtigen. Die Anpassung kann je nach Portfolio variieren und ist auf maximal 2 % des ursprünglichen Nettoinventarwertes je Anteil beschränkt, mit Ausnahme des Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity, bei dem die Anpassung nicht mehr als 5 % des ursprünglichen Nettoinventarwertes je Anteil betragen wird. Der offizielle Nettoinventarwert je Anteil zum Ende der Berichtsperiode, der im Abschnitt „Statistische Informationen“ des vorliegenden Berichts veröffentlicht ist, kann daher eine Verwässerungsanpassung enthalten, die ggf. in der Aufstellung des Nettovermögens und in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Entwicklung des Nettovermögens nicht berücksichtigt wird.

Schätzungen über die Höhe der Verwässerungsanpassung sowie die Anzahl der Fälle, in denen die Verwässerungsanpassung im Laufe des Berichtszeitraums angewendet wurde, werden auf der Website www.columbiathreadneedle.com veröffentlicht.

Zum Ende der Berichtsperiode war keine Verwässerungsanpassung vorgenommen worden.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

16 TRANSAKTIONSKOSTEN

Für den Berichtszeitraum entstanden der SICAV wie folgt Transaktionskosten bezüglich des Kaufs oder Verkaufs von übertragbaren Wertpapieren oder Geldmarktinstrumenten:

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond ^{1,2}	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond ¹	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	3.946
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond ^{1,2}	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Social Bond ¹	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond ¹	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return ¹	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	USD	7.063
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	USD	71.914
Threadneedle (Lux) - Global Focus	USD	367.561
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	USD	84.406
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	USD	499.008
Threadneedle (Lux) - Global Select	USD	159.547
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	EUR	256.289
Threadneedle (Lux) - American	USD	54.293
Threadneedle (Lux) - American Select	USD	32.004
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	USD	111.134
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	USD	211.304
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	USD	112.251
Threadneedle (Lux) - Asian Focus ²	USD	8.694
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	USD	13.023
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	USD	114.549
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	USD	1.504
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	EUR	205.951
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	EUR	95.695
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	EUR	203.442
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	308.093
Threadneedle (Lux) - European Select	EUR	571.077
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	EUR	294.243
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	44.388
Threadneedle (Lux) - Global Technology	USD	76.211
Threadneedle (Lux) - UK Equities	GBP	363.907
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	GBP	168.684
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	USD	14.449
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	USD	13.614
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities ¹	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities ¹	EUR	1
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	EUR	440.708
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	GBP	13.354
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	USD	12.662
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	USD	64.469
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	USD	1.640

Die Transaktionskosten sind in den Gesamtkosten der Anlage gemäß den Aufstellungen der Wertpapieranlage enthalten. Der Betrag der während des Berichtszeitraums von der SICAV getragenen Transaktionskosten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Entwicklung des Nettovermögens unter der Überschrift „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen“ und „Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren“ enthalten.

¹Bei festverzinslichen Wertpapieren sind die Transaktionskosten nicht vom Kaufpreis des Wertpapiers getrennt ermittelbar und können daher nicht getrennt ausgewiesen werden.

²Siehe Erläuterung 1.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

17 INFORMATIONEN ZU BARSICHERHEITEN (CASH COLLATERAL)

In der nachstehenden Tabelle sind die aktivischen und passivischen Barsicherheitsalden gegenüber Maklern zum 30. September 2019 dargestellt:

Portfolios	Kontrahent	Anlagentyp	Währung	Bar-sicherheiten
Fällig an Makler - Geleistete Sicherheiten				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Goldman Sachs	Termingeschäfte und Swaps	USD	120.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Securities	Swaps	USD	780.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	2.270.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	Barclays	Termingeschäfte und Swaps	EUR	440.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	EUR	550.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Barclays	Termingeschäfte	EUR	400.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	EUR	40.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	Citigroup Global Markets	Termingeschäfte	EUR	130.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Goldman Sachs	Swaps	EUR	160.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Barclays	Swaps	EUR	360.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	JPM Securities	Swaps	EUR	1.650.000
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	320.000
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	480.000
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	1.610.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Citigroup Global Markets	Termingeschäfte	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	20.000
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	Barclays	Termingeschäfte	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Lloyds	Termingeschäfte	USD	100.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	180.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Securities	Termingeschäfte	USD	110.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	2.200.000
Threadneedle (Lux) - Global Focus	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	440.000
Threadneedle (Lux) - American	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	1.320.000
Threadneedle (Lux) - American Select	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	120.000
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	50.000
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	320.000
Threadneedle (Lux) - Global Technology	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	350.000
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	JPM Chase	Termingeschäfte	GBP	40.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	2.170.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Royal Bank of Scotland	Termingeschäfte	EUR	430.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Credit Suisse	Swaps	EUR	1.380.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Goldman Sachs	Termingeschäfte und Swaps	EUR	3.000.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Barclays	Termingeschäfte und Swaps	EUR	7.610.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Securities	Swaps	EUR	16.420.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Goldman Sachs	Swaps	EUR	140.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Barclays	Termingeschäfte und Swaps	EUR	300.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	EUR	750.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Goldman Sachs	Swaps	EUR	2.430.000
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	JPM Chase	Termingeschäfte	GBP	30.000
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	UBS	Swaps	GBP	40.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	100.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	126.000
Fällig von Maklern - Erhaltene Sicherheiten				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Citigroup Global Markets	Swaps	USD	430.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Barclays	Termingeschäfte und Swaps	USD	660.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Citigroup Global Markets	Termingeschäfte und Swaps	EUR	300.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Goldman Sachs	Termingeschäfte	USD	640.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	70.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	440.000
Threadneedle (Lux) - European Select	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	200.000
Threadneedle (Lux) - UK Equities	JPM Chase	Termingeschäfte	GBP	240.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	350.000

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

17 INFORMATIONEN ZU BARSICHERHEITEN (CASH COLLATERAL)

(Fortsetzung)

Portfolios	Kontrahent	Anlagentyp	Währung	Bar-sicherheiten
Fällig von Maklern - Erhaltene Sicherheiten (Fortsetzung)				
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	EUR	140.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Termingeschäfte und Swaps	EUR	2.040.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	EUR	120.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Termingeschäfte und Swaps	EUR	160.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	300.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Citigroup Global Markets	Swaps	USD	570.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Credit Suisse	Swaps	USD	870.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Goldman Sachs	Swaps	USD	1.740.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	2.110.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Macquarie	Swaps	USD	2.930.000

*Siehe Erläuterung 1.

