

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Halbjahresbericht und ungeprüfter Abschluss

Für den Berichtszeitraum zum 30. September 2018

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Allgemeine Merkmale

Fondstyp:
OGAW

Anzahl der in der Gesellschaft angebotenen Fonds:
9 Fonds

In der Gesellschaft angebotene Anteilsklassen*:

(Abgesicherte) thesaurierende CHF-Klasse

Thesaurierende EUR-Klasse

Ausschüttende EUR-Klasse

(Abgesicherte) thesaurierende EUR-Klasse

(Abgesicherte) ausschüttende EUR-Klasse

Ausschüttende GBP-Klasse

(Abgesicherte) ausschüttende GBP-Klasse

Thesaurierende USD-Klasse

Ausschüttende USD-Klasse

*Nicht jeder Fonds bietet sämtliche aufgeführten Anteilsklassen an.

Art der Anteile:

Innerhalb jeder Klasse der einzelnen Fonds kann die Gesellschaft, vorbehaltlich des maßgeblichen Nachtrags des Verkaufsprospekts (der „Nachtrag“), ausschüttende Anteile (Anteile, deren Erträge ausgeschüttet werden) und/oder thesaurierende Anteile (Anteile, deren Erträge einbehalten und wiederangelegt werden) ausgeben.

Nettovermögen (Beträge in Tausend):
7.474.325 EUR

Mindestzeichnungsbetrag:

Der PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF, der PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF und der PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF schreiben einen Mindestzeichnungsbetrag von 1.000.000 USD oder die Zeichnung eines Primäranteils vor. Der PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF schreibt einen Mindestzeichnungsbetrag von 1.000.000 USD (oder dem Gegenwert in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse) je Anleger vor.

Der PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF, der PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF und der PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF schreiben einen Mindestzeichnungsbetrag von 1.000.000 EUR oder die Zeichnung eines Primäranteils vor. Der PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF schreibt einen Mindestzeichnungsbetrag von 1.000.000 EUR (oder dem Gegenwert in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse) je Anleger vor.

Der PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF schreibt einen Mindestzeichnungsbetrag von 1.000.000 GBP oder die Zeichnung eines Primäranteils vor.

Der Verwaltungsrat behält sich vor, die Anteilsinhaber in Bezug auf den Mindestbetrag für Erstzeichnungen unterschiedlich zu behandeln und bei bestimmten Anlegern auf einen Mindestzeichnungsbetrag bzw. die Mindesttransaktionsgröße zu verzichten oder diese zu vermindern.

Handelstag:

Ein Handelstag ist für den PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF jeder Tag, an dem die Banken in England für den Geschäftsverkehr geöffnet sind. Handelstage für den PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF, den PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF und den PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF sind alle Tage, an denen die Banken in London für den Geschäftsverkehr geöffnet sind. Handelstage für den PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF, den PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF und den PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF sind alle Tage, an denen die Deutsche Börse AG und Banken in London für den Geschäftsverkehr geöffnet sind. Handelstage für den PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF und den PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF sind alle Tage, an denen die NYSE Arca und Banken in London für den Geschäftsverkehr geöffnet sind. Ungeachtet des Vorstehenden gilt ein Tag nicht als Handelstag für die Fonds, wenn es entweder aufgrund gesetzlicher Feiertage oder aufgrund der Schließung eines Markts/einer Börse in einer Rechtsordnung erschwert wird, (i) den Fonds zu verwalten oder (ii) einen Anteil am Vermögen eines Fonds zu bewerten. Die Fonds sind in jedem Jahr am 01. Januar sowie am 24., 25. und 26. Dezember geschlossen.

Handelstage der einzelnen Fonds können aber auch andere Tage sein, die ggf. von der Gesellschaft festgelegt und den Anteilsinhabern im Voraus mitgeteilt werden, sofern es alle 14 Tage mindestens einen Handelstag gibt.

Funktionale Währung der Fonds:

Die funktionale Währung des PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF, des PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF, des PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF und des PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF ist der US-Dollar (USD oder USD). Die funktionale Währung des PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF, des PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF und des PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF ist der Euro (EUR oder €), und die funktionale Währung des PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF ist das britische Pfund (GBP oder £).

Co-Promoter:

PIMCO Europe Ltd. und Source UK Services Limited fungieren als Co-Promoter der Gesellschaft. Source UK Services Limited ist als Gesellschaft mit beschränkter Haftung in England und Wales eingetragen. Sowohl PIMCO Europe Ltd. als auch Source UK Services Limited wurden von der UK Financial Conduct Authority zugelassen und stehen unter deren Aufsicht.

Inhaltsverzeichnis

Bericht des Vorsitzenden	Seite
Wichtige Informationen über die Fonds	2
Beschreibungen der Benchmark	3
Vermögensaufstellung	13
Gewinn- und Verlustrechnung	14
Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens	19
Aufstellung des Wertpapierbestands	24
Anmerkungen zum Abschluss	27
Wesentliche Veränderungen der Portfoliozusammensetzung	73
Glossar	85
Allgemeine Informationen	95
	97

	Fondszusammenfassung	Aufstellung des Wertpapierbestands
PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF	4	27
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF	5	30
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	6	34
PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF	7	38
PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF	8	44
PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF	9	50
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	10	58
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF	11	64
PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF	12	68

Dieser Halbjahresbericht und der ungeprüfte Abschluss (der „Halbjahresbericht“) können in andere Sprachen übersetzt werden. Jede derartige Übersetzung muss die gleichen Informationen enthalten und die gleiche Bedeutung haben wie der Halbjahresbericht in englischer Sprache. Im Fall von Abweichungen zwischen dem englischen Halbjahresbericht und dem Halbjahresbericht in der anderen Sprache hat der Halbjahresbericht in englischer Sprache Vorrang, außer und nur insoweit, als es nach dem Recht eines Landes, in dem die Anteile verkauft werden, vorgeschrieben ist, dass bei Handlungen auf der Grundlage von Angaben in einem Halbjahresbericht in einer anderen Sprache als Englisch die Sprache des Halbjahresberichts, auf dem diese Handlung basiert, Vorrang hat. Jegliche Streitigkeiten in Bezug auf die Bedingungen des Halbjahresberichts unterliegen ungeachtet der Sprache des Halbjahresberichts irischem Recht und sind diesem entsprechend auszulegen.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Bericht des Vorsitzenden

Sehr geehrte Anteilshaberin, sehr geehrter Anteilshaber,

Im Anschluss an diesen Bericht folgt der Halbjahresbericht von PIMCO Fixed Income Source ETFs plc für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. September 2018. Auf den nachfolgenden Seiten finden Sie nähere Einzelheiten zu den Anlageergebnissen sowie eine Erörterung der Faktoren, die im Berichtszeitraum den stärksten Einfluss auf die Wertentwicklung hatten.

Für den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. September 2018

Die US-Wirtschaft setzte ihre Expansion während des Berichtszeitraums fort. Ein Blick zurück zeigt, dass die jährliche Wachstumsrate des US-amerikanischen Bruttoinlandsprodukts („BIP“) im ersten Quartal 2018 bei 2,2 % lag. Während des zweiten Quartals 2018 stieg die BIP-Wachstumsrate dann auf 4,2 %, was dem stärksten Wachstum seit dem dritten Quartal 2014 entspricht. Den (nach Ablauf des Berichtszeitraums veröffentlichten) vorläufigen Zahlen des Handelsministeriums zufolge lag die jährliche BIP-Wachstumsrate im dritten Quartal 2018 bei 3,5 %.

Die US-Notenbank (Federal Reserve, „Fed“) setzte während des Berichtszeitraums die Normalisierung ihrer Geldpolitik fort. Im Juni 2018 hob sie ihren Leitzins (Federal Funds Rate) auf eine Spanne von 1,75 % bis 2,00 % an. Bei ihrer Sitzung im September 2018 erhöhte sie ihre Zinsen dann erneut auf eine Spanne von 2,00 % bis 2,25 %. Neben der Anhebung ihrer Leitzinsen setzte die Fed den Abbau ihrer Bilanz während des Berichtszeitraums fort.

Die Wirtschaftstätigkeit außerhalb der USA beschleunigte sich zunächst während des Berichtszeitraums, schwächte sich dann im weiteren Verlauf jedoch wieder ein wenig ab. Vor diesem Hintergrund behielten die Europäische Zentralbank („EZB“) und die Bank of Japan ihre äußerst lockere Geldpolitik weitgehend unverändert bei, während andere Zentralbanken auf eine restriktivere Haltung umschwenkten. Die Bank of England hob ihre Zinsen bei ihrer Sitzung im August 2018 an, und die Bank of Canada nahm während des Berichtszeitraums ebenfalls eine Leitzinserhöhung vor. Im Juni 2018 ließ die EZB derweil durchblicken, dass sie beabsichtigt, ihr Programm zur quantitativen Lockerung Ende des Jahres auslaufen zu lassen. Ferner rechnet sie damit, ihre Zinsen „frühestens nach dem Sommer 2019“ anzuheben.

Die Zinsstrukturkurve für US-Staatsanleihen flachte sich während des Berichtszeitraums ab, da die kurzfristigen Zinsen stärker stiegen als ihre längerfristigen Pendanten. Der Anstieg der Zinsen am kurzen Ende der Zinsstrukturkurve war unserer Einschätzung nach vor allem den Zinserhöhungen der Fed zuzuschreiben. Die Rendite auf die als Benchmark angesetzten 10-jährigen US-Staatsanleihen lag zum Ende des Berichtszeitraums bei 3,05 %, nachdem sie zum 31. März 2018 noch 2,74 % betragen hatte.

Am Bloomberg Barclays U.S. Treasury Index gemessen erzielten US-Staatsanleihen während des Berichtszeitraums eine Rendite von -0,49 %. Der Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Index, ein weitläufig verwendeter Index für US-amerikanische Anleihen mit Investment Grade-Rating, rentierte derweil während des Berichtszeitraums mit -0,14 %. Mit höherem Risiko behaftete festverzinsliche Anlageklassen wie etwa hochverzinsliche Unternehmensanleihen und Schuldtitel aus Schwellenländern lieferten gegenüber dem breiten US-Markt durchwachsene Ergebnisse. Der ICE BofAML U.S. High Yield Index legte während des Berichtszeitraums um 3,46 % zu, während auf Fremdwährungen lautende Schwellenmarktanleihen, die vom J.P. Morgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global abgebildet werden, während des Berichtszeitraums eine Rendite von -1,71 % verbuchten. Auf Landeswährungen lautende Schwellenmarktanleihen, die vom J.P. Morgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) abgebildet werden, rentierten im Berichtszeitraum mit -12,06 %. Die Anlageklasse der Schuldtitel aus Schwellenländern wurde durch Anzeichen auf eine Abschwächung des Wachstums in China, die Aufwertung des US-Dollars und erhebliche Schwierigkeiten in Ländern wie Argentinien und der Türkei belastet. Die Lokalwährungen von Schwellenländern waren hiervon Halbjährlicher Bericht des Vorsitzenden zum 30. September 2018 PIMCO Source ETFs plc besonders stark betroffen, so dass viele von ihnen während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar deutlich abgewertet wurden.

Globale Aktien lieferten während des Berichtszeitraums durchwachsene Ergebnisse, während US-Aktien deutlich aufgewertet wurden. Unserer Einschätzung nach war diese Rally auf mehrere Faktoren zurückzuführen, darunter Optimismus bezüglich des im Dezember 2017 verabschiedeten Steuerreformgesetzes sowie häufig über den Erwartungen liegende Unternehmensgewinne. US-Aktien verzeichneten gemessen am S&P 500-Index über den Berichtszeitraum hinweg insgesamt ein Plus von 11,41%. Die am MSCI Emerging Markets Index gemessenen Schwellenmarktaktien rentierten während des Berichtszeitraums mit -8,97 %, während globale Aktien gemessen am MSCI World Index eine Rendite von 6,80 % erzielten. Japanische Aktien verbuchten derweil am Nikkei 225 Index (in JPY) gemessen ein Plus von 8,81 %, während die vom MSCI Europe Index (in EUR) abgebildeten europäischen Aktien während des Berichtszeitraums mit 5,37 % rentierten.

Rohstoffpreise waren starken Schwankungen ausgesetzt und lieferten während des Berichtszeitraums durchwachsene Ergebnisse. Zu Beginn des Berichtszeitraums wurde Rohöl zu etwa 65 USD je Barrel gehandelt, zum Ende des Berichtszeitraums lag der Preis hingegen bei etwa 73 USD je Barrel. Dieser Anstieg war teilweise auf eine geplante und beobachtete Senkung der Fördermengen durch die Organisation ölexportierender Länder (OPEC) sowie den Einbruch der venezolanischen Ölförderung zurückzuführen. Die Gold- und Kupferpreise gaben derweil während des Berichtszeitraums nach.

An den Devisenmärkten schließlich wurden während des Berichtszeitraums Phasen erhöhter Volatilität verzeichnet, was teilweise auf Anzeichen auf eine Entkopplung des Wirtschaftswachstums und der Geldpolitik der Zentralbanken sowie auf eine Reihe geopolitischer Ereignisse zurückzuführen war. Der US-Dollar wurde während des Berichtszeitraums gegenüber anderen bedeutenden Währungen allgemein aufgewertet. So legte der US-Dollar gegenüber dem Euro, dem britischen Pfund und dem japanischen Yen während des Berichtszeitraums beispielsweise um jeweils 6,20 %, 7,63 % bzw. 6,83 % zu.