18 ÜBERKREUZBETEILIGUNGEN IN PORTFOLIOS

Zum 30. September 2019 investierte das Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return Portfolio in Anteile folgender Portfolios:

Portfolio	Währung	Marktwert	% des Nettovermögens
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	EUR	732.985	0,21
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	EUR	143.326	0,10
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	EUR	2.894.674	2,15
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	1.719.575	0,35
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	EUR	3.531.159	4,02
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	691.735	0,06
Threadneedle (Lux) - European Short Term High Yield Bond*	EUR	472.524	1,25

Zum 30. September 2019 investierte das Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio in Anteile folgender Portfolios:

Portfolio	Währung	Marktwert	% des Nettovermögens
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	USD	1.236.503	0,32
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	USD	2.037.717	1,56
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	USD	2.072.704	2,16

Zum 30. September 2019 investierte das Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income Portfolio in Anteile folgender Portfolios:

Portfolio	Währung	Marktwert	% des Nettovermögens
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	USD	13.498.956	10,33
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income Fund	USD	1.690.462	2,90
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	USD	7.064.181	7,38

Die Auswirkungen der Transaktionen im Rahmen von Überkreuzbeteiligungen wurden aus der kombinierten Aufstellung des Nettovermögens und der Aufstellung der Entwicklung des Nettovermögens entfernt.

Bitte lesen Sie auch Erläuterung 2 xi) zu Vermögensverwaltungsgebühr.

*Siehe Erläuterung 1.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 TERMINEINLAGEN

Die folgende Tabelle zeigt die von der SICAV zum 30. September 2019 gehaltenen Termineinlagen:

Portfolios	Kontrahent	Währung	Betrag der Termineinlagen (in der Basiswährung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	7.497.300
	Summe	EUR	7.497.300
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	Rabobank Nederland Utrecht	EUR	1.499.756
	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	1.499.853
	Credit Agricole London	EUR	1.499.810
	Summe	EUR	4.499.419
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	Lloyds TSB Financial Market	USD	805.418
	Summe	USD	805.418
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	BNP Paribas Paris	USD	1.301.142
	Summe	USD	1.301.142
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	1.097.181
	BNP Paribas Paris	EUR	499.643
	Mitsubishi UFJ Securities	EUR	998.598
	Summe	EUR	2.595.422
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Mitsubishi UFJ Securities	USD	1.006.258
	Rabobank Nederland Utrecht	USD	1.508.455
	Lloyds TSB Financial Market	USD	2.203.182
	Summe	USD	4.717.895
Threadneedle (Lux) - American Select	Mitsubishi UFJ Securities	USD	3.608.755
	Lloyds TSB Financial Market	USD	5.050.443
	Summe	USD	8.659.198
Threadneedle (Lux) - European Select	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	10.499.115
	Summe	EUR	10.499.115
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	BNP Paribas Paris	USD	11.210.924
	Rabobank Nederland Utrecht	USD	11.282.722
	Sumitomo Bank Ltd London	USD	12.108.590
	Mitsubishi UFJ Securities	USD	12.336.640
	National Bank of Abu Dhabi	USD	12.414.474
	Bank of Nova Scotia	USD	8.698.189
	Lloyds TSB Financial Market	USD	9.648.050
	Summe	USD	77.699.589
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Mitsubishi UFJ Securities	EUR	18.000.000
	BNP Paribas Paris	EUR	28.998.549
	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	29.975.191
	Mitsubishi UFJ Securities	EUR	5.652.362
	BNP Paribas Paris	EUR	4.589.965
	Summe	EUR	87.216.067
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	BNP Paribas Paris	EUR	2.000.000
	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	2.798.756
	Summe	EUR	4.798.756
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	ANZ Banking Group Ltd	GBP	450.049
	Mitsubishi UFJ Securities	GBP	302.000
	Lloyds TSB Financial Market	GBP	350.138
	Summe	GBP	1.102.187
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Rabobank Nederland Utrecht	USD	911.907
	Summe	USD	911.907
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Mitsubishi UFJ Securities	USD	4.518.732
	Rabobank Nederland Utrecht	USD	4.871.958
	Summe	USD	9.390.690

*Siehe Erläuterung 1.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

Die Gesamtkostenquote wird gemäß der Richtlinie der Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA) ermittelt.

Die verwendete Formel lautet wie folgt:

Die TER erfasst sämtliche den Anteilklassen fortlaufend belasteten Provisionen und Kosten (Betriebskosten) rückwirkend als prozentualen Anteil des Nettovermögens der Anteilklassen und wird anhand der folgenden Formel berechnet:

$$\text{TER \%} = \frac{\text{Gesamtbetriebskosten}}{\text{Durchschnittliches Nettovermögen}} \times 100$$

Wenn ein Fonds mehr als 10 % in andere Organismen für gemeinsame Anlagen (Zielfonds) investiert, umfasst die Berechnung den Anteil des Fonds an den Aufwendungen der Zielfonds abzüglich erhaltener Gebührennachlässe.

Die Gesamtkostenquote für den Berichtszeitraum zum 30. September 2019 beträgt:

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	AEC	0,85 %	
	AEH	0,85 %	
	AKH	0,85 %	
	AU	0,85 %	
	AUP	0,85 %	
	DEC	1,60 %	
	DEH	1,60 %	
	DU	1,60 %	
	DUP	1,70 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IEC	0,65 %	
	IEH	0,65 %	
	IEP	0,65 %	
	IGC	0,76 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IGH	0,65 %	
	IKH	0,71 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IU	0,65 %	
	IUP	0,49 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	NEC	0,37 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	NEH	0,45 %	
	NGC	0,45 %	
NGH	0,45 %		
NU	0,45 %		
NUP	0,39 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
XGH	0,15 %		
ZEH	0,60 %		
ZGH	0,60 %		
ZU	0,60 %		
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	AE	1,20 %	
	IE	0,60 %	
	ZE	0,70 %	
	1E	1,19 %	
	1G	1,19 %	
	2E	0,58 %	
	2G	0,58 %	
3G	0,69 %		