Vielen Dank für das Vertrauen, das Sie PIMCO entgegengebracht haben. Wir freuen uns, Ihnen unsere globalen ETF-Produkte anbieten zu dürfen. Von unseren ETF-Produkten können Sie das für PIMCO typische Engagement in Bezug auf herausragende Leistungen im Risikomanagement und in der Erzielung von Renditen erwarten. Bei Fragen in Bezug auf die PIMCO Fixed Income Source ETFs plc wenden Sie sich bitte an die Londoner Geschäftsstelle unter der Rufnummer +44 (0) 20 3640 1000 oder für Fragen betreffend den operativen Betrieb an den Administrator unter +353 (0)1 776 9990. Weitere Informationen finden Sie auch unter sourceeff.com.

Mit freundlichen Grüßen,



Craig A. Dawson
Vorsitzender

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse. Sofern nichts Anderweitiges angegeben ist, spiegeln Indexrenditen die Wiederanlage etwaiger Ertragsausschüttungen und Kapitalgewinne wider; Gebühren, Maklerprovisionen und sonstige Anlagekosten bleiben jedoch unberücksichtigt. Eine Direktanlage in einem nicht aktiv verwalteten Index ist nicht möglich.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Wichtige Informationen über die Fonds

Dieses Dokument darf nur in Verbindung mit dem aktuellen Verkaufsprospekt der PIMCO Fixed Income Source ETFs plc verwendet werden. Anleger sollten vor einer Anlage die Anlageziele, Risiken, Gebühren und Aufwendungen jedes Fonds sorgfältig abwägen. Diese und andere Informationen sind im Nachtrag zum Verkaufsprospekt der jeweiligen Fonds enthalten. Bitte lesen Sie den Verkaufsprospekt sorgfältig, bevor Sie eine Anlage tätigen oder Geld überweisen.

Der PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF, der PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF und der PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF sind börsengehandelte Fonds (Exchange-Traded Funds, „ETFs“), die eine Rendite erzielen sollen, die möglichst genau die Gesamrendite vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen des angegebenen Index abbilden sollen (zusammen die „passiv verwalteten Fonds“). Die passiv verwalteten Fonds verfolgen bei der Erreichung ihres Anlageziels eine repräsentative Stichprobenstrategie; daher kann es sein, dass die Fonds nicht alle im zugrunde liegenden Index enthaltenen Wertpapiere halten. Der PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF, der PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF, der PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF, der PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF, der PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF und der PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF sind im Gegensatz zu passiven Fonds aktiv verwaltete ETFs, die nicht die Abbildung der Wertentwicklung eines bestimmten Index anstreben (zusammen die „aktiv verwalteten Fonds“ und zusammen mit den passiv verwalteten Fonds die „Fonds“). Der PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF, der PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF, der PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF, der PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF und der PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF werden an der Euronext Dublin („Euronext“) handelnden Irish Stock Exchange notiert und an der London Stock Exchange gehandelt. Die Anteile des PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF, des PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF, des PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF und des PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF sind an der Deutsche Börse AG zugelassen und werden dort zu Marktpreisen gehandelt. Die Fonds sind auch auf anderen Sekundärmärkten zugelassen und werden dort gehandelt. Der Marktpreis für die Anteile der jeweiligen Fonds kann vom Nettoinventarwert („NIW“) des Fonds abweichen. Die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen jedes Fonds mit Ausnahme des PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF und des PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF erfolgen zum jeweiligen Nettoinventarwert in Blöcken einer spezifizierten Anzahl von Anteilen („Primäranteile“). Nur bestimmte große institutionelle Anleger dürfen Primäranteile direkt bei den Fonds zum NIW kaufen oder zurückgeben („befugte Teilnehmer“). Anleger am Sekundärmarkt können in Situationen, in denen der Börsenwert der Anteile sich erheblich vom NIW unterscheidet, ihre Anteile direkt zurückgeben. Diese Transaktionen werden im Tausch gegen bestimmte Wertpapiere, die ähnlich zum Portfolio eines Fonds sind, und/oder gegen Barzahlung durchgeführt.

Die Fonds investieren in bestimmte Segmente des Wertpapiermarktes, die nicht repräsentativ für die breiteren Wertpapiermärkte sind. Zwar sind wir der Ansicht, dass Rentenfonds eine wichtige Rolle in einem breit gestreuten Anlageportfolio spielen, dennoch sollte eine Anlage in einem Fonds alleine kein vollständiges Anlageprogramm darstellen. Es ist zu beachten, dass in einem Umfeld potenziell steigender Zinsen ein tatsächlicher Zinsanstieg die Wertentwicklung der meisten Rentenfonds nachteilig beeinflussen würde und dass die von den Fonds gehaltenen festverzinslichen Wertpapiere wahrscheinlich an Wert verlieren werden. Auch die Preisvolatilität festverzinslicher Wertpapiere kann bei steigenden Zinssätzen zunehmen, was zu erhöhten Verlusten für die Fonds führen könnte. Rentenfonds und einzelne Anleihen mit einer längeren Duration (eine Kennzahl für die erwartete Laufzeit eines Wertpapiers) sind meist anfälliger für Zinsänderungen, weshalb sie normalerweise volatil sind als Wertpapiere oder Fonds mit einer kürzeren Duration.

Die Fonds sind unter Umständen neben den oben beschriebenen Risiken noch weiteren Risiken ausgesetzt. Zu diesen Risiken gehören insbesondere die folgenden: Markthandelsrisiko, Zinsrisiko, Kreditrisiko, Marktrisiko, Liquiditätsrisiko, Derivatrisiko, Hebelrisiko, Emittentenrisiko, Risiko in Verbindung mit hypothekenbesicherten und sonstigen besicherten Wertpapieren, Risiko von Auslandsanlagen, Schwellenländerrisiko und Management-Risiko. Eine vollständige Beschreibung dieser und anderer Risiken ist im Verkaufsprospekt der Gesellschaft enthalten. Die Fonds können derivative Finanzinstrumente zu Sicherungszwecken oder als Teil einer Anlagestrategie einsetzen. Der Einsatz dieser Instrumente ist mit bestimmten Kosten und Risiken wie Liquiditätsrisiko, Zinsrisiko, Marktrisiko, Kreditrisiko, Management-Risiko sowie dem Risiko verbunden, dass ein Fonds eine Position nicht dann glattstellen konnte, wenn es am vorteilhaftesten wäre. Ein Fonds könnte mehr als den in diese derivativen Finanzinstrumente investierten Kapitalbetrag verlieren. Die Bonität eines bestimmten Wertpapiers oder einer bestimmten Gruppe von Wertpapieren kann nicht die Stabilität oder Sicherheit des gesamten Portfolios garantieren.

Die Grafik zur Netto-Wertentwicklung in jeder in diesem Halbjahresbericht enthaltenen Fondszusammenfassung misst die Wertentwicklung unter der Annahme, dass sämtliche Dividendenausschüttungen und Ausschüttungen von Kapitalgewinnen reinvestiert werden. Die Renditen verstehen sich ohne Abzug von Steuern, die ein Anteilinhaber für folgende Sachverhalte zu zahlen hatte: (i) Ausschüttungen der Fonds; oder (ii) Rückgabe von Fondsanteilen. Die Grafik zur Netto-Wertentwicklung misst die Wertentwicklung jedes Fonds im Vergleich zur Wertentwicklung eines breit angelegten Wertpapiermarkindex (Benchmarkindex). Die Wertentwicklung eines Fonds in der Vergangenheit (vor und nach Steuern) ist nicht unbedingt ein Hinweis auf die künftige Wertentwicklung des Fonds. Eine Anlage in einem Fonds ist keine Einlage bei einer Bank und ist nicht durch die Bundeseinlagenversicherung der USA (Federal Deposit Insurance Corporation) oder eine andere staatliche Behörde garantiert oder versichert. Durch Anlagen in den Fonds kann es zum Verlust von Geldern kommen.

Die Fonds können eine vollständige Aufstellung der Portfoliopositionen und ihres prozentualen Anteils am Nettovermögen des jeweiligen Fonds zur Verfügung stellen. An jedem Geschäftstag, vor Beginn des Handels an den relevanten Börsen (wie im Verkaufsprospekt definiert), veröffentlicht jeder Fonds unter www.sourceetf.com die Bezeichnungen und die Mengen der Portfoliopositionen des Fonds; diese Angaben bilden die Grundlage für die Berechnung des Nettoinventarwerts des Fonds am Ende des entsprechenden Geschäftstages. Die Factsheets der Fonds bieten zusätzliche Informationen in Bezug auf einen Fonds und können telefonisch unter der Rufnummer +44 (0) 20 3640 1000 angefordert werden.

PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2018¹

Auf EUR lautende Klassen	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
Ausschüttende EUR-Klasse (aufgelegt am 17. Dez. 2013)	(0,43 %)	2,75 %
Bloomberg Barclays Euro Aggregate Covered 3 % Cap	(0,15 %)	2,12 %

¹ Annualisierte Rendite nach Gebühren und Aufwendungen für Anteilsklassen, die vor mehr als einem Jahr aufgelegt wurden.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Fonds verfolgt das Anlageziel, in Einklang mit umsichtiger Anlageverwaltung den Gesamtertrag zu maximieren. Dieses Ziel verfolgt der Fonds durch die Anlage in ein aktiv gemanagtes Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert). Davon werden gemäß den im Verkaufsprospekt dargelegten Richtlinien mindestens 80 % in Covered Bonds (gedeckte Schuldverschreibungen) investiert. Covered Bonds sind Wertpapiere, die von einem Finanzinstitut emittiert und durch eine Gruppe von Krediten in der Bilanz des Finanzinstituts (dem so genannten Deckungsstock) besichert werden.

Portfolioinformationen

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Eine Übergewichtung schwedischer Covered Bonds wirkte sich positiv auf die relative Rendite aus, da diese Wertpapiere positive Renditen verbuchten.
- » Eine Untergewichtung italienischer Duration wirkte sich positiv auf die relative Rendite aus, da Renditen abverkauft wurden.
- » Die Zinspositionierung in Großbritannien wirkte sich positiv auf die relative Performance aus, da Renditen abverkauft wurden.
- » Die Zinspositionierung in Deutschland belastete die relative Performance, da sich die Kurve abflachte.
- » Positionen in ausgewählten Covered Bonds aus Schwellenländern belasteten die relative Performance, da diese Wertpapiere negative Renditen verbuchten.
- » Eine Untergewichtung niederländischer Covered Bonds dämpfte die relative Performance, da diese Wertpapiere positive Renditen verbuchten.

PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2018¹

Auf USD lautende Klassen	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
Thesaurierende USD-Klasse (aufgelegt am 19. Sept. 2011)	(11,97 %)	(0,99 %)
Ausschüttende USD-Klasse (aufgelegt am 23. Jan. 2014)	(11,95 %)	(1,28 %)
PIMCO Emerging Market Advantage Local Currency Government Bond Index	(11,83 %)	(0,61 %) ²

¹ Annualisierte Rendite nach Gebühren und Aufwendungen für Anteilsklassen, die vor mehr als einem Jahr aufgelegt wurden.

² Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, eine Rendite zu erzielen, die vor Kosten und Gebühren dem Gesamtertrag des PIMCO Emerging Markets Advantage Local Currency Bond Index (der „Index“) entspricht. Der Fonds investiert sein Vermögen in ein diversifiziertes Portfolio von nicht auf den US-Dollar lautenden festverzinslichen Instrumenten (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition), welches sich, soweit dies möglich und praktisch umsetzbar ist, aus den Wertpapieren zusammensetzt, die die Komponenten des Index bilden. (Zur Klarstellung: Dies bedeutet mindestens 80 % des Nettoinventarwerts des Fonds.). Der Fonds kann direkt in die Wertpapiere investieren, die eine Komponente des Index bilden, oder über derivative Instrumente wie Swaps ein indirektes Engagement in diesen Wertpapieren eingehen. Der Index bildet die Wertentwicklung eines BIP-gewichteten Korbs lokaler Schwellenländer-Staatsanleihen, Währungen oder Devisenterminkontrakte ab, vorbehaltlich eines Maximalengagements von 15 % je Land.

Portfolioinformationen

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement des Fonds in Währungen wie der türkischen Lira, dem russischen Rubel und dem brasilianischen Real wirkte sich negativ auf die Wertentwicklung aus, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar fielen.
- » Das Engagement des Fonds in lokalen Renditen von Schwellenländern wie der Türkei, Russland und Indonesien wirkte sich negativ auf die Wertentwicklung aus, da diese lokalen Renditen allgemein stiegen.

PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2018¹

Auf EUR lautende Klassen	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
Thesaurierende EUR-Klasse (aufgelegt am 09. Okt. 2017)	(0,30 %)	(0,20 %)
Ausschüttende EUR-Klasse (aufgelegt am 09. Okt. 2017)	(0,28 %)	(0,19 %)
ICE BofAML 0-5 Year Euro Developed Markets High Yield 2 % Constrained Index	0,07 %	(0,37 %)

¹ Annualisierte Rendite nach Gebühren und Aufwendungen für Anteilsklassen, die vor mehr als einem Jahr aufgelegt wurden.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Fonds verfolgt das Anlageziel, einen Ertrag zu erwirtschaften, der vor Gebühren und Aufwendungen möglichst genau dem Gesamtertrag des ICE BofAML 0-5 Year Euro Developed Markets High Yield 2% Constrained Index (der „Index“) entspricht. Der Fonds investiert sein Vermögen in ein diversifiziertes Portfolio von auf den Euro lautenden festverzinslichen Instrumenten (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) welches, soweit dies möglich und praktisch umsetzbar ist, aus den Wertpapieren besteht, die die Komponenten des Index bilden. (Zur Klarstellung: Dies bedeutet mindestens 80 % des Nettoinventarwerts des Fonds.). Der Fonds kann direkt in die Wertpapiere investieren, die eine Komponente des Index bilden, oder über derivative Instrumente wie Swaps ein indirektes Engagement in diesen Wertpapieren eingehen. Der ICE BofAML 0-5 Year Euro Developed Markets High Yield 2% Constrained Index bildet die Wertentwicklung kurzlaufender auf Euro lautender Unternehmensanleihen unter Investment-Grade nach, die auf dem Euro-Inlandsmarkt oder den Eurobond-Märkten öffentlich emittiert werden, darunter auch Anleihen, „Pay-In-Kind“-Wertpapiere und Toggle Notes. Sich eignende Wertpapiere müssen eine Restlaufzeit von unter fünf Jahren, ein Rating unter Investment-Grade (basierend auf einem Durchschnitt von Moody's, S&P und Fitch), einen festen Zinszahlungsplan und ein im Umlauf befindliches Mindestvolumen von 250 Mio. USD haben. Ferner müssen Emittenten geeigneter Wertpapiere ihren Sitz in Investment-Grade-Ländern haben, die Mitglieder der G10-Staaten, Westeuropas oder Territorien der USA und Westeuropas sind oder einen wesentlichen Teil ihrer Geschäftstätigkeit dort ausüben.