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond (Fortsetzung)			
	4G	0,08 %	
	8E	0,62 %	
	8G	0,62 %	
	9G	0,65 %	
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	IE	0,85 %	
	IEP	1,00 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XE	0,05 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	ZE	0,90 %	
	ZEP	1,01 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	1E	1,38 %	
	1EP	1,38 %	
	1G	1,38 %	
	1GP	1,38 %	
	1UT	1,38 %	
	2E	0,82 %	
	2EP	0,82 %	
	2FH	0,82 %	
	2G	0,73 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	2GP	0,74 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	3E	0,77 %	
	3EP	0,77 %	
	3FC	0,77 %	
	3FH	0,77 %	
	3G	0,77 %	
	3GP	0,77 %	
	4E	0,07 %	
	4G	0,07 %	
	4GP	0,07 %	
	8E	0,86 %	
	8EP	0,86 %	
	8FH	0,86 %	
	8G	0,86 %	
	8GP	0,86 %	
	9E	0,73 %	
	9EP	0,73 %	
	9FC	0,73 %	
	9FH	0,73 %	
	9G	0,73 %	
	9GP	0,73 %	
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond*	AE	0,78 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond* (Fortsetzung)			
	AEP	0,78 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	AKH	0,84 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	ANH	0,78 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	IE	0,50 %	
	IEP	0,42 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	IGC	0,50 %	
	IGH	0,43 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	XE	0,10 %	
	XGH	0,10 %	
	ZE	0,55 %	
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	IE	0,50 %	
	IEP	0,50 %	
	IFH	0,50 %	
	IKH	0,50 %	
	LE	0,40 %	
	NEP	0,40 %	
	ZE	0,55 %	
	ZEP	0,55 %	
	ZFH	0,55 %	
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	AE	1,15 %	
	AEP	1,15 %	
	AKH	1,15 %	
	AUH	1,15 %	
	DE	1,70 %	
	DEP	1,70 %	
	DUH	1,83 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,55 %	
	W	1,15 %	

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	AEC	1,65 %	
	AEH	1,65 %	
	AKH	1,73 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	ANH	1,65 %	
	ASH	1,65 %	
	AU	1,65 %	
	AUP	1,65 %	
	DEC	1,75 %	
	DEH	1,75 %	
	DU	1,75 %	
	IEH	0,85 %	
	IU	0,96 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	W	1,30 %	
	WEH	1,30 %	
XUP	0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	AEC	1,65 %	
	AEH	1,65 %	
	AKH	1,72 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	ANH	1,65 %	
	ASH	1,65 %	
	AU	1,65 %	
	AUP	1,65 %	
	DEH	1,75 %	
	DU	1,75 %	
	IEH	0,85 %	
	IU	0,85 %	
	SU	1,80 %	
	SUP	1,80 %	
	W	1,30 %	
XUP	0,05 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
ZU	0,90 %		
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AEC	1,60 %	
	AEH	1,60 %	
	AKH	1,71 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	ANH	1,60 %	
	ASC	1,60 %	
	AU	1,60 %	

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market			
Short-Term Bonds (Fortsetzung)			
	AUP	1,60 %	
	DEH	1,75 %	
	DU	1,75 %	
	IEH	0,85 %	
	XU	0,15 %	
	XUP	0,15 %	
	ZEH	0,90 %	
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond			
	AEC	1,55 %	
	AEH	1,55 %	
	ASH	1,55 %	
	AU	1,55 %	
	AUP	1,55 %	
	DEC	1,75 %	
	DEH	1,75 %	
	DU	1,75 %	
	IEC	0,65 %	
	IEH	0,65 %	
	IU	0,65 %	
	TEH	0,65 %	
	XUP	0,05 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZFH	1,00 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZGH	0,83 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	0,90 %	
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond			
	AEH	1,55 %	
	AKH	1,70 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	AS	1,55 %	
	ASC	1,55 %	
	ASH	1,55 %	
	AU	1,55 %	
	AUP	1,55 %	
	AVC	1,62 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AVH	1,71 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DEH	1,75 %	
	IEH	0,80 %	
	IGH	0,80 %	
	ISH	0,80 %	
	IU	0,80 %	
	XU	0,15 %	
	ZU	0,90 %	
	ZUP	0,99 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	AE	1,63 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entspricht.
	AEP	1,63 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entspricht.
	DE	2,38 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entspricht.
	IE	0,93 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entspricht.
	IEP	0,93 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entspricht.
	LE	0,78 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entspricht.
	LEP	0,78 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entspricht.
	ZE	1,13 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entspricht.
	ZEP	1,13 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entspricht.
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	AEC	1,65 %
AEH		1,65 %	
AKH		1,74 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
AU		1,65 %	
AUP		1,65 %	
DEH		2,30 %	
DU		2,30 %	
IEH		0,95 %	
IGH		0,95 %	
IU		0,95 %	
W	1,75 %		
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	AE	1,55 %	
	AEC	1,55 %	
	AEH	1,55 %	
	AEP	1,55 %	
	AS	1,61 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ASC	1,55 %	
ASH	1,55 %		

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income (Fortsetzung)			
	ASP	1,55 %	
	AU	1,55 %	
	AUM	1,45 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	AUP	1,55 %	
	DEC	2,30 %	
	DEH	2,30 %	
	DEP	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	DUP	2,30 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEC	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZFH	1,05 %	
	ZU	1,05 %	
	ZUP	1,11 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
Threadneedle (Lux) - Global Focus			
	AEH	1,80 %	
	AEP	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	AUP	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	IE	0,95 %	
	IEH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	IUP	1,02 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	W	1,75 %	
	XU	0,15 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEP	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
	ZU	1,05 %	
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities			
	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	IEH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,71 %	
	1U	1,71 %	
	2E	1,10 %	
	2U	1,04 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	8E	1,14 %	
	8U	1,14 %	

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	AEC	1,87 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AUP	1,80 %	
	DEC	2,30 %	
	DUP	2,36 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IU	1,02 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	TE	1,09 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,68 %	
	1EP	1,68 %	
	1SC	1,68 %	
	1SH	1,68 %	
	1ST	1,68 %	
	1U	1,68 %	
	1UP	1,68 %	
	1VT	1,68 %	
	2E	1,07 %	
	2EP	1,07 %	
	2U	1,00 %	Aufgrund der Verwendung der Durchschnittsberechnungsmethode und einer umfangreichen Rücknahme in dieser Anteilklasse weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	2UP	1,07 %	
	3E	0,93 %	
	3EP	0,93 %	
	3U	0,93 %	
	3UP	0,93 %	
	8E	1,11 %	
	8EP	1,11 %	
	8U	1,11 %	
	8UP	1,11 %	
9E	0,78 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
9EP	0,74 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
9U	0,76 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
9UP	0,77 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
Threadneedle (Lux) - Global Select	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,68 %	
	1U	1,68 %	
	2E	1,07 %	
	2U	1,07 %	
	3U	0,90 %	
8E	1,11 %		
8U	1,11 %		
9U	0,86 %		

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	AE	1,80 %	
	AEP	1,80 %	
	AUP	1,89 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DE	2,30 %	
	IE	0,95 %	
	NE	0,75 %	
	XE	0,15 %	
	XG	0,15 %	
	XGH	0,15 %	
	ZE	1,05 %	
	ZFH	1,12 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZG	1,05 %	
	ZGH	1,05 %	
	ZU	1,05 %	
Threadneedle (Lux) - American	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,15 %	
	DU	2,15 %	
	IEH	0,90 %	
	IU	0,90 %	
	W	1,50 %	
	ZE	1,00 %	
	ZEH	1,00 %	
	ZU	1,00 %	
	1E	1,67 %	
	1EH	1,67 %	
	1EP	1,67 %	
	1U	1,67 %	
	2E	1,06 %	
	2U	1,06 %	
	3EH	0,88 %	
	3U	0,88 %	
	8E	1,10 %	
	8U	1,10 %	
9EH	0,84 %		
9U	0,84 %		
Threadneedle (Lux) - American Select	AD	1,71 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	AEH	1,80 %	
	AN	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
ID	0,96 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.	

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - American Select (Fortsetzung)			
	IE	1,14 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	IEH	1,00 %	
	IN	1,15 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	W	1,75 %	
	ZEH	1,03 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	1,10 %	
	1E	1,67 %	
	1EH	1,67 %	
	1EP	1,67 %	
	1U	1,67 %	
	2EH	1,00 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	2U	1,06 %	
	3E	0,87 %	
	3U	0,87 %	
	8EH	1,10 %	
	8U	1,10 %	
	9E	0,83 %	
	9U	0,76 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies			
	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IE	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,68 %	
	1EP	1,68 %	
	1U	1,68 %	
	2U	1,07 %	
	3EH	0,93 %	
	3U	0,93 %	
	8U	1,11 %	
	9EH	0,76 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9U	0,89 %	
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity			
	AE	1,80 %	
	AF	1,80 %	
	AS	1,86 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ASH	1,80 %	
	AU	1,80 %	

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity (Fortsetzung)			
	DE	2,55 %	
	IE	0,95 %	
	IF	0,95 %	
	ISH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	XU	0,15 %	
	XUP	0,15 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZF	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
	ZU	1,05 %	
Threadneedle (Lux) - Asia Equities			
	IE	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,70 %	
	1U	1,70 %	
	2E	1,09 %	
	2U	1,09 %	
	3U	0,95 %	
	8E	1,04 %	Aufgrund der Verwendung der Durchschnittsberechnungsmethode und einer umfangreichen Rücknahme in dieser Anteilklasse weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	8U	1,13 %	
	9U	0,91 %	
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income			
	AE	1,80 %	
	AEP	1,80 %	
	AF	1,80 %	
	AFP	1,80 %	
	ASC	1,80 %	
	ASH	1,80 %	
	ASP	1,90 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AU	1,80 %	
	AUP	1,80 %	
	AVC	1,80 %	
	AVH	1,80 %	
	DE	2,55 %	
	IE	0,95 %	
	IEP	0,95 %	
	IF	0,95 %	
	IFP	1,02 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ISH	0,95 %	
	IU	1,01 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IUP	1,02 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZEP	1,05 %	
	ZF	1,05 %	
	ZFP	1,05 %	
	ZU	1,05 %	
	ZUP	1,05 %	

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER ¹	Kommentare	
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	AEC	1,85 %		
	AEH	1,85 %		
	AU	1,85 %		
	AUP	1,85 %		
	DU	2,35 %		
	IU	1,05 %		
	XS	0,15 %		
	XSH	0,15 %		
	ZEH	1,10 %		
	ZFH	1,10 %		
	ZGH	1,10 %		
	ZU	1,10 %		
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	AE	0,70 %	
		AEH	0,70 %	
AU		0,70 %		
AUP		0,70 %		
DE		0,90 %		
DEH		0,90 %		
DU		0,90 %		
IE		0,41 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
IEC		0,35 %		
IEH		0,41 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
IFH		0,35 %		
IG		0,35 %		
IU		0,35 %		
ZEH		0,45 %		
ZFH	0,45 %			
ZU	0,45 %			
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	AE	1,80 %		
	ASH	1,80 %		
	AUH	1,80 %		
	DE	2,15 %		
	IE	0,95 %		
	W	1,75 %		
	XE	0,15 %		
	ZUH	1,05 %		
	1E	1,73 %		
	1EP	1,85 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
	1G	1,73 %		
	1GP	1,81 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
	2E	1,08 %		
	2G	1,08 %		
	2U	0,98 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
	3E	0,94 %		
	3G	0,94 %		
	3GP	0,94 %		
	4E	0,08 %		
4G	0,08 %			
8E	1,12 %			
8G	1,12 %			
8U	1,12 %			

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities (Fortsetzung)			
	9E	0,82 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9G	0,77 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9GP	0,77 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	AE	1,80 %	
	AEP	1,80 %	
	AUP	1,87 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DE	2,15 %	
	DEP	2,15 %	
	IE	1,03 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IEP	1,03 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZE	1,05 %	
	ZEP	1,05 %	
	1E	1,70 %	
	1EP	1,70 %	
	1G	1,70 %	
	1GP	1,70 %	
	2E	1,09 %	
	2EP	1,09 %	
	2G	1,03 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	2GP	1,03 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	3EP	0,95 %	
	3G	0,95 %	
	3GP	0,95 %	
	4GP	0,09 %	
	8E	1,13 %	
	8EP	1,13 %	
	8G	1,13 %	
	8GP	1,13 %	
	9EP	0,80 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9G	0,91 %	
	9GP	0,91 %	
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	AE	1,85 %	
	ASH	1,85 %	
	AUH	1,92 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DE	2,75 %	
	DUH	2,83 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities (Fortsetzung)			
	IE	1,10 %	
	W	1,90 %	
	ZE	1,10 %	
	ZFH	1,24 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	IE	0,95 %	
	ZE	1,10 %	
	1E	1,72 %	
	1EP	1,72 %	
	1FH	1,72 %	
	1G	1,72 %	
	1UH	1,72 %	
	2E	1,07 %	
	2G	1,07 %	
	3E	0,91 %	
	3EP	0,91 %	
	3FH	0,91 %	
	3G	0,91 %	
	3GP	0,91 %	
	3UH	0,91 %	
	4E	0,07 %	
	4G	0,07 %	
	8E	1,11 %	
	8G	1,11 %	
	9E	0,87 %	
	9EP	0,87 %	
	9FH	0,87 %	
	9G	0,87 %	
	9GP	0,77 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9UH	0,87 %	
Threadneedle (Lux) - European Select	AE	1,80 %	
	AGH	1,80 %	
	AUH	1,80 %	
	DUH	2,35 %	
	IE	0,95 %	
	ZG	1,05 %	
	ZGH	1,05 %	
	1E	1,65 %	
	1EP	1,65 %	
	1SH	1,65 %	
	1U	1,65 %	
	1UH	1,65 %	
	2E	1,06 %	
	2EP	1,06 %	
	3E	0,88 %	
	3U	0,88 %	
	8E	1,10 %	
	8EP	1,10 %	
	9E	0,84 %	
	9U	0,84 %	