Portfolioinformationen

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Ein untergewichtetes Engagement bei ausgewählten Emittenten im Bausektor, der unter Druck geriet, steigerte die Performance.
- » Ein untergewichtetes Engagement bei einem ausgewählten Emittenten im Bereich der diversifizierten Fertigung, der unter Druck geriet, steigerte die Performance.
- » Eine Übergewichtung des Bankensektors, der sich im Berichtszeitraum unterdurchschnittlich entwickelte, schmälerte die Performance.
- » Eine Untergewichtung des Telekommunikationssektors, der sich im Berichtszeitraum überdurchschnittlich entwickelte, schmälerte die Performance.
- » Eine Untergewichtung des Energiesektors, der sich im Berichtszeitraum überdurchschnittlich entwickelte, schmälerte die Performance.

PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2018¹

Auf EUR lautende Klassen	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
Thesaurierende EUR-Klasse (aufgelegt am 30. Apr. 2015)	(0,74 %)	(0,37 %)
Ausschüttende EUR-Klasse (aufgelegt am 11. Jan. 2011)	(0,75 %)	0,49 %
Eonia [®] - Euro OverNight Index Average	(0,18 %)	0,03 % ²

¹ Annualisierte Rendite nach Gebühren und Aufwendungen für Anteilsklassen, die vor mehr als einem Jahr aufgelegt wurden.

² Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, einen maximalen laufenden Ertrag bei Kapitalerhalt und täglicher Liquidität zu erzielen. Der Fonds investiert primär in ein aktiv verwaltetes diversifiziertes Portfolio von auf den Euro lautenden festverzinslichen Wertpapieren (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) mit unterschiedlichen Laufzeiten, darunter Staatsanleihen und von Regierungen, ihren Organen, Behörden oder Körperschaften begebene oder garantierte Wertpapiere, Unternehmensanleihen und hypotheckenbesicherte oder sonstige besicherte Wertpapiere (MBS- und ABS-Titel). Der Fonds kann versuchen, am Markt ein Engagement in den Wertpapieren, in die er primär investiert, einzugehen, indem er eine Reihe von Kauf- und Verkaufsverträgen abschließt oder andere Anlagetechniken (wie z. B. Rückkäufe) einsetzt. Es wird erwartet, dass die gewichtete durchschnittliche Laufzeit des Fonds 3 Jahre nicht übersteigen wird. Die durchschnittliche Duration des Fondsportfolios wird auf Grundlage der Zinsprognosen der Anlageberater bis zu einem Jahr betragen. Der Fonds investiert ausschließlich in Titel mit Investment-Grade, die von Moody's mit einem Rating von Baa3 bzw. von S&P mit einem Rating von BBB- oder von Fitch mit einem äquivalenten Rating bewertet wurden (bzw. die, sollte kein Bonitätsrating vorliegen, nach Ansicht der Anlageberater von vergleichbarer Qualität sind). Der Fonds darf maximal 5 % seines Vermögens in festverzinsliche Wertpapiere aus Schwellenmärkten investieren.

Portfolioinformationen

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Ein moderates Engagement bei ausgewählten Schuldtiteln quasi-staatlicher Emittenten steigerte die absolute Performance, da diese Wertpapiere positive Gesamtrenditen erzielten.
- » Positionen in ausgewählten Unternehmensanleihen mit Investment Grade-Rating steigerten die absolute Performance aufgrund positiver Erträge und einer günstigen Titelauswahl.
- » Eine negative EUR-Barrendite belastete die absolute Wertentwicklung ebenso wie ausgewählte Positionen bei italienischen Staatsanleihen, da Renditen abverkauft wurden.
- » Ausgewählte Positionen in staatsnahen Vermögenswerten verminderten die absolute Performance, da diese Wertpapiere negative Gesamtrenditen erzielten.

PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2018¹

Auf EUR lautende Klassen	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
Ausschüttende EUR-Klasse (aufgelegt am 17. Nov. 2014)	(0,02 %)	1,63 %
ICE BofAML 1-5 Year Euro Corporate Index	(0,00 %)	1,15 %

¹ Annualisierte Rendite nach Gebühren und Aufwendungen für Anteilsklassen, die vor mehr als einem Jahr aufgelegt wurden.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Fonds verfolgt das Anlageziel, in Einklang mit umsichtiger Anlageverwaltung den Gesamtertrag zu maximieren. Der Fonds strebt sein Anlageziel an, indem er primär in ein aktiv verwaltetes diversifiziertes Portfolio von auf den Euro lautenden festverzinslichen Unternehmensanleihen mit Investment Grade (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) investiert. Der Fonds setzt zur Auswahl seiner Anlagen das auf die Gesamtrendite ausgerichtete Anlageverfahren des Anlageberaters ein. Es werden Top-down- und Bottom-up-Strategien verfolgt, um verschiedene diversifizierte Wertfaktoren ausfindig zu machen und so beständige Erträge zu erwirtschaften. Top-down-Strategien werden unter Berücksichtigung gesamtwirtschaftlicher Einschätzungen der Kräfte herangezogen, die sich mittelfristig auf die Weltwirtschaft und die Finanzmärkte auswirken dürften. Bottom-up-Strategien liegen der Titelauswahl zugrunde und dienen der Ermittlung und Analyse unterbewerteter Wertpapiere.

Portfolioinformationen

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Ein untergewichtetes Engagement in der europäischen Duration, insbesondere an der Drei-Jahres-Marke, wirkte sich positiv auf die Performance aus, da die Zinsen einen Abverkauf erlebten.
- » Die Titelauswahl im Mediensektor steigerte die Performance.
- » Eine Untergewichtung des Telekommunikationssektors steigerte die Performance, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Eine Untergewichtung des Versorgungssektors, der den Gesamtmarkt übertraf, schmälerte die Performance.
- » Eine Untergewichtung des Energiesektors, der den Gesamtmarkt während des Berichtszeitraums übertraf, schmälerte die Performance.

PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2018¹

	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
Auf USD lautende Klassen		
Ausschüttende USD-Klasse (aufgelegt am 17. Nov. 2014)	0,59 %	2,42 %
ICE BofAML 1-5 Year US Corporate Index	1,01 %	1,78 %
Auf CHF lautende Klassen		
(Abgesicherte) thesaurierende CHF-Klasse (aufgelegt am 30. Apr. 2015)	(0,98 %)	0,05 %
ICE BofAML 1-5 Year US Corporate Index (CHF Hedged)	(0,57 %)	(0,64 %)

¹ Annualisierte Rendite nach Gebühren und Aufwendungen für Anteilsklassen, die vor mehr als einem Jahr aufgelegt wurden.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Fonds verfolgt das Anlageziel, in Einklang mit umsichtiger Anlageverwaltung den Gesamtertrag zu maximieren. Der Fonds strebt sein Anlageziel an, indem er primär in ein aktiv verwaltetes diversifiziertes Portfolio von auf den US-Dollar lautenden festverzinslichen Unternehmensanleihen mit Investment Grade (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) investiert. Der Fonds setzt zur Auswahl seiner Anlagen das auf die Gesamtrendite ausgerichtete Anlageverfahren des Anlageberaters ein. Es werden Top-down- und Bottom-up-Strategien verfolgt, um verschiedene diversifizierte Wertfaktoren ausfindig zu machen und so beständige Erträge zu erwirtschaften. Top-down-Strategien werden unter Berücksichtigung gesamtwirtschaftlicher Einschätzungen der Kräfte herangezogen, die sich mittelfristig auf die Weltwirtschaft und die Finanzmärkte auswirken dürften. Bottom-up-Strategien liegen der Titelauswahl zugrunde und dienen der Ermittlung und Analyse unterbewerteter Wertpapiere.

Portfolioinformationen

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Eine Übergewichtung des Finanzdienstleistungssektors, der sich überdurchschnittlich entwickelte, steigerte die Performance.
- » Eine Untergewichtung der US-Duration, insbesondere bis zur Drei-Jahres-Marke, wirkte sich positiv auf die Performance aus, da die Zinsen einen Abverkauf erlebt haben.
- » Eine Übergewichtung des Pipeline-Sektors, der sich überdurchschnittlich entwickelte, steigerte die Performance.
- » Ein Long-Engagement im argentinischen Peso, der gegenüber dem US-Dollar zurückging, schmälerte die Performance.
- » Eine Übergewichtung des Bankensektors, der sich unterdurchschnittlich entwickelte, schmälerte die Performance.

PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2018¹

Anlageziel und Überblick über die Strategie

	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
Auf USD lautende Klassen		
Thesaurierende USD-Klasse (aufgelegt am 30. Apr.2015)	3,22 %	4,72 %
Ausschüttende USD-Klasse (aufgelegt am 14. März 2012)	3,21 %	5,31 %
ICE BofAML 0-5 Year US High Yield Constrained Index	3,70 %	5,91 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
(Abgesicherte) thesaurierende CHF-Klasse (aufgelegt am 28. Mai 2015)	1,66 %	2,38 %
ICE BofAML 0-5 Year US High Yield Constrained Index (CHF Hedged)	2,15 %	2,87 %
Auf EUR lautende Klassen		
(Abgesicherte) ausschüttende EUR-Klasse (aufgelegt am 16. Okt. 2013)	1,85 %	3,00 %
(Abgesicherte) thesaurierende EUR-Klasse (aufgelegt am 11. Dez. 2017)	1,85 %	1,28 %
ICE BofAML 0-5 Year US High Yield Constrained Index (EUR Hedged)	2,32 %	3,50 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
(Abgesicherte) ausschüttende GBP-Klasse (aufgelegt am 16. Nov. 2015)	2,48 %	6,21 %
ICE BofAML 0-5 Year US High Yield Constrained Index (GBP Hedged)	2,89 %	6,98 %

¹ Annualisierte Rendite nach Gebühren und Aufwendungen für Anteilsklassen, die vor mehr als einem Jahr aufgelegt wurden.

² Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.

Der Fonds verfolgt das Anlageziel, einen Ertrag zu erwirtschaften, der vor Gebühren und Aufwendungen möglichst genau dem Gesamtertrag des ICE BofAML 0-5 Year US High Yield Constrained Index (der „Index“) entspricht. Der Fonds investiert sein Vermögen in ein diversifiziertes Portfolio von auf den US-Dollar lautenden festverzinslichen Instrumenten (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) welches, soweit dies möglich und praktisch umsetzbar ist, aus den Wertpapieren besteht, die die Komponenten des Index bilden. (Zur Klarstellung: Dies bedeutet mindestens 80 % des Nettoinventarwerts des Fonds.). Der Fonds kann direkt in die Wertpapiere investieren, die eine Komponente des Index bilden, oder über derivative Instrumente wie Swaps ein indirektes Engagement in diesen Wertpapieren eingehen. Der Index bildet die Wertentwicklung kurzlaufender auf US-Dollar lautender Unternehmensanleihen unter Investment Grade nach, die auf dem US-Markt öffentlich emittiert werden, einschließlich Anleihen, „Rule 144a“-Wertpapiere und „Pay-In-Kind“-Wertpapiere (diese Wertpapiere leisten Zinszahlungen in Form zusätzlicher Wertpapiere), Toggle Notes inbegriffen. Sich eignende Wertpapiere müssen eine Restlaufzeit von unter fünf Jahren, ein Rating unter Investment-Grade (basierend auf einem Durchschnitt von Moody's, S&P und Fitch), einen festen Zinszahlungsplan und ein im Umlauf befindliches Mindestvolumen von 250 Mio. USD haben. Ferner müssen Emittenten geeigneter Wertpapiere ihren Sitz in Investment-Grade-Ländern haben, die Mitglieder der G10-Staaten, Westeuropas oder Territorien der USA und Westeuropas sind oder einen wesentlichen Teil ihrer Geschäftstätigkeit dort ausüben.

Portfolioinformationen

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Ein Rückgang der Anleiherenditen wirkte sich positiv auf die Kursrenditen des Fonds aus.
- » Die Ertragsrenditen lieferten einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung des Fonds.

PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2018¹

Auf GBP lautende Klassen	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
Ausschüttende GBP-Klasse (aufgelegt am 10. Juni 2011)	0,25 %	0,76 %
ICE BofAML Sterling Govt Bill Index	0,26 %	0,52 %

¹ Annualisierte Rendite nach Gebühren und Aufwendungen für Anteilsklassen, die vor mehr als einem Jahr aufgelegt wurden.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, einen maximalen laufenden Ertrag bei Kapitalerhalt und täglicher Liquidität zu erzielen. Der Fonds investiert primär in ein aktiv verwaltetes diversifiziertes Portfolio von auf das britische Pfund lautenden festverzinslichen Wertpapieren (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) mit unterschiedlichen Laufzeiten, darunter Staatsanleihen und von Regierungen, ihren Organen, Behörden oder Körperschaften begebene oder garantierte Wertpapiere, Unternehmensanleihen und ungehebelte hypotheckenbesicherte oder sonstige besicherte Wertpapiere (MBS- und ABS-Titel). Der Fonds kann versuchen, am Markt ein Engagement in den Wertpapieren, in die er primär investiert, einzugehen, indem er eine Reihe von Kauf- und Verkaufsverträgen abschließt oder andere Anlagetechniken (wie z. B. Rückkäufe) einsetzt. Der Fonds darf ohne Einschränkungen in hypotheckenbesicherte oder sonstige besicherte Wertpapiere (MBS- und ABS-Titel) investieren. Es wird erwartet, dass die gewichtete durchschnittliche Laufzeit des Fonds 3 Jahre nicht übersteigen wird. Die durchschnittliche Duration des Fondsportfolios wird auf Grundlage der Zinsprognosen der Anlageberater bis zu einem Jahr betragen. Der Fonds investiert ausschließlich in Titel mit Investment-Grade, die von Moody's mit einem Rating von Baa3 bzw. von S&P mit einem Rating von BBB- oder von Fitch mit einem äquivalenten Rating bewertet wurden (bzw. die, sollte kein Bonitätsrating vorliegen, nach Ansicht der Anlageberater von vergleichbarer Qualität sind). Der Fonds darf maximal 5 % seines Vermögens in festverzinsliche Wertpapiere aus Schwellenmärkten investieren.

Portfolioinformationen

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » Das Engagement bei britischer Duration wirkte sich positiv auf die absolute Performance aus, da die Barrendite positiv ausfiel.
- » Das Engagement in schwedischen Covered Bonds steigerte die absolute Performance, da diese Wertpapiere positive Renditen erzielten.
- » Ausgewählte Positionen in staatsnahen Vermögenswerten verminderten die absolute Performance, da diese Wertpapiere negative Gesamtrenditen verbuchten.

PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den Zeitraum zum 30. September 2018¹

Auf USD lautende Klassen	6 Monate	Seit Auflegung der Klasse
Ausschüttende USD-Klasse (aufgelegt am 22. Feb. 2011)	1,19 %	1,25 %
FTSE 3-Month Treasury Bill Index	0,94 %	0,35 %

¹ Annualisierte Rendite nach Gebühren und Aufwendungen für Anteilsklassen, die vor mehr als einem Jahr aufgelegt wurden.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, einen maximalen laufenden Ertrag bei Kapitalerhalt und täglicher Liquidität zu erzielen. Der Fonds investiert primär in ein aktiv verwaltetes diversifiziertes Portfolio von auf US-Dollar lautenden festverzinslichen Wertpapieren (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) mit unterschiedlichen Laufzeiten, darunter Staatsanleihen und von Regierungen, ihren Organen, Behörden oder Körperschaften begebene oder garantierte Wertpapiere, Unternehmensanleihen und hypotheckenbesicherte oder forderungsbesicherte Wertpapiere (MBS- und ABS-Titel). Der Fonds kann versuchen, am Markt ein Engagement in den Wertpapieren, in die er primär investiert, einzugehen, indem er eine Reihe von Kauf- und Verkaufsverträgen abschließt oder andere Anlagetechniken (wie z. B. Rückkäufe) einsetzt. Der Fonds darf ohne Einschränkungen in hypotheckenbesicherte oder forderungsbesicherte Wertpapiere (MBS- und ABS-Titel) investieren. Es wird erwartet, dass die gewichtete durchschnittliche Laufzeit des Fonds 3 Jahre nicht übersteigen wird. Die durchschnittliche Duration des Fondsportfolios wird auf Grundlage der Zinsprognosen der Anlageberater bis zu einem Jahr betragen. Der Fonds darf maximal 5 Prozent seines Vermögens in festverzinsliche Wertpapiere aus Schwellenmärkten investieren und investiert ausschließlich in Titel mit Investment-Grade, die von Moody's mit einem Rating von Baa3 bzw. von S&P mit einem Rating von BBB- oder von Fitch mit einem äquivalenten Rating bewertet wurden (bzw. die, sollte kein Bonitätsrating vorliegen, nach Ansicht der Anlageberater von vergleichbarer Qualität sind).

Portfolioinformationen

Die folgenden Faktoren hatten während des Berichtszeitraums Einfluss auf die Wertentwicklung:

- » US-Zinsstrategien kamen der Performance gegenüber der Benchmark zugute, da sie einen höheren Carry über den Roll-Down der Zinsstrukturkurve erzielten.
- » Das Engagement bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade kam der Wertentwicklung zugute, da diese Wertpapiere allgemein positive Gesamtrenditen erzielten.
- » Das Engagement bei verbrieften Schuldtiteln steigerte die Performance, da diese Wertpapiere allgemein positive Gesamtrenditen erzielten.
- » Positionen bei auf US-Dollar lautenden Schuldtiteln aus Schwellenländern steigerten die Performance, da der Sektor die Wertentwicklung von US-Staatsanleihen mit ähnlicher Laufzeit übertraf.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Beschreibungen der Benchmark

ICE BofAML Sterling Govt Bill Index

Der ICE BofAML Sterling Govt Bill Index bildet die Entwicklung der von der britischen Regierung auf dem britischen Markt begebenen auf GBP lautenden Schatzanleihen nach.

Bloomberg Barclays Euro Aggregate Covered 3 % Cap

Der Bloomberg Barclays Euro Aggregate Covered 3% Cap Index bildet die Wertentwicklung von auf Euro lautenden gedeckten Schuldverschreibungen ab. Aufnahmekriterium ist die Währung, auf die die Emission lautet, nicht der Sitz des Emittenten. Infrage kommende Wertpapiere müssen ein Investment-Grade-Rating aufweisen (basierend auf einem Durchschnitt aus Moody's, S&P und Fitch), eine Restlaufzeit von mindestens einem Jahr, einen fixen Kuponplan und einen ausstehenden Mindestrestbetrag von 300 Millionen Euro. Die Indexkomponenten sind kapitalisierungsgewichtet, basierend auf dem aktuell ausstehenden Betrag. Das gilt unter dem Vorbehalt, dass die Allokation auf einen einzelnen Emittenten insgesamt 3 % nicht überschreiten darf.

ICE BofAML 1-5 Year Euro Corporate Index

Der ICE BofA Merrill Lynch 1-5 Year Euro Corporate Index bietet Engagement in auf den Euro lautenden Unternehmensanleihen mit Investment Grade von Emittenten aus den Sektoren Industrie, Versorgung und Finanzen mit einer Restlaufzeit von unter 5 Jahren.

ICE BofAML 1-5 Year US Corporate Index

Der ICE BofA Merrill Lynch 1-5 Year US Corporate Index bietet Engagement in auf den US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen mit Investment Grade von Emittenten aus den Sektoren Industrie, Versorgung und Finanzen mit einer Restlaufzeit von unter 5 Jahren.

ICE BofAML 0-5 Year US High Yield Constrained Index

Der ICE BofA Merrill Lynch 0-5 Year US High Yield Constrained Index bildet die Wertentwicklung kurzlaufender auf US-Dollar lautender Unternehmensanleihen unter Investment-Grade nach, die auf dem US-Markt emittiert werden, eine Restlaufzeit von unter fünf Jahren, einen festen Zinszahlungsplan und ein im Umlauf befindliches Mindestvolumen von 100 Mio. USD haben. Vor dem 30. September 2016 mussten die Wertpapiere ein im Umlauf befindliches Mindestvolumen von 100 Mio. USD aufweisen. Positionen in einzelnen Emittenten sind auf 2 % beschränkt.

ICE BofAML 0-5 Year Euro Developed Markets High Yield 2 % Constrained Index

Der ICE BofAML 0-5 Year Euro Developed Markets High Yield 2 % Constrained Index setzt sich aus auf Euro lautenden Unternehmensanleihen unter Investment-Grade mit einer Restlaufzeit von weniger als 5 Jahren zusammen, die an den europäischen Inlandsmärkten öffentlich emittiert werden.

FTSE 3-Month Treasury Bill Index

Der FTSE 3-Month Treasury Bill Index ist ein nicht aktiv verwalteter Index, der die monatlichen Ertragsäquivalente der durchschnittlichen Renditen der in den letzten drei Monaten emittierten Treasury Bills abbildet.

PIMCO Emerging Market Advantage Local Currency Government Bond Index

Der PIMCO Emerging Markets Advantage Local Currency Government Bond Index bildet die Wertentwicklung eines BIP-gewichteten Korbs lokaler Schwellenländer-Staatsanleihen, -Währungen oder Devisenterminkontrakte ab, vorbehaltlich eines Maximalengagements von 15 % je Land. Jeweils jährlich werden die Länder ausgewählt und ihre Gewichtungen festgelegt. Geeignete Länder müssen im Schnitt mindestens eine Länderbonität von BB- (nach Bewertung durch eine anerkannte Rating-Agentur) aufweisen, mehr als 0,3 % des globalen BIP repräsentieren, nach dem von der Weltbank veröffentlichten Bruttonationaleinkommen pro Kopf als Land mit mittlerem oder geringem Einkommen ausgewiesen sein und über einen liquiden lokalen Anleihen- oder Devisenmarkt verfügen. Länder, deren interne oder externe Kreditaufnahme EU- oder US-Sanktionen unterliegt, kommen für den Index nicht infrage.

Eonia® – Euro OverNight Index Average

Eonia® – Euro OverNight Index Average ist der effektive Tagesreferenzzinssatz für den Euro. Er wird als gewichteter Durchschnitt aller unbesicherten Tagesgeldausleihungen im Interbankenmarkt berechnet, die die entsprechenden Banken in der Eurozone eingehen.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Vermögensaufstellung

	PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF		PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF	
	Zum 30. Sept. 2018	Zum 31. März 2018	Zum 30. Sept. 2018	Zum 31. März 2018
Umlaufvermögen:				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Wertpapiere	€ 108.783	€ 171.611	\$ 254.596	\$ 322.251
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Derivative Finanzinstrumente	1.025	1.911	2.976	1.280
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	375	789	300	3.529
Einlagen bei Kontrahenten	1.163	1.508	641	0
Zinsforderungen	654	1.305	4.294	3.776
Forderungen aus Wertpapierverkäufen	6.195	24.223	1.607	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus dem Verkauf von Fondsanteilen	0	0	0	0
Forderungen aus Margen für Finanzderivate	0	41	0	0
Umlaufvermögen insgesamt	118.195	201.388	264.414	330.836
Kurzfristige Verbindlichkeiten:				
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Derivative Finanzinstrumente	(955)	(1.726)	(3.883)	(618)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen	(4.727)	(27.692)	(3.332)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Fondsanteilen	0	(771)	0	0
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	(45)	(59)	(124)	(165)
Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Sale-Buy-Back-Finanzierungsgeschäften	0	0	0	0
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	(567)	(1.055)
Verbindlichkeiten für zukünftige Aufwendungen	0	0	0	(2)
Überziehungskredite	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Margen für Finanzderivate	(128)	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	0	(521)	(2.113)	(741)
Kurzfristige Verbindlichkeiten gesamt (ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	(5.855)	(30.769)	(10.019)	(2.581)
Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	€ 112.340	€ 170.619	\$ 254.395	\$ 328.255

Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Vermögensaufstellung (Fortsetzung)

(Beträge in Tsd.)	PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF		PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF	
	Zum 30. Sept. 2018	Zum 31. März 2018	Zum 30. Sept. 2018	Zum 31. März 2018
Umlaufvermögen:				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Wertpapiere	€ 61.196	€ 24.210	€ 2.646.483	€ 2.839.385
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Derivative Finanzinstrumente	3	0	2.478	11.945
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1.866	218	287	0
Einlagen bei Kontrahenten	12	12	3.118	577
Zinsforderungen	1.142	415	12.988	19.416
Forderungen aus Wertpapierverkäufen	0	522	2.004	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus dem Verkauf von Fondsanteilen	0	1.093	35.210	1.422
Forderungen aus Margen für Finanzderivate	0	3	0	0
Umlaufvermögen insgesamt	64.219	26.473	2.702.568	2.872.745
Kurzfristige Verbindlichkeiten:				
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Derivative Finanzinstrumente	(2)	(3)	(4.111)	(3.230)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen	0	(405)	(7.490)	(15.407)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Fondsanteilen	(1.579)	(1.094)	0	(9.419)
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	(22)	(9)	(779)	(846)
Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	(196)	0	0	(525)
Verbindlichkeiten aus Sale-Buy-Back-Finanzierungsgeschäften	0	0	0	0
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Verbindlichkeiten für zukünftige Aufwendungen	0	0	0	(4)
Überziehungskredite	0	0	0	(229)
Verbindlichkeiten aus Margen für Finanzderivate	(1)	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	0	0	(2.869)	(9.106)
Kurzfristige Verbindlichkeiten gesamt (ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	(1.800)	(1.511)	(15.249)	(38.766)
Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	€ 62.419	€ 24.962	€ 2.687.319	€ 2.833.979

Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Vermögensaufstellung (Fortsetzung)

(Beträge in Tsd.)	PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF		PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF	
	Zum 30. Sept. 2018	Zum 31. März 2018	Zum 30. Sept. 2018	Zum 31. März 2018
Umlaufvermögen:				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Wertpapiere	€ 256.833	€ 246.931	\$ 247.197	\$ 240.314
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	1.397
Derivative Finanzinstrumente	726	483	466	628
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	5.549	1.037	1.005	2.633
Einlagen bei Kontrahenten	3.297	3.562	1.776	2.057
Zinsforderungen	2.305	2.684	2.354	2.205
Forderungen aus Wertpapierverkäufen	1.370	8	5	2
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	1.176	1.094
Forderungen aus dem Verkauf von Fondsanteilen	0	21.321	0	1.012
Forderungen aus Margen für Finanzderivate	243	223	340	171
Umlaufvermögen insgesamt	270.323	276.249	254.319	251.513
Kurzfristige Verbindlichkeiten:				
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Derivative Finanzinstrumente	(505)	(616)	(777)	(1.246)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen	(4.392)	(842)	(1.402)	(3.093)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	(1.771)	(1.695)
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Fondsanteilen	0	(2.070)	0	0
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	(103)	(103)	(87)	(85)
Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	(8.369)	0	(39.332)	(41.076)
Verbindlichkeiten aus Sale-Buy-Back-Finanzierungsgeschäften	0	0	0	(2.482)
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Verbindlichkeiten für zukünftige Aufwendungen	0	0	0	0
Überziehungskredite	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Margen für Finanzderivate	0	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	(540)	0	(10)	0
Kurzfristige Verbindlichkeiten gesamt (ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	(13.909)	(3.631)	(43.379)	(49.677)
Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	€ 256.414	€ 272.618	\$ 210.940	\$ 201.836

Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Vermögensaufstellung (Fortsetzung)

(Beträge in Tsd.)	PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF		PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF	
	Zum 30. Sept. 2018	Zum 31. März 2018	Zum 30. Sept. 2018	Zum 31. März 2018
Umlaufvermögen:				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Wertpapiere	\$ 1.348.812	\$ 1.191.340	£ 282.123	£ 284.756
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Derivative Finanzinstrumente	8.872	8.661	788	2.260
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	1.443	8.974	1.532	754
Einlagen bei Kontrahenten	7.570	4.457	0	0
Zinsforderungen	21.617	19.086	2.304	2.024
Forderungen aus Wertpapierverkäufen	2.581	0	1.000	295
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus dem Verkauf von Fondsanteilen	2.029	719	0	2.137
Forderungen aus Margen für Finanzderivate	0	3.972	0	0
Umlaufvermögen insgesamt	1.392.924	1.237.209	287.747	292.226
Kurzfristige Verbindlichkeiten:				
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Derivative Finanzinstrumente	(13.821)	(10.800)	(130)	(349)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen	(11.145)	(52.322)	(2.902)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Fondsanteilen	(2.031)	(9.428)	0	(2.137)
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	(653)	(586)	(95)	(87)
Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Sale-Buy-Back-Finanzierungsgeschäften	0	0	0	0
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Verbindlichkeiten für zukünftige Aufwendungen	0	(1)	0	(1)
Überziehungskredite	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Margen für Finanzderivate	(386)	0	0	0
Einlagen von Kontrahenten	(441)	(2.962)	(815)	(2.532)
Kurzfristige Verbindlichkeiten gesamt (ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	(28.477)	(76.099)	(3.942)	(5.106)
Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	\$ 1.364.447	\$ 1.161.110	£ 283.805	£ 287.120

Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Vermögensaufstellung (Fortsetzung)

(Beträge in Tsd.)	PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF		Gesellschaft insgesamt*	
	Zum 30. Sept. 2018	Zum 31. März 2018	Zum 30. Sept. 2018	Zum 31. März 2018
Umlaufvermögen:				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Wertpapiere	\$ 2.929.746	\$ 3.228.183	€ 7.501.495	€ 7.655.607
Einlagen bei Kreditinstituten	8.016	6.994	6.902	6.823
Derivative Finanzinstrumente	0	0	15.719	25.510
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	14.213	3.765	29.185	25.154
Einlagen bei Kontrahenten	30	0	16.215	10.956
Zinsforderungen	15.136	16.202	57.044	59.684
Forderungen aus Wertpapierverkäufen	4.120	831	17.849	25.767
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	1.013	890
Forderungen aus dem Verkauf von Fondsanteilen	0	0	36.957	27.681
Forderungen aus Margen für Finanzderivate	0	0	536	3.636
Umlaufvermögen insgesamt	2.971.261	3.255.975	7.682.915	7.841.708
Kurzfristige Verbindlichkeiten:				
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet:				
Derivative Finanzinstrumente	0	0	(21.631)	(16.270)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen	(36.124)	(21.453)	(64.642)	(106.847)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	(1.525)	(1.378)
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Fondsanteilen	0	(43.122)	(8.112)	(65.401)
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	(834)	(908)	(2.518)	(2.534)
Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	(69.978)	(171.974)	(102.681)	(173.756)
Verbindlichkeiten aus Sale-Buy-Back-Finanzierungsgeschäften	0	0	0	(2.018)
Zu zahlende Kapitalertragsteuer	0	0	(488)	(858)
Verbindlichkeiten für zukünftige Aufwendungen	0	(3)	0	(10)
Überziehungskredite	0	0	0	(229)
Verbindlichkeiten aus Margen für Finanzderivate	0	0	(461)	0
Einlagen von Kontrahenten	0	0	(6.532)	(15.526)
Kurzfristige Verbindlichkeiten gesamt (ohne das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen)	(106.936)	(237.460)	(208.590)	(384.827)
Den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnendes Nettovermögen	\$ 2.864.325	\$ 3.018.515	€ 7.474.325	€ 7.456.881

Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

* Die für die Gesellschaft zum 30. September 2018 und zum 31. März 2018 ermittelte Gesamtsumme berücksichtigt die fondsübergreifende Investition des PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF in den PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF sowie Guthaben im Namen der Gesellschaft.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Gewinn- und Verlustrechnung

	PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF		PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF	
	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017
(Beträge in Tsd.)				
Ausschüttend				
Zins- und Dividenerträge	€ 1.005	€ 995	\$ 9.395	\$ 7.183
Sonstige Erträge	1	0	3	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(160)	522	(21.053)	3.269
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(1.056)	4.852	(2.897)	(376)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(230)	(263)	1.184	(127)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	303	(2.387)	(21.808)	3.799
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus derivativen Finanzinstrumenten	(114)	(1.074)	(1.569)	104
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus Fremdwährungen	(18)	(7)	(1.843)	(69)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(269)	2.638	(38.588)	13.783
Betriebliche Aufwendungen				
Managementgebühren	(273)	(322)	(878)	(677)
Sonstige Aufwendungen	(2)	(2)	(1)	0
Gesamtaufwand	(275)	(324)	(879)	(677)
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(544)	2.314	(39.467)	13.106
Finanzierungskosten				
Zinsaufwand	(11)	(2)	(17)	(6)
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile	0	0	(2.707)	(1.970)
Nettoausgleichsgutschriften und (Belastungen)	(141)	(182)	(11)	876
Gesamtfinanzierungskosten	(152)	(184)	(2.735)	(1.100)
Vorsteuergewinn/(-verlust) für den Berichtszeitraum	(696)	2.130	(42.202)	12.006
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	(3)	(180)	(413)
Kapitalertragsteuer	0	0	212	(431)
Nachsteuergewinn/(-verlust) für den Berichtszeitraum	(696)	2.127	(42.170)	11.162
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der laufenden Geschäftstätigkeit	€ (696)	€ 2.127	\$ (42.170)	\$ 11.162

Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Gewinn- und Verlustrechnung (Fortsetzung)

(Beträge in Tsd.)

	PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF ⁽¹⁾		PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF			
	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018		Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017		
Ausschüttend						
Zins- und Dividendenerträge	€	586	€	136	€	3.473
Sonstige Erträge		0		29		0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten		(267)		(17.249)		(1.614)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten		4		4.275		24.157
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen		0		(36)		(81)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten		(408)		7.497		(26.815)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus derivativen Finanzinstrumenten		4		(10.347)		2.266
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus Fremdwährungen		0		261		(146)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)		(81)		(15.434)		1.240
Betriebliche Aufwendungen						
Managementgebühren		(103)		(4.859)		(4.154)
Sonstige Aufwendungen		0		(11)		(4)
Gesamtaufwand		(103)		(4.870)		(4.158)
Nettoanlageerträge/(-verluste)		(184)		(20.304)		(2.918)
Finanzierungskosten						
Zinsaufwand		0		(266)		(258)
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile		(269)		0		(521)
Nettoausgleichsgutschriften und (Belastungen)		3		223		589
Gesamtfinanzierungskosten		(266)		(43)		(190)
Vorsteuergewinn/(-verlust) für den Berichtszeitraum		(450)		(20.347)		(3.108)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge		0		0		0
Kapitalertragsteuer		0		0		0
Nachsteuergewinn/(-verlust) für den Berichtszeitraum		(450)		(20.347)		(3.108)
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der laufenden Geschäftstätigkeit	€	(450)	€	(20.347)	€	(3.108)

Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

⁽¹⁾ Der PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF wurde am 09. Oktober 2017 aufgelegt.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Gewinn- und Verlustrechnung (Fortsetzung)

(Beträge in Tsd.)	PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF		PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF	
	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017
Ausschüttend				
Zins- und Dividendenerträge	€ 1.463	€ 1.642	\$ 3.956	\$ 3.633
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(1.467)	565	(2.192)	1.185
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(1.281)	2.489	(1.288)	664
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	22	(10)	(69)	56
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	1.505	(1.766)	452	354
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus derivativen Finanzinstrumenten	356	(11)	344	(465)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus Fremdwährungen	(7)	(5)	(26)	(5)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	591	2.904	1.177	5.422
Betriebliche Aufwendungen				
Managementgebühren	(649)	(570)	(545)	(480)
Sonstige Aufwendungen	0	0	(1)	0
Gesamtaufwand	(649)	(570)	(546)	(480)
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(58)	2.334	631	4.942
Finanzierungskosten				
Zinsaufwand	(4)	(6)	(507)	(429)
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile	(870)	(1.056)	(2.578)	(2.689)
Nettoausgleichsgutschriften und (Belastungen)	6	30	115	538
Gesamtfinanzierungskosten	(868)	(1.032)	(2.970)	(2.580)
Vorsteuergewinn/(-verlust) für den Berichtszeitraum	(926)	1.302	(2.339)	2.362
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(4)	(4)	0	0
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Nachsteuergewinn/(-verlust) für den Berichtszeitraum	(930)	1.298	(2.339)	2.362
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der laufenden Geschäftstätigkeit	€ (930)	€ 1.298	\$ (2.339)	\$ 2.362

Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Gewinn- und Verlustrechnung (Fortsetzung)

	PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF		PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF	
	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017
(Beträge in Tsd.)				
Ausschüttend				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 34.665	\$ 30.581	£ 1.370	£ 585
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	(2.654)	1.819	21	1.181
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(44.928)	80.121	(209)	(196)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen	(85)	(209)	(240)	95
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs(es)/(Wertverlustes) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten	8.219	6.084	1.623	(3.856)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs(es)/(Wertverlustes) aus derivativen Finanzinstrumenten	(2.547)	(19.534)	(1.253)	2.720
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs(es)/(Wertverlustes) aus Fremdwährungen	(3)	162	21	(58)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(7.333)	99.024	1.333	471
Betriebliche Aufwendungen				
Managementgebühren	(3.837)	(3.479)	(575)	(302)
Sonstige Aufwendungen	(5)	(2)	(1)	(1)
Gesamtaufwand	(3.842)	(3.481)	(576)	(303)
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(11.175)	95.543	757	168
Finanzierungskosten				
Zinsaufwand	(84)	(38)	0	(1)
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile	(26.692)	(27.497)	(742)	(303)
Nettoausgleichsgutschriften und (Belastungen)	(32)	235	(11)	355
Gesamtfinanzierungskosten	(26.808)	(27.300)	(753)	51
Vorsteuergewinn/(-verlust) für den Berichtszeitraum	(37.983)	68.243	4	219
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(7)	(10)	(1)	0
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Nachsteuergewinn/(-verlust) für den Berichtszeitraum	(37.990)	68.233	3	219
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der laufenden Geschäftstätigkeit	\$ (37.990)	\$ 68.233	£ 3	£ 219

Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Gewinn- und Verlustrechnung (Fortsetzung)

	PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF				Gesellschaft insgesamt*			
	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018		Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017		Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018		Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017	
(Beträge in Tsd.)								
Ausschüttend								
Zins- und Dividenderträge	\$	40.681	\$	22.795	€	80.123	€	63.210
Sonstige Erträge		0		0		33		0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten		(3.052)		2.278		(43.704)		8.349
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten		0		0		(40.036)		101.968
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen		0		0		360		(490)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten		2.786		1.536		1.940		(24.989)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus derivativen Finanzinstrumenten		0		0		(14.724)		(13.209)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes) aus Fremdwährungen		0		0		(1.331)		(146)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)		40.415		26.609		(17.339)		134.693
Betriebliche Aufwendungen								
Managementgebühren		(4.993)		(4.145)		(15.248)		(13.111)
Sonstige Aufwendungen		(11)		(4)		(29)		(12)
Gesamtaufwand		(5.004)		(4.149)		(15.277)		(13.123)
Nettoanlageerträge/(-verluste)		35.411		22.460		(32.616)		121.570
Finanzierungskosten								
Zinsaufwand		(1.610)		(18)		(2.166)		(698)
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile		(33.140)		(18.614)		(57.321)		(46.554)
Nettoausgleichsgutschriften und (Belastungen)		238		1.098		342		3.257
Gesamtfinanzierungskosten		(34.512)		(17.534)		(59.145)		(43.995)
Vorsteuergewinn/(-verlust) für den Berichtszeitraum		899		4.926		(91.761)		77.575
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge		0		(3)		(164)		(382)
Kapitalertragsteuer		0		0		180		(379)
Nachsteuergewinn/(-verlust) für den Berichtszeitraum		899		4.923		(91.745)		76.814
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der laufenden Geschäftstätigkeit	\$	899	\$	4.923	€	(91.745)	€	76.814

Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

*Die für die Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. September 2018 und zum 30. September 2017 ermittelte Gesamtsumme berücksichtigt die fondsübergreifende Investition des PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF in den PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens

(Beträge in Tsd.)

	PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF		PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF	
	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	€ 170.619	€ 212.827	\$ 328.255	\$ 175.446
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Verrechnungen	23.412	5.217	54.598	91.910
Zahlungen für Anteilsrücknahmen	(80.995)	(91.722)	(86.288)	(15.821)
Nominelle Wechselkursanpassung	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der laufenden Geschäftstätigkeit	(696)	2.127	(42.170)	11.162
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	€ 112.340	€ 128.449	\$ 254.395	\$ 262.697

(Beträge in Tsd.)

	PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF ⁽¹⁾		PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF	
	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	€ 24.962	€ 24.962	€ 2.833.979	€ 2.307.386
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Verrechnungen	77.989	77.989	738.637	898.617
Zahlungen für Anteilsrücknahmen	(40.082)	(40.082)	(864.950)	(680.089)
Nominelle Wechselkursanpassung	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der laufenden Geschäftstätigkeit	(450)	(450)	(20.347)	(3.108)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	€ 62.419	€ 62.419	€ 2.687.319	€ 2.522.806

Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

⁽¹⁾ Der PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF wurde am 09. Oktober 2017 aufgelegt.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

(Beträge in Tsd.)

	PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF		PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF	
	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	€ 272.618	€ 292.366	\$ 201.836	\$ 195.781
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Verrechnungen	15.106	83.313	72.937	101.235
Zahlungen für Anteilsrücknahmen	(30.380)	(62.440)	(61.494)	(10.330)
Nominelle Wechselkursanpassung	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der laufenden Geschäftstätigkeit	(930)	1.298	(2.339)	2.362
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	€ 256.414	€ 314.537	\$ 210.940	\$ 289.048

(Beträge in Tsd.)

	PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF		PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF	
	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	\$ 1.161.110	\$ 1.095.014	£ 287.120	£ 190.318
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Verrechnungen	973.477	735.783	259.320	245.804
Zahlungen für Anteilsrücknahmen	(732.150)	(627.051)	(262.638)	(166.183)
Nominelle Wechselkursanpassung	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der laufenden Geschäftstätigkeit	(37.990)	68.233	3	219
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	\$ 1.364.447	\$ 1.271.979	£ 283.805	£ 270.158

Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

(Beträge in Tsd.)	PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF		Gesellschaft insgesamt*	
	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2018	Berichtszeitraum zum 30. Sept. 2017
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	\$ 3.018.515	\$ 2.103.937	€ 7.456.881	€ 6.363.901
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Verrechnungen	571.410	583.335	2.516.447	2.528.388
Zahlungen für Anteilsrücknahmen	(726.499)	(50.001)	(2.627.568)	(1.584.527)
Nominelle Wechselkursanpassung	0	0	220.310	(354.765)
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens aus der laufenden Geschäftstätigkeit	899	4.923	(91.745)	76.814
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	\$ 2.864.325	\$ 2.642.194	€ 7.474.325	€ 7.029.811

Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

* Die für die Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. September 2018 und zum 30. September 2017 ermittelte Gesamtsumme berücksichtigt die fondsübergreifende Investition des PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF in den PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF.

Aufstellung des Wertpapierbestands

PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖGENS
WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE – AMTLICHE BÖRSE/GEREGLTER MARKT				NORWEGEN			
BELGIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
ING Belgium S.A.				SR-Boligkredit A/S			
0,750 % due 28.09.2026	€ 3.300	€ 3.286	2,92	2,500 % due 12.04.2022	\$ 2.000	€ 1.669	1,49
KANADA				POLEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Toronto-Dominion Bank				mBank Hipoteczny S.A.			
2,500 % due 18.01.2023	\$ 3.700	3.101	2,76	1,073 % due 05.03.2025	€ 800	803	0,71
CHINA				PKO Bank Hipoteczny S.A.			
Bank of China Ltd.				0,125 % due 24.06.2022			
1,875 % due 09.11.2019	1.400	1.184	1,05	Polen insgesamt			
DÄNEMARK				PORTUGAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
BRFKredit A/S				Caixa Economica Montepio Geral			
2,000 % due 01.10.2050	DKK 29.200	3.839	3,42	0,875 % due 17.10.2067	4.400	4.426	3,94
3,000 % due 01.10.2044	12.000	1.724	1,53	SÜDKOREA			
DLR Kredit A/S				STAATSANLEIHEN			
2,500 % due 01.10.2047	34.500	4.804	4,28	Korea Housing Finance Corp.			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				3,000 % due 31.10.2022	\$ 3.700	3.092	2,75
2,000 % due 01.10.2050	3.000	395	0,35	SPANIEN			
Nykredit Realkredit A/S				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
1,500 % due 01.10.2050	37.300	4.788	4,26	Banco de Sabadell S.A.			
Dänemark insgesamt		15.550	13,84	0,875 % due 12.11.2021	€ 3.800	3.885	3,46
FRANKREICH				Bankia S.A.			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				1,000 % due 14.03.2023			
Cie de Financement Foncier S.A.				Cajamar Caja Rural SCC			
0,875 % due 11.09.2028	€ 4.800	4.728	4,21	0,875 % due 18.06.2023	2.300	2.317	2,06
Credit Agricole Home Loan SFH S.A.				Deutsche Bank S.A. Espanola			
1,500 % due 28.09.2038	3.500	3.449	3,07	0,500 % due 11.03.2024	5.300	5.246	4,67
Frankreich insgesamt		8.177	7,28	PITCH1			
DEUTSCHLAND				5,125 % due 20.07.2022			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				4,100			
Aareal Bank AG				Spanien insgesamt			
1,875 % due 15.09.2020	\$ 4.454	3.734	3,33			20.177	17,96
Deutsche Pfandbriefbank AG				SCHWEDEN			
1,500 % due 16.12.2021	£ 4.700	5.272	4,69	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
HSB Nordbank AG				Sveriges Sakerstallda Obligationer AB			
0,375 % due 12.07.2023	€ 5.000	4.972	4,43	2,000 % due 17.06.2026	SEK 23.000	2.324	2,07
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
2,125 % due 17.01.2023	\$ 3.450	2.857	2,54	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Deutschland insgesamt		16.835	14,99	Co-Operative Bank PLC			
ITALIEN				4,750 % due 11.11.2021			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				Lloyds Bank PLC			
Banca Carige SpA				6,000 % due 08.02.2029			
3,875 % due 24.10.2018	€ 600	601	0,53	Vereinigtes Königreich insgesamt			
LUXEMBURG				4,366			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				3,89			
NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank				USA			
2,875 % due 16.02.2021	\$ 5.600	4.770	4,25	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
NIEDERLANDE				Energy Transfer Partners LP			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				9,700 % due 15.03.2019			
ING Bank NV				\$ 200			
2,625 % due 05.12.2022	3.800	3.181	2,83	Kurzfristige Instrumente insgesamt			
Nationale-Niederlanden Bank NV						3.200	2,85
1,000 % due 25.09.2028	€ 5.100	5.042	4,49	Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt – amtliche Börse/gereglter Markt			
NIBC Bank NV						€ 108.783	96,83
1,000 % due 11.09.2028	3.600	3.556	3,16				
Niederlande insgesamt		11.779	10,48				

Aufstellung des Wertpapierbestands

PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF (Fortsetzung)

30. September 2018

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Typ	Verfallsmonat	# der Kontrakte		Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Call Options Strike @ EUR 160.000 on Euro-Bobl December 2018 Futures	Short	11/2018	65	€	16	0,01
Euro-Bobl December Futures	Long	12/2018	93		(25)	(0,02)
Euro-BTP Italy Government Bond December Futures	Short	12/2018	16		42	0,04
Euro-Buxl 30-Year Bond December Futures	Short	12/2018	79		178	0,16
Euro-Schatz December Futures	Long	12/2018	85		3	0,00
Put Options Strike @ EUR 158.000 on Euro-Bobl December 2018 Futures	Short	11/2018	65		(10)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note December Futures	Short	12/2018	120		26	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note December Futures	Short	12/2018	67		(6)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note December Futures	Long	12/2018	65		8	0,01
				€	232	0,21
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente insgesamt				€	232	0,21

ZENTRAL ABGEWICKELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

ZINSSWAPS

Zu zahlen/zu erhalten variabler Zins	Zinsvariabler Index	Festzins	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag		Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Zu erhalten	3-Month USD-LIBOR	1,750 %	21.06.2047	\$ 3.400	€	63	0,06
Zu zahlen	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	19.12.2048	€ 9.200		(69)	(0,06)
Zu erhalten	6-Month GBP-LIBOR	1,750	20.03.2049	£ 2.100		15	0,01
Zu erhalten	6-Month JPY-LIBOR	0,380	18.06.2028	¥ 240.000		1	0,00
Zu erhalten	6-Month JPY-LIBOR	1,000	21.03.2048	250.000		0	0,00
					€	10	0,01
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente insgesamt					€	10	0,01

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

DEVISENKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
BOA	10/2018	DKK 890	€ 119	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	10/2018	€ 278	DKK 2.075	0	0	0	0,00
	10/2018	\$ 53.483	€ 45.752	0	(293)	(293)	(0,26)
	01/2019	DKK 16.620	€ 2.230	0	0	0	0,00
BRC	01/2019	€ 1.771	DKK 13.205	0	0	0	0,00
	10/2018	DKK 80.285	€ 10.770	4	(1)	3	0,00
	10/2018	€ 5.146	DKK 38.375	0	0	0	0,00
	11/2018	\$ 4.297	\$ 5.040	32	0	32	0,03
FBF	10/2018	\$ 182	€ 156	0	0	0	0,00
	11/2018	€ 509	SEK 5.255	0	0	0	0,00
GLM	11/2018	¥ 15.600	€ 123	5	0	5	0,00
	10/2018	DKK 90.550	€ 12.155	13	0	13	0,01
	10/2018	€ 31.057	DKK 231.573	6	(9)	(3)	0,00
	10/2018	€ 5.497	\$ 6.481	83	0	83	0,07
JPM	11/2018	£ 4.674	€ 5.192	0	(47)	(47)	(0,04)
	11/2018	SEK 29.555	€ 2.811	0	(51)	(51)	(0,04)
	01/2019	DKK 148.828	€ 19.962	0	(6)	(6)	(0,01)
RBC	10/2018	68.690	9.220	9	0	9	0,01
	10/2018	€ 616	DKK 4.595	0	0	0	0,00
RYL	11/2018	4.800	SEK 50.645	104	0	104	0,09
SCX	11/2018	£ 4.671	€ 5.202	0	(35)	(35)	(0,03)
SOG	10/2018	DKK 138.329	€ 18.568	18	0	18	0,02
	10/2018	€ 11.539	DKK 85.975	0	(10)	(10)	(0,01)
SSB	11/2018	SEK 50.635	€ 4.858	0	(45)	(45)	(0,04)
	10/2018	€ 6.147	DKK 45.830	1	(2)	(1)	0,00
	11/2018	€ 145	£ 130	0	0	0	0,00
UAG	01/2019	3.213	DKK 23.950	0	0	0	0,00
	10/2018	DKK 67.990	€ 9.120	4	(1)	3	0,00
	10/2018	€ 2.805	DKK 20.900	0	(2)	(2)	0,00
	10/2018	40.412	\$ 47.362	394	(29)	365	0,33
	11/2018	\$ 33.761	€ 28.683	0	(314)	(314)	(0,28)
Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt				€ 673	€ (845)	€ (172)	(0,15)

Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt

€ (172) (0,15)

Anlagen insgesamt

€ 108.853 96,90

Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

€ 3.487 3,10

Nettovermögen

€ 112.340 100,00

ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd.*):

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

Barmittel in Höhe von € 1.151 waren zum 30. September 2018 als Sicherheiten für börsengehandelte und zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente verpfändet.

(a) Pensionsgeschäfte zum 30. September 2018:

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	(Erhaltene) Sicherheiten	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäften ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
IND	(0,560) %	28.09.2018	01.10.2018	€ 3.200	Sweden Government International Bond 0,125 % due 24.04.2023	€ (3.198)	€ 3.200	€ 3.200	2,85
Pensionsgeschäfte insgesamt						€ (3.198)	€ 3.200	€ 3.200	2,85

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert⁽¹⁾

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 108.783	€ 0	€ 108.783
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	232	(162)	0	70
Gesamt	€ 232	€ 108.621	€ 0	€ 108.853

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 171.611	€ 0	€ 171.611
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	(108)	293	0	185
Gesamt	€ (108)	€ 171.904	€ 0	€ 171.796

⁽¹⁾ Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

⁽²⁾ Weitere Informationen sind der Aufstellung des Wertpapierbestands zu entnehmen.

⁽³⁾ Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Terminkontrakte, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2018:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC-Derivaten insgesamt	(Erhaltene)/verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement ⁽¹⁾
BOA	€ (293)	€ 0	€ (293)
BRC	35	0	35
GLM	5	0	5
JPM	(11)	0	(11)
RBC	9	0	9
RYL	104	0	104
SCX	(35)	0	(35)
SOG	(37)	0	(37)
SSB	(1)	0	(1)
UAG	52	0	52

⁽¹⁾ Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.