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	IE	1,07 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	ZE	1,10 %	
	1E	1,72 %	
	1EP	1,72 %	
	1FH	1,72 %	
	2E	1,07 %	
	3E	0,93 %	
	3EP	0,93 %	
	3FH	0,93 %	
	8E	1,11 %	
	9E	0,89 %	
	9EP	0,89 %	
	9FH	0,95 %	
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	AUP	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	DUP	2,55 %	
	IEP	0,95 %	
	W	2,00 %	
	XU	0,15 %	
	XUP	0,15 %	
	ZG	1,05 %	
	ZGH	1,05 %	
	ZGP	1,05 %	
	ZUP	1,05 %	
Threadneedle (Lux) - Global Technology	AEH	1,95 %	
	AS	1,95 %	
	AU	1,95 %	
	AUP	1,95 %	
	BU	2,35 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IEH	1,05 %	
	IG	1,05 %	
	ZEH	1,15 %	
	ZFH	1,15 %	
	ZG	1,15 %	
	ZU	1,15 %	
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	AEH	
AFH		1,88 %	
AG		1,80 %	
AGP		1,80 %	
DEH		2,60 %	
DG		2,60 %	
IEH		0,85 %	
IG		0,85 %	
IGP		0,85 %	
ZEH		1,05 %	
ZFH		1,05 %	

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - UK Equities (Fortsetzung)			
	ZG	1,05 %	
	ZGP	1,05 %	
	ZUH	1,05 %	
	3EH	0,87 %	
	3FH	0,78 %	Aufgrund der Verwendung der Durchschnittsberechnungsmethode und einer umfangreichen Rücknahme in dieser Anteilklasse weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	3UH	0,87 %	
	9EH	0,83 %	
	9EP	0,83 %	
	9FH	0,83 %	
	9G	0,83 %	
	9UH	0,83 %	
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income			
	AE	1,80 %	
	AEC	1,80 %	
	AEH	1,80 %	
	AG	1,80 %	
	ASC	1,80 %	
	AUC	1,80 %	
	DE	2,55 %	
	DEC	2,65 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DEH	2,55 %	
	DG	2,55 %	
	DGP	2,55 %	
	IE	0,85 %	
	IEH	0,85 %	
	IG	0,85 %	
	IGP	0,85 %	
	IU	0,85 %	
	IUH	0,67 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	LG	0,70 %	
	LGP	0,70 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZFH	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
	ZGP	1,05 %	
	ZUH	1,05 %	
	1EH	1,64 %	
	1FH	1,64 %	
	1UH	1,64 %	
	3EH	0,88 %	
	3FH	0,88 %	
	3UH	0,88 %	
	9EH	0,84 %	
	9FH	0,90 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9G*	0,84 %	
	9UH	0,84 %	
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity			
	IU	1,60 %	
	ZU	1,60 %	

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	AEH	1,80 %	
	AFH	1,80 %	
	AGH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IEH	0,95 %	
	IGH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	XGH	0,15 %	
	ZE	1,05 % / 1,75 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZGH	1,05 %	
	ZU	1,05 % / 0,98 %	
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	ZE	0,80 %
1E		1,17 %	
1EP		1,17 %	
1GH		1,17 %	
1UH		1,17 %	
2E		0,56 %	
2EP		0,43 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
2GC		0,56 %	
2GH		0,56 %	
4GH		0,06 %	
8E		0,60 %	
8EP		0,60 %	
8GC		0,60 %	
8GH		0,60 %	
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities		AE	1,20 %
	AFH	1,14 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AKH	1,20 %	
	ANH	1,20 %	
	AUH	1,13 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DE	1,75 %	
	IE	0,55 %	
	IEP	0,55 %	
	IGH	0,55 %	
	IU	0,47 %	Da die Durchschnittsberechnungsmethode verwendet wird und die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklasse übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.
	IUH	0,55 %	
	JE	0,45 %	
	JGH	0,45 % / 0,59 %	
	JUH	0,52 % / 0,83 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	LE	0,40 %	
LEP	0,40 %		
LGH	0,40 %		
YE	0,60 %		

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities (Fortsetzung)			
	YGH	0,60 % / 0,74 %	
	YUH	0,60 % / 0,97 %	
	ZE	0,70 %	
	ZFH	0,70 %	
	ZGH	0,70 %	
	ZUH	0,70 %	
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	AE	1,85 % / 3,95 %	
	AEP	1,85 %	
	AUH	1,85 % / 6,56 %	Aufgrund des geringen Volumens der Anteilklasse ist die in der Gesamtkostenquote einschließlich Performance-Gebühren enthaltene annualisierte Performance-Gebühr nicht repräsentativ.
	DE	2,35 % / 5,05 %	
	IE	0,95 % / 2,31 %	
	IGH	0,95 %	
	LE	0,58 % / 1,93 %	
	XGH	0,15 %	
	ZE	1,05 % / 3,22 %	
	ZF	1,05 % / 3,59 %	Aufgrund des geringen Volumens der Anteilklasse ist die in der Gesamtkostenquote einschließlich Performance-Gebühren enthaltene annualisierte Performance-Gebühr nicht repräsentativ.
	ZFH	1,11 % / 4,39 %	Aufgrund des geringen Volumens der Anteilklasse weicht die aktuelle Gesamtkostenquote von der für das Gesamtjahr erwarteten Gesamtkostenquote ab, und die in der Gesamtkostenquote einschließlich Performance-Gebühren enthaltene annualisierte Performance-Gebühr ist nicht repräsentativ.
	ZGH	1,05 % / 4,83 %	Aufgrund des geringen Volumens der Anteilklasse ist die in der Gesamtkostenquote einschließlich Performance-Gebühren enthaltene annualisierte Performance-Gebühr nicht repräsentativ.
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	AEH	1,92 % / 2,54 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AG	1,80 % / 2,67 %	
	DEH	2,36 % / 2,91 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DG	2,42 % / 3,19 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IG	0,95 % / 2,02 %	
	ZG	1,05 % / 2,06 %	
	1E	1,68 %	
	1EH	1,68 %	
	2E	0,94 % / 1,95 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	2EH	1,07 % / 2,83 %	
	3EH	0,87 %	Aufgrund der Verwendung der Durchschnittsberechnungsmethode und einer umfangreichen Rücknahme in dieser Anteilklasse weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	3FH	0,93 %	
	8E	1,11 %	

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha (Fortsetzung)			
	8EH	1,11 %	
	9EH	0,89 % / 8,68 %	Aufgrund des geringen Volumens der Anteilklasse und da die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, ist die in der Gesamtkostenquote einschließlich Performance-Gebühren enthaltene annualisierte Performance-Gebühr nicht repräsentativ.
	9FH	0,89 % / 1,66 %	
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha			
	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,37 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IU	0,90 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,69 %	
	1EH	1,69 %	
	1U	1,69 %	
	2E	0,83 %	
	2U	0,83 %	
	3U	0,94 % / 0,70 %	
	8E	0,87 % / 0,39 %	
	8U	0,87 % / -1,18 %	Die Performancegebührenkomponente, die in der Übertragung der Vermögenswerte in den Fonds zum 26. Januar 2019 enthalten ist, hat die Gesamtkostenquote einschließlich Performance-Gebühren verfälscht.
	9U	0,79 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha			
	AEH	1,86 % / 8,30 %	Aufgrund des geringen Volumens der Anteilklasse und da die Anteilklasse während des Berichtszeitraums aufgelegt wurde, weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab, und die in der Gesamtkostenquote einschließlich Performance-Gebühren enthaltene annualisierte Performance-Gebühr ist nicht repräsentativ.
	AU	1,80 % / 2,03 %	
	DEH	2,30 % / 2,95 %	
	DU	2,30 % / 3,54 %	
	IU	0,90 %	
	ZU	1,05 % / 2,52 %	
	1E	1,69 %	
	1U	1,69 % / 1,75 %	
	2E	0,83 % / 2,22 %	
	2U	0,83 % / 2,39 %	
	8E	0,87 % / 1,28 %	
	8U	0,87 %	
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities			
	AEH	2,05 %	
	AFH	2,05 %	
	AGH	2,05 %	
	ASH	2,05 %	
	AU	2,05 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	IEH	1,00 %	
	IFH	1,00 %	

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

20 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER ¹	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (Fortsetzung)			
	IG	1,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IGH	1,00 %	
	IU	1,00 %	
	NG	0,65 %	
	XU	0,15 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZFH	1,05 %	
	ZGH	1,05 %	
	ZU	1,05 %	
Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity			
	AU	1,85 %	
	XU	0,25 %	

¹ Die TER versteht sich einschließlich Performance-Gebühren.

* Siehe Erläuterung 1.

Informationen für Anteilinhaber

Die SICAV ist eine im Großherzogtum Luxemburg entsprechend der aktuellen Fassung des Gesetzes vom 10. August 1915 gegründete Investmentgesellschaft mit variablem Kapital („Société d'Investissement à Capital Variable“) und gilt gemäß Teil I der aktuellen Fassung des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW).

Die SICAV wurde am 10. Februar 1995 für unbegrenzte Dauer gegründet. Die Satzung der SICAV wurde erstmals am 31. März 1995 im Mémorial, Recueil des Sociétés et Associations des Großherzogtums Luxemburg („Mémorial“) veröffentlicht. Die daran vorgenommenen Änderungen vom 25. Juli 1997, 12. März 1999, 18. August 2004, 17. Oktober 2005, 25. Juli 2008, 31. Juli 2009, 31. August 2010, 29. Juli 2011, 13. August 2012, 28. März 2013 und 12. August 2013 wurden am 30. Oktober 1997, 22. April 1999, 15. September 2004, 3. November 2005, 10. September 2008, 21. Oktober 2010, 22. August 2011, 18. September 2012, 22. April 2013, 16. September 2013 und 12. Oktober 2018 im Mémorial bekanntgegeben.

Die SICAV ist unter der Nummer R.C.S. Luxembourg B-50216 eingetragen.

Die Jahreshauptversammlung der Anteilinhaber der SICAV findet, wie in der Versammlungsmitteilung angegeben, innerhalb von sechs Monaten nach Ablauf des Rechnungsjahres in Luxemburg statt. Die Jahreshauptversammlung kann im Ausland abgehalten werden, wenn außergewöhnliche Umstände dies nach dem absoluten und endgültigen Urteil des Verwaltungsrats erfordern. Sonstige Hauptversammlungen der Anteilinhaber können zu den Terminen und an den Orten in Luxemburg abgehalten werden, die in der Versammlungsmitteilung angegeben sind. Versammlungsmitteilungen erfolgen gemäß luxemburgischem Recht und im Einklang mit den maßgeblichen Regelungen der Länder, in denen die Anteile öffentlich angeboten werden. Die Versammlungsmitteilung muss Ort und Termin der Versammlung, die Teilnahmevoraussetzungen, die Tagesordnung, die Mindestanwesenheitsanforderungen zur Beschlussfähigkeit und die Voraussetzungen für die Stimmabgabe enthalten.

Das Rechnungsjahr der SICAV endet am 31. März eines jeden Jahres.

Der Jahresbericht und der geprüfte Jahresabschluss sowie der ungeprüfte Halbjahresbericht sind am eingetragenen Sitz der SICAV und am Hauptsitz der einzelnen Zahl- und Vertriebsstellen erhältlich. Die konsolidierten Konten der SICAV werden in US-Dollar ausgedrückt.

Der Nettoinventarwert sowie die Ausgabe- und Rücknahmepreise der Anteile der SICAV werden am eingetragenen Sitz der SICAV veröffentlicht.