Vergleichsangaben

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Vergleichsangaben der Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. September 2018:

	30. Sept. 2018 (%)	31. März 2018 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	93,98	98,11
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	0,00	0,06
Sonstige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	2,85	2,41
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,21	(0,06)
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente	0,01	0,03
Derivative OTC-Finanzinstrumente	(0,15)	0,14

* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
BESCHREIBUNG UND GELDMARKTINSTRUMENTE – AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT							
STAATSANLEIHEN							
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos				7,750 % due 13.11.2042	MXN	29.700	0,60
4,500 % due 01.03.2021	CLP	1.645.000	2,534	1,00		14.700	0,31
4,500 % due 01.03.2026		750.000	1,139	0,45		24.900	1,315
6,000 % due 01.01.2020		3.800.000	5,942	2,34		13.700	0,761
6,000 % due 01.01.2043		400.000	681	0,27		19.200	1,067
				10,000 % due 20.11.2036		20.432	1,292
Brazil Government International Bond							0,51
8,500 % due 05.01.2024	BRL	25.700	6,319	2,48	Philippines Government International Bond		
10,250 % due 10.01.2028		22.350	5,911	2,32	3,900 % due 26.11.2022	PHP	131.000
12,500 % due 05.01.2022		4.700	1,309	0,51	4,950 % due 15.01.2021		154.000
				0,51	6,250 % due 14.01.2036		82.000
Brazil Letras do Tesouro Nacional				0,51			1,437
0,000 % due 01.04.2019(a)		89.600	21,706	8,53	Poland Government International Bond		
0,000 % due 01.07.2019(a)		5.100	1,211	0,48	1,500 % due 25.04.2020	PLN	1.700
0,000 % due 01.01.2020(a)		18.300	4,151	1,63	2,250 % due 25.04.2022		1.000
				1,63	2,500 % due 25.01.2023		7.800
Brazil Notas do Tesouro Nacional				0,48	2,500 % due 25.07.2026		3.500
10,000 % due 01.01.2023		26.700	6,513	1,63	2,500 % due 25.07.2027		10.200
				1,63	3,250 % due 25.07.2025		1.800
Chile Government International Bond				0,48	4,000 % due 25.10.2023		600
5,500 % due 05.08.2020	CLP	867.500	1,357	0,53	5,250 % due 25.10.2020		3.500
				0,53	5,750 % due 23.09.2022		5.200
Colombia Government International Bond				0,53			1,596
4,375 % due 21.03.2023	COP	2.163.000	689	0,27	Russia Government International Bond		
7,750 % due 14.04.2021		20.256.000	7,149	2,81	5,500 % due 19.07.2023	RUB	39.500
9,850 % due 28.06.2027		2.253.000	939	0,37	6,400 % due 27.05.2020		145.200
				0,37	6,700 % due 15.05.2019		945.600
Colombian TES				0,37	7,000 % due 25.01.2023		265.400
5,000 % due 21.11.2018		4.967.700	1,675	0,66	7,000 % due 16.08.2023		484.200
6,000 % due 28.04.2028		2.114.000	669	0,26	7,050 % due 19.01.2028		233.100
7,000 % due 11.09.2019		17.800	6	0,00	7,250 % due 10.05.2034		40.300
7,000 % due 04.05.2022		1.590.900	557	0,22	7,400 % due 07.12.2022		1.400
7,000 % due 30.06.2032		381.000	126	0,05	7,700 % due 23.03.2033		156.500
7,500 % due 26.08.2026		560.400	198	0,08	8,150 % due 03.02.2027		381.000
7,750 % due 18.09.2030		1.069.100	380	0,15	8,500 % due 17.09.2031		253.000
10,000 % due 24.07.2024		3.518.000	1,396	0,55			3,876
				0,55	South Africa Government International Bond		
Indonesia Government International Bond				0,55	6,500 % due 28.02.2041	ZAR	5.450
5,625 % due 15.05.2023	IDR	6.000.000	367	0,14	7,000 % due 28.02.2031		4.700
6,125 % due 15.05.2028		2.934.000	171	0,07	7,250 % due 15.01.2020		155.600
6,625 % due 15.05.2033		3.700.000	214	0,08	7,750 % due 28.02.2023		9.900
7,000 % due 15.05.2022		22.308.000	1,457	0,57	8,250 % due 31.03.2032		10.300
7,000 % due 15.05.2027		15.660.000	976	0,38	8,500 % due 31.01.2037		5.500
8,250 % due 15.07.2021		18.700.000	1,270	0,50	8,750 % due 31.01.2044		8.000
8,250 % due 15.06.2032		8.820.000	581	0,23	8,750 % due 28.02.2048		11.400
8,250 % due 15.05.2036		7.103.000	467	0,18	8,875 % due 28.02.2035		13.700
8,375 % due 15.03.2024		13.262.000	900	0,35	9,000 % due 31.01.2040		21.800
8,375 % due 15.09.2026		25.477.000	1,728	0,68			1,418
8,375 % due 15.03.2034		14.585.000	975	0,38	Thailand Government International Bond		
8,750 % due 15.05.2031		17.010.000	1,164	0,46	2,550 % due 26.06.2020	THB	400
8,750 % due 15.02.2044		12.394.000	815	0,32	2,875 % due 17.06.2046		7.500
9,000 % due 15.03.2029		16.979.000	1,195	0,47	3,400 % due 17.06.2036		40.500
9,500 % due 15.07.2023		13.437.000	950	0,37	3,580 % due 17.12.2027		6.000
9,500 % due 15.07.2031		7.395.000	539	0,21	3,625 % due 16.06.2023		21.565
9,500 % due 15.05.2041		2.073.000	149	0,06	3,650 % due 17.12.2021		32.300
10,000 % due 15.02.2028		15.958.000	1,185	0,47	3,650 % due 20.06.2031		9.800
10,500 % due 15.07.2038		3.910.000	307	0,12	3,775 % due 25.06.2032		20.900
12,800 % due 15.06.2021		3.377.000	253	0,10	4,000 % due 17.06.2066		19.400
12,900 % due 15.06.2022		24.500.000	1,897	0,75	4,260 % due 12.12.2037		44.300
				0,75	4,675 % due 29.06.2044		5.200
Malaysia Government International Bond				0,75	4,850 % due 17.06.2061		3.300
3,418 % due 15.08.2022	MYR	3.460	826	0,32	4,875 % due 22.06.2029		23.860
3,480 % due 15.03.2023		3.000	715	0,28	5,625 % due 12.01.2019		225.300
3,654 % due 31.10.2019		3.700	897	0,35			7,047
3,759 % due 15.03.2019		3.800	920	0,36	Turkey Government International Bond		
3,795 % due 30.09.2022		1.100	266	0,10	8,000 % due 12.03.2025	TRY	600
3,899 % due 16.11.2027		1.600	380	0,15	10,500 % due 11.08.2027		13.400
3,900 % due 30.11.2026		2.000	477	0,19	10,600 % due 11.02.2026		4.300
3,955 % due 15.09.2025		2.000	482	0,19	11,000 % due 24.02.2027		21.600
4,232 % due 30.06.2031		1.300	307	0,12	11,100 % due 15.05.2019		91.500
4,254 % due 31.05.2035		500	115	0,05			13,987
4,295 % due 31.10.2018		21.000	5,078	2,00			250,165
4,378 % due 29.11.2019		3.142	768	0,30			98,34
4,392 % due 15.04.2026		1.800	443	0,17	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE		
4,498 % due 15.04.2030		1.400	340	0,13	PENSIONSGESCHAFTE (d)		
4,736 % due 15.03.2046		600	141	0,06			3,332
4,762 % due 07.04.2037		1.800	437	0,17	J.S. TREASURY BILLS		
4,935 % due 30.09.2043		800	196	0,08	1,962 % due		
				0,08	04.10.2018 (a)(b)(c)	\$	305
Mexico Government International Bond					1,987 % due 18.10.2018 (a)(b)(c)		305
5,000 % due 11.12.2019	MXN	406.800	21,058	8,28	1,995 % due 25.10.2018 (a)(b)(c)		576
5,750 % due 05.03.2026		17.400	821	0,32			218
6,500 % due 09.06.2022		70.300	3,611	1,42			1,099
7,500 % due 03.06.2027		21.900	1,140	0,45			0,43
7,750 % due 29.05.2031		33.000	1,727	0,68			
7,750 % due 23.11.2034		35.500	1,843	0,72			
					Kurzfristige Instrumente insgesamt		4,431
							1,74
					Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		
					insgesamt – amtliche Börse/gelegter Markt	\$ 254.596	100,08

Aufstellung des Wertpapierbestands

PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF (Fortsetzung)

30. September 2018

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

DEWISENKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
BOA	10/2018	TRY 1.183	\$ 226	\$ 31	\$ 0	\$ 31	0,01
	10/2018	\$ 1.467	PLN 5.478	19	0	19	0,01
	11/2018	272	ZAR 3.898	3	0	3	0,00
BPS	10/2018	ZAR 107.810	\$ 7.191	0	(396)	(396)	(0,16)
	10/2018	BRL 16.841	4.135	0	(82)	(82)	(0,03)
	10/2018	TRY 10.686	1.716	0	(42)	(42)	(0,02)
BRC	10/2018	\$ 138	PLN 511	0	0	0	0,00
	11/2018	571	MXN 10.937	10	0	10	0,00
	12/2018	MXN 131.680	\$ 6.812	0	(183)	(183)	(0,07)
CBK	10/2018	CNY 16.035	2.331	8	0	8	0,00
	10/2018	BRL 17.863	4.355	0	(118)	(118)	(0,05)
	10/2018	RUB 414.266	6.291	0	(26)	(26)	(0,01)
GLM	10/2018	\$ 311	RUB 21.335	14	0	14	0,01
	11/2018	MXN 31.856	\$ 1.622	0	(70)	(70)	(0,03)
	11/2018	\$ 135	ZAR 1.990	5	0	5	0,00
	12/2018	COP 14.651.569	\$ 4.724	0	(203)	(203)	(0,08)
	12/2018	\$ 41.345	CNY 282.766	0	(384)	(384)	(0,15)
	12/2018	2.884	COP 8.750.987	58	0	58	0,02
	12/2018	71	IDR 1.091.267	1	0	1	0,00
	10/2018	BRL 10.782	\$ 2.590	0	(110)	(110)	(0,04)
	10/2018	MXN 52.160	2.764	0	(15)	(15)	(0,01)
	10/2018	PLN 599	159	0	(4)	(4)	0,00
	10/2018	TRY 44.570	8.809	1.475	0	1.475	0,58
	10/2018	\$ 305	BRL 1.266	12	0	12	0,00
HUS	10/2018	8.243	RUB 563.056	343	0	343	0,14
	11/2018	RUB 56.430	\$ 876	18	0	18	0,01
	11/2018	\$ 1.265	BRL 5.228	41	0	41	0,02
	12/2018	CLP 4.265.243	\$ 6.147	0	(325)	(325)	(0,13)
	12/2018	MYR 26.749	6.474	12	0	12	0,00
	12/2018	THB 7.370	228	0	(1)	(1)	0,00
	12/2018	\$ 246	CLP 170.505	13	0	13	0,01
	12/2018	1.014	MYR 4.192	0	(1)	(1)	0,00
	10/2018	BRL 15.346	\$ 3.797	0	(46)	(46)	(0,02)
	10/2018	RUB 145.478	2.126	0	(92)	(92)	(0,04)
	10/2018	\$ 14.437	BRL 59.566	479	0	479	0,19
	11/2018	BRL 59.566	\$ 14.397	0	(484)	(484)	(0,19)
11/2018	\$ 1.031	MXN 19.874	24	0	24	0,01	
11/2018	ZAR 14.129	\$ 1.048	54	0	54	0,02	
12/2018	CNY 6.725	982	8	0	8	0,00	
12/2018	COP 13.429.876	4.478	0	(38)	(38)	(0,01)	
12/2018	INR 180.101	2.481	29	0	29	0,01	
12/2018	PHP 53.542	994	9	0	9	0,00	
12/2018	THB 225.024	6.916	0	(59)	(59)	(0,02)	
12/2018	\$ 101	THB 3.309	1	0	1	0,00	
10/2018	PLN 7.640	\$ 2.042	1	(31)	(30)	(0,01)	
10/2018	\$ 1.906	PLN 6.950	0	(21)	(21)	(0,01)	
12/2018	IDR 17.636.220	\$ 1.132	0	(36)	(36)	(0,01)	
12/2018	THB 17.949	549	0	(8)	(8)	0,00	
10/2018	MXN 52.160	2.770	0	(9)	(9)	0,00	
11/2018	\$ 2.399	BRL 9.792	47	0	47	0,02	
11/2018	1.132	MXN 21.585	14	0	14	0,01	
11/2018	ZAR 9.372	\$ 619	6	(47)	(41)	(0,02)	
12/2018	\$ 58	IDR 889.024	1	0	1	0,00	
11/2018	157	MXN 3.079	7	0	7	0,00	
10/2018	RUB 231.579	\$ 3.371	0	(161)	(161)	(0,06)	
12/2018	INR 45.259	630	14	0	14	0,01	
12/2018	PHP 17.215	318	1	0	1	0,00	
12/2018	IDR 70.432.907	4.738	73	0	73	0,03	
12/2018	\$ 159	IDR 2.397.598	0	0	0	0,00	
12/2018	40.797	INR 2.933.756	0	(849)	(849)	(0,33)	
12/2018	4.797	IDR 72.479.356	3	0	3	0,00	
10/2018	TRY 2.847	\$ 432	0	(39)	(39)	(0,02)	
10/2018	\$ 159	TRY 1.039	12	0	12	0,00	
11/2018	RUB 320.654	\$ 4.997	123	0	123	0,05	
12/2018	MYR 1.718	413	0	(3)	(3)	0,00	
12/2018	\$ 1.516	THB 49.122	7	0	7	0,00	

Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt

\$ 2.976 \$ (3.883) \$ (907) (0,36)

Anlagen insgesamt

\$ 253.689 99,72

Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

\$ 706 0,28

Nettovermögen

\$ 254.395 100,00

ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd.*):

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

(a) Nullkupon-Papier.

(b) Kupon stellt eine Rendite bis Fälligkeit dar.

(c) Zum 30. September 2018 wurden Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von insgesamt \$ 1.099 und Barmittel in Höhe von \$ 641 als Sicherheiten für derivative Finanzinstrumente verpfändet, die von Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. geregelt werden.