Dieser Bericht stellt kein Angebot und keine Aufforderung zum Kauf von Anteilen der SICAV dar. Zeichnungen werden nur auf der Grundlage des Verkaufsprospekts, des letzten verfügbaren Jahresberichts mit dem geprüften Abschluss zum 31. März und, sofern danach veröffentlicht, des letzten verfügbaren Halbjahresberichts zum 30. September akzeptiert.

Bestimmte Portfolios und/oder Anteilklassen in diesem Bericht sind zu diesem Datum möglicherweise nicht in allen Gebietskörperschaften zugelassen oder werden nicht in allen Gebietskörperschaften zum Kauf angeboten.

Dokument mit den wesentlichen Informationen für den Anleger („KIID“) - Bedingungen für die Zeichnung

Das Dokument mit den wesentlichen Anlegerinformationen (Key Investor Information Document, KIID) ist ein vorvertragliches Dokument und Anleger müssen bestätigen, dass sie das neueste KIID gelesen haben, bevor sie eine Zeichnung tätigen. Die Verwaltungsgesellschaft darf einen Zeichnungsantrag ablehnen, wenn ein Anleger bei Antragstellung nicht bestätigt, dass er das neueste KIID zur Kenntnis genommen hat. Das neueste KIID ist auf www.columbiathreadneedle.com erhältlich.

Informationen für Anleger in der Schweiz

Der geprüfte Jahresbericht und Jahresabschluss, der ungeprüfte Halbjahresbericht, der Bericht über die Veränderungen des Portfoliobestands in dem Jahr, die Satzung, der Verkaufsprospekt (Schweizer Version) und die KIID können auf Anfrage kostenlos bei den Geschäftsstellen der Vertretung und Zahlstelle der SICAV in der Schweiz, RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Zweigniederlassung Zürich, Bleicherweg 7, CH8027 Zürich, Schweiz, oder am Sitz der SICAV angefordert werden.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit gibt keinen Aufschluss über die aktuelle oder zukünftige Wertentwicklung, und bei den Daten zur Wertentwicklung sind Provisionen und Kosten im Rahmen der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen nicht berücksichtigt.

Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Die Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transaction Regulation, „SFTR“) führt Meldepflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTs“) und Total Return Swaps ein. Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft ist gemäß der Definition in Artikel 3(11) der SFTR Folgendes:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft;
- ein Wertpapier- oder Warenverleihgeschäft und ein Wertpapier- oder Warenentleihgeschäft;
- ein Kauf-/Rückverkaufgeschäft oder ein Verkauf-/Rückkaufgeschäft; oder
- ein Lombardgeschäft.

Zum 30. September 2019 hielt die SICAV Total Return Swaps („TRS“) als die Art von Instrumenten, die in den Geltungsbereich der SFTR fallen.

Weltweite Daten

Name des Portfolios	Art des Vermögenswerts	Nicht realisierter Gewinn und Verlust in der Portfolio-Basiswährung und als absoluter Wert	% des Nettovermögens
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	TRS	161.712	0,09
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	TRS	657.944	0,65
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	TRS	33.518	0,34
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	TRS	170.716	0,16
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	TRS	1.706.459	0,95
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	TRS	5.114.731	1,32

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Es wurden während des Berichtszeitraums zum 30. September 2019 keine Sicherheiten wiederverwendet.

Konzentrationsdaten

Alle in Bezug auf TRS zum 30. September 2019 erhaltenen Sicherheiten sind Barsicherheiten. Die Angabe der zehn größten Emittenten ist daher nicht möglich.

Die folgende Tabelle bietet Details zu den zehn wichtigsten Gegenparteien (auf Basis des Bruttovolumens ausstehender Transaktionen) in Bezug auf TRS, die zum 30. September 2019 vom Portfolio gehalten wurden.

Name des Portfolios	Art des Vermögenswerts	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn und Verlust in der Portfolio-Basiswährung und als absoluter Wert
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	TRS	Bank of America Merrill Lynch	161.712
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	TRS	Goldman Sachs	657.944
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	TRS	UBS	33.518
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	TRS	Bank of America Merrill Lynch	170.716
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	TRS	UBS	1.706.459
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	TRS	JPMorgan	2.007.662
		Macquarie	1.513.161
		Goldman Sachs	970.598
		Citigroup Global Markets	330.345
		Credit Suisse	292.965

Aufbewahrung erhaltener Sicherheiten

Barsicherheiten werden im Geldkonto des jeweiligen Portfolios bei der Citibank Europe plc, Niederlassung Luxemburg, gehalten.

Die folgende Tabelle zeigt die von der SICAV zum 30. September 2019 gehaltenen Termineinlagen:

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheit	Betrag der Sicherheit
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Barmittel	Bank of America Merrill Lynch	USD	350.000
		Summe	USD	350.000

Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

(Fortsetzung)

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheit	Betrag der Sicherheit
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Barmittel	Citigroup Global Markets	USD	570.000
	Barmittel	Credit Suisse	USD	870.000
	Barmittel	Goldman Sachs	USD	1.740.000
	Barmittel	JPMorgan	USD	2.110.000*
	Barmittel	Macquarie	USD	2.930.000
		Summe	USD	8.220.000

Transaktionsdaten insgesamt

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Laufzeit (Sicherheit)	Währung der Sicherheit	Laufzeit (SFT/TRS)	Land der Niederlassung (Gegenpartei)	Abwicklung und Clearing	Qualität der Sicherheit
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	USD	mehr als 1 Jahr	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	EUR	mehr als 1 Jahr	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	GBP	mehr als 1 Jahr	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	USD	3 Monate bis 1 Jahr	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	USD	mehr als 1 Jahr	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Barmittel	Restlaufzeit	USD	weniger als 1 Tag	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel

Der Betrag der für TRS gewährten Sicherheiten zum 30. September 2019 ist wie folgt:

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheit	Betrag der Sicherheit	% der zum Ende der Berichtsperiode gehaltenen Sicherheiten
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Barmittel	Goldman Sachs	EUR	2.430.000	2,35
Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha	Barmittel	UBS	GBP	40.000	0,41
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Barmittel	Bank of America Merrill Lynch	USD	100.000	0,09
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Barmittel	UBS	USD	126.000	0,07

Rendite/Kosten

Die Rendite und die Kosten von TRS-Transaktionen zum 30. September 2019 werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Entwicklung des Nettovermögens des jeweiligen Portfolios unter der Überschrift „Zinsaufwendungen aus Swapgeschäften“, „Realisierter Nettogewinn/-verlust aus Swaps“ und „Änderung des nicht realisierten Nettogewinns/-verlusts aus Swapgeschäften“ ausgewiesen.

*Diese Sicherheiten beziehen sich möglicherweise auf andere Transaktionen als TRS, die nicht unter die Offenlegung gemäß SFT-Verordnung fallen.

Verzeichnis

Eingetragener Sitz

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

Anlageberater

Threadneedle Management Luxembourg S.A.

Unterbevollmächtigte¹:

Columbia Management
Investment Advisers, LLC
225 Franklin Street
Boston MA 02110
Vereinigte Staaten von Amerika

Threadneedle Asset
Management Limited
Cannon Place
78 Cannon Street
London EC4N 6AG
Vereinigtes Königreich

Verwaltungsgesellschaft

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

	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities ²
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities
	Threadneedle (Lux) - Global Technology
	Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond ³
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond ⁴
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond ³
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds ⁴
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt ⁴
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds ⁴
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond ⁵
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income ⁶
	Threadneedle (Lux) - Global Focus
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income
	Threadneedle (Lux) - Global Select
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
	Threadneedle (Lux) - American ⁶
	Threadneedle (Lux) - American Select ⁶
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies ⁶
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities ⁷
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies
	Threadneedle (Lux) - European Select
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income ⁷
	Threadneedle (Lux) - UK Equities
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha ⁶
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha
	Threadneedle (Lux) - UK Absolute Alpha
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities
	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity ⁸
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity ⁹
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus ³
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income ⁹
Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited 3 Killiney Road #07-07 Winsland House 1 Singapur 239519 Singapur	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity

STANLIB Asset Management (Pty) Limited
17 Melrose Boulevard
Melrose Arch 2196
Johannesburg
Südafrika

¹Unter der Verantwortlichkeit und Aufsicht von Threadneedle Management Luxembourg S.A.

²Am 1. Juli 2019 wurde Columbia Management Investment Advisers, LLC, zum Unterberater ernannt (zuvor Threadneedle Asset Management Limited). Ab dem 1. Juli gibt Threadneedle Asset Management Limited Anlageempfehlungen für Columbia Management Investment Advisers, LLC (zuvor gab Columbia Management Investment Advisers, LLC Anlageempfehlungen für Threadneedle Asset Management Limited).

³Siehe Erläuterung 1 auf Seite 207.

⁴Threadneedle Asset Management Limited kann vorbehaltlich seiner eigenen Haftung die diskretionäre Anlageverwaltung eines Teils des Portfoliovermögens an Columbia Management Investment Advisers, LLC delegieren.

⁵Am 1. Juli 2019 wurde Threadneedle Asset Management Limited zum Unterberater ernannt (zuvor Threadneedle Investments Singapore (Pte)). Ab dem 1. Juli hat Threadneedle Asset Management Limited die diskretionäre Anlageverwaltung für einen Teil des Vermögens an Threadneedle Investments Singapore (Pte) delegiert.

⁶Columbia Management Investment Advisers, LLC gibt Threadneedle Asset Management Limited Anlageempfehlungen und stellt daher für Threadneedle Asset Management Limited eine auf Analysen gestützte Anlageberatung bereit.

⁷Ab dem 1. Juli 2019 kann Threadneedle Asset Management Limited vorbehaltlich seiner eigenen Haftung die diskretionäre Anlageverwaltung eines Teils des Portfoliovermögens an Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited delegieren.

⁸Die Verwaltungsgesellschaft hat ein Shariah-Aufsichtsgremium ernannt, um die Einhaltung der Shariah-Richtlinien durch das Shariah-Portfolio zu überwachen. Gatehouse Bank plc, 14 Grosvenor Street, London, W1K 4PS, Vereinigtes Königreich, wurde zum Shariah-Berater bestellt.

⁹Columbia Management Investment Advisers, LLC gibt Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited Anlageempfehlungen und stellt daher für Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited eine auf Analysen gestützte Anlageberatung bereit.

Verzeichnis

(Fortsetzung)

Verwahr-, Domizil-, Verwaltungs- und Zahlstelle

Citibank Europe plc, Zweigniederlassung Luxemburg
31, Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Großherzogtum Luxemburg

Register- und Transferstelle

International Financial Data Services (Luxembourg) S.A.
47, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Vertriebsstelle (an verschiedene Vertriebsgesellschaften delegiert)

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

Vertreter und Zahlstellen

In Österreich

Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG
Graben 21
A-1010 Wien
Österreich

In Belgien

CACEIS Belgium S.A
Avenue du Port 86 C b 320
B-1000 Brüssel
Belgien

In Frankreich

CACEIS Bank France
1/3 Place Valhubert
F-75206 Paris Cedex 13
Frankreich

In Deutschland

J.P. Morgan AG
Junghofstraße 14
D-60311 Frankfurt am Main
Deutschland

In Hongkong

HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited
17/F Tower 2 & 3 HSBC Centre
1 Sham Mong Road
Kowloon
Hongkong

In der Schweiz

RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette
Zweigniederlassung Zürich
Bleicherweg 7
CH-8027 Zürich
Schweiz

Wirtschaftsprüfer

PricewaterhouseCoopers, *Société coopérative*
2, rue Gerhard Mercator, B.P. 1443
L-1014 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Rechtsberater in Luxemburg

Linklaters LLP
35 Avenue John F. Kennedy, B.P. 1107
L-1011 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Näheres hierzu erfahren Sie unter columbiathreadneedle.com



Herausgegeben von Threadneedle Management Luxembourg S.A. Eingetragen beim Registre de Commerce et des Sociétés (Luxembourg), Registernummer B 110242, 44, rue de la Vallée, L-2661 Luxembourg, Großherzogtum Luxemburg. Im Vereinigten Königreich: Herausgegeben von Threadneedle Asset Management Limited (TAML). Eingetragen in England und Wales, Registernummer 573204, Cannon Place, 78 Cannon Street, London EC4N 6AG, Vereinigtes Königreich. Im Vereinigten Königreich durch die Financial Conduct Authority zugelassen und beaufsichtigt. Columbia Threadneedle Investments ist der globale Markenname der Unternehmensgruppe von Columbia und Threadneedle. columbiathreadneedle.com 296860