(d) Pensionsgeschäfte zum 30. September 2018:

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	(Erhaltene) Sicherheiten	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäften ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
SSB	1,100 %	28.09.2018	01.10.2018	\$ 3.332	U.S. Treasury Notes 2,000 % due 31.08.2021	\$ (3.403)	\$ 3.332	\$ 3.332	1,31
Pensionsgeschäfte insgesamt						\$ (3.403)	\$ 3.332	\$ 3.332	1,31

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert⁽¹⁾

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	\$ 0	\$ 254.596	\$ 0	\$ 254.596
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	0	(907)	0	(907)
Gesamt	\$ 0	\$ 253.689	\$ 0	\$ 253.689

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	\$ 0	\$ 322.251	\$ 0	\$ 322.251
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	0	662	0	662
Gesamt	\$ 0	\$ 322.913	\$ 0	\$ 322.913

⁽¹⁾ Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

⁽²⁾ Weitere Informationen sind der Aufstellung des Wertpapierbestands zu entnehmen.

⁽³⁾ Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Terminkontrakte, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

(Erhaltene)/verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2018:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC-Derivaten insgesamt	(Erhaltene)/verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (343)	\$ 310	\$ (33)
BPS	(114)	0	(114)
BRC	(175)	0	(175)
CBK	(723)	687	(36)
GLM	1.458	(1.740)	(282)
HUS	(115)	0	(115)
IND	(95)	0	(95)
JPM	12	0	12
RBC	7	0	7
RYL	(146)	(80)	(226)
SCX	(776)	743	(33)
SOG	3	0	3
UAG	100	(290)	(190)

⁽¹⁾ Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.

Vergleichsangaben

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Vergleichsangaben der Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. September 2018:

	30. Sept. 2018 (%)	31. März 2018 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	93,40	91,71
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	5,37	6,33
Sonstige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1,31	0,13
Derivative OTC-Finanzinstrumente	(0,36)	0,20

* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT								Safari Holding Verwaltungs GmbH				
AUSTRALIEN				Europcar Mobility Group				5,375 % due 30.11.2022				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				5,750 % due 15.06.2022				€ 200 € 204 0,33				
Unternehmensanleihe				Faurecia S.A.				Senvion Holding GmbH				
4,000 % due 16.09.2024				3,625 % due 15.06.2023				3,875 % due 25.10.2022				
	€	670	€ 689	1,10		300	€ 309	0,50		200	€ 180	0,29
ÖSTERREICH				Loxam S.A.S.				thyssenkrupp AG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				3,500 % due 15.04.2022				1,375 % due 03.03.2022				
Wienerberger AG				3,500 % due 22.03.2021				1,750 % due 25.11.2020				
5,000 % due 09.02.2021(b)				4,375 % due 03.05.2023 (c)				2,750 % due 08.03.2021				
	50	53	0,09		100	106	0,17		413	418	0,67	
BELGIEN				Nexans S.A.				3,125 % due 25.10.2019				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				2,375 % due 14.04.2023				Deutschland insgesamt				
Sarens Finance Co. NV				6,500 % due 18.01.2019				6,283 10,07				
5,125 % due 05.02.2022				Rexel S.A.								
	100	98	0,16		400	410	0,66					
KANADA				Peugeot S.A.								
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				2,375 % due 14.04.2023								
Bausch Health Cos., Inc.				6,500 % due 18.01.2019								
4,500 % due 15.05.2023				3,500 % due 15.06.2023								
	596	590	0,94		300	317	0,51					
Bombardier, Inc.				Societe Generale S.A.								
6,125 % due 15.05.2021				9,375 % due 04.09.2019 (b)								
	600	659	1,06		400	433	0,69					
Kanada insgesamt				4,199 % due 12.05.2019 (b)								
		1.249	2,00		100	110	0,18					
DÄNEMARK				5,118 % due 02.06.2021 (b)								
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				SPCM S.A.								
DKT Finance ApS				2,875 % due 15.06.2023								
7,000 % due 17.06.2023				Tereos Finance Groupe S.A.								
	500	535	0,86	4,125 % due 16.06.2023								
Norican A/S				4,250 % due 04.03.2020								
4,500 % due 15.05.2023				Vallourec S.A.								
	100	97	0,16	6,625 % due 15.10.2022								
TDC A/S				WFS Global Holding S.A.S.								
3,750 % due 02.03.2022				9,500 % due 15.07.2022								
	400	439	0,70	Frankreich insgesamt				10.565 16,92				
Dänemark insgesamt												
		1.071	1,72									
FINNLAND				DEUTSCHLAND				ITALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				
Nokia Oyj				ADLER Real Estate AG				Almaviva-The Italian Innovation Co. SpA				
1,000 % due 15.03.2021				1,500 % due 06.12.2021				7,250 % due 15.10.2022				
	400	407	0,65		300	302	0,48	200 195 0,31				
Teollisuus Voima Oyj				1,875 % due 27.04.2023				Astaldi SpA				
2,500 % due 17.03.2021				Bilfinger SE				7,125 % due 01.12.2020				
	250	260	0,42		400	392	0,63	300 74 0,12				
2,625 % due 13.01.2023				2,375 % due 07.12.2019				Autostrada Brescia Verona Vicenza Padova SpA				
	250	261	0,42		140	143	0,23	2,375 % due 20.03.2020				
Finnland insgesamt				Deutsche Lufthansa AG				Banca IFIS SpA				
		928	1,49	5,125 % due 12.08.2015				2,000 % due 24.04.2023				
FRANKREICH				Deutsche Pfandbriefbank AG				4,500 % due 17.10.2027				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				2,875 % due 28.06.2027				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
Accor S.A.				Douglas GmbH				3,625 % due 01.04.2019				
4,125 % due 30.06.2020 (b)				6,250 % due 15.07.2022				5,375 % due 18.01.2028				
	200	211	0,34		150	124	0,20	Banco BPM SpA				
Arkema S.A.				Hapag-Lloyd AG				1,750 % due 24.04.2023				
4,750 % due 29.10.2020 (b)				6,750 % due 01.02.2022				2,750 % due 27.07.2020				
	200	214	0,34		200	210	0,34	3,500 % due 14.03.2019				
Banijay Group S.A.S.				Hornbach Baumarkt AG				4,250 % due 30.01.2019				
4,000 % due 01.07.2022				3,875 % due 15.02.2020				6,000 % due 05.11.2020				
	350	364	0,58		200	209	0,33	6,375 % due 31.05.2027				
BPCE S.A.				IHO Verwaltungs GmbH (2,750 % bar oder 3,500 % PIK)				BPER Banca				
12,500 % due 30.09.2019 (b)				2,750 % due 15.09.2021 (a)				5,125 % due 31.05.2027				
	200	224	0,36		200	206	0,33	Buzzi Unicem SpA				
Casino Guichard Perrachon S.A.				IHO Verwaltungs GmbH (3,250 % bar oder 4,000 % PIK)				2,125 % due 28.04.2023				
1,865 % due 13.06.2022				3,250 % due 15.09.2023 (a)				Cooperativa Muratori & Cementisti-CMC di Ravenna SC				
	200	180	0,29		400	409	0,65	6,000 % due 15.02.2023				
4,407 % due 06.08.2019				4,125 % due 06.12.2021				6,875 % due 01.08.2022				
	200	203	0,33		412	451	0,72	Iccrea Banca SpA				
4,561 % due 25.01.2023				Kirk Beauty One GmbH				0,661 % due 01.02.2021				
	300	292	0,47		100	58	0,09	1,500 % due 21.02.2020				
4,870 % due 31.01.2019 (b)				8,750 % due 15.07.2023				1,875 % due 25.11.2019				
	200	152	0,24		100	58	0,09	Intesa Sanpaolo SpA				
5,244 % due 09.03.2020				KME AG				5,000 % due 23.09.2019				
	100	102	0,16		150	148	0,24	5,150 % due 16.07.2020				
5,731 % due 12.11.2018				LANXESS AG				8,375 % due 14.10.2019 (b)				
	100	100	0,16		250	272	0,44	Leonardo SpA				
5,976 % due 26.05.2021				Norddeutsche Landesbank Girozentrale				4,500 % due 19.01.2021				
	200	207	0,33		400	412	0,66	5,250 % due 21.01.2022				
CMA CGM S.A.				Nordex SE				Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA				
6,500 % due 15.07.2022				6,500 % due 01.02.2023				5,000 % due 15.11.2020				
	370	369	0,59		100	98	0,16	824 876 1,40				
7,750 % due 15.01.2021				Platin GmbH				Moby SpA				
	300	306	0,49		130	129	0,21	7,750 % due 15.02.2023				
Crown European Holdings S.A.				Raffinerie Heide GmbH				Rekeep SpA				
2,250 % due 01.02.2023				6,375 % due 01.12.2022				9,000 % due 15.06.2022				
	300	307	0,49		100	97	0,16	Salini Impregilo SpA				
4,000 % due 15.07.2022				RWE AG				3,750 % due 24.06.2021				
	422	467	0,75		120	123	0,20					
Elis S.A.				2,750 % due 21.04.2015								
1,875 % due 15.02.2023												
	400	403	0,65									
3,000 % due 30.04.2022												
	380	387	0,62									

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Sisal Group SpA 7,000 % due 31.07.2023	€ 188	€ 194	0,31	Horizon Parent Holdings SARL (8,250 % bar oder 9,000 % PIK) 8,250 % due 15.02.2022 (a)	€ 200	€ 210	0,34	Caixa Geral de Depositos S.A. 5,750 % due 28.06.2028	€ 200	€ 211	0,34
Snaitech SpA 6,375 % due 07.11.2021	100	104	0,17	Capital Luxembourg S.A. 6,750 % due 15.09.2021	100	83	0,13	EDP - Energias de Portugal S.A. 5,375 % due 16.09.2075	300	325	0,52
Telecom Italia SpA 2,500 % due 19.07.2023	200	202	0,32	Kleopatra Holdings S.C.A. (8,500 % bar oder 8,500 % PIK) 8,500 % due 30.06.2023 (a)	190	134	0,22	Portugal insgesamt		733	1,17
3,250 % due 16.01.2023	100	105	0,17	Lecta S.A. 6,500 % due 01.08.2023	175	181	0,29	SPANIEN			
4,000 % due 21.01.2020	200	210	0,34	Matterhorn Telecom S.A. 3,875 % due 01.05.2022	570	582	0,93	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
4,500 % due 25.01.2021	250	271	0,43	SES S.A. 4,625 % due 02.01.2022 (b)	100	104	0,17	Banco de Credito Social Cooperativo S.A. 7,750 % due 07.06.2027	100	97	0,16
4,875 % due 25.09.2020	200	217	0,35	5,625 % due 29.01.2024 (b)	110	117	0,19	Banco de Sabadell S.A. 6,250 % due 26.04.2020	250	273	0,44
5,250 % due 10.02.2022	200	225	0,36	SIG Combibloc Holdings S.C.A. 7,750 % due 15.02.2023	100	104	0,17	Bankia S.A. 3,375 % due 15.03.2027	300	310	0,50
5,375 % due 29.01.2019	100	102	0,16	Swissport Financing SARL 6,750 % due 15.12.2021	250	262	0,42	4,000 % due 22.05.2024	200	204	0,33
UniCredit SpA 4,375 % due 03.01.2027	200	206	0,33	9,750 % due 15.12.2022	100	109	0,17	Bankinter S.A. 2,500 % due 06.04.2027	300	306	0,49
5,750 % due 28.10.2025	360	382	0,61	UniCredit International Bank Luxembourg S.A. 8,125 % due 10.12.2019 (b)	100	106	0,17	Cellnex Telecom S.A. 3,125 % due 15.03.2022	200	214	0,34
6,125 % due 19.04.2021	60	66	0,11	Luxemburg insgesamt		6.591	10,56	Haya Finance S.A. 5,250 % due 15.11.2022	110	103	0,16
6,950 % due 31.10.2022	342	394	0,63	NIEDERLANDE				Ibercaja Banco S.A. 5,000 % due 28.07.2025	300	313	0,50
Unione di Banche Italiane SpA 1,750 % due 12.04.2023	450	425	0,68	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				Obrascon Huarte Lain S.A. 4,750 % due 15.03.2022	110	95	0,15
4,250 % due 05.05.2026	300	297	0,48	CBR Fashion Finance BV 5,125 % due 01.10.2022	200	170	0,27	5,500 % due 15.03.2023	100	87	0,14
Unipol Gruppo SpA 4,375 % due 05.03.2021	200	214	0,34	Constellium NV 4,625 % due 15.05.2021	100	102	0,16	Spanien insgesamt		2.002	3,21
Wind Tre SpA 2,625 % due 20.01.2023	650	614	0,98	Dufry One BV 2,500 % due 15.10.2024	300	300	0,48	SCHWEDEN			
Italien insgesamt		12.438	19,93	Ferrovial Netherlands BV 2,124 % due 14.05.2023 (b)	200	184	0,29	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
JAPAN				Gas Natural Fenosa Finance BV 4,125 % due 18.11.2022 (b)	400	421	0,67	Corral Petroleum Holdings AB (11,750 % bar oder 13,250 % PIK) 11,750 % due 15.05.2021 (a)	110	120	0,19
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				Hertz Holdings Netherlands BV 5,500 % due 30.03.2023	150	154	0,25	Fastighets AB Balder 3,000 % due 07.03.2078	200	194	0,31
SoftBank Group Corp. 4,000 % due 30.07.2022	240	258	0,41	IPD 3 BV 4,500 % due 15.07.2022	200	205	0,33	Intrum AB 2,625 % due 15.07.2022	100	98	0,16
4,000 % due 20.04.2023	500	527	0,85	Maxeda DIY Holding BV 6,125 % due 15.07.2022	200	194	0,31	2,750 % due 15.07.2022	590	573	0,92
Japan insgesamt		785	1,26	Nyrstar Netherlands Holdings BV 8,500 % due 15.09.2019	300	279	0,45	Radisson Hotel Holdings AB 6,875 % due 15.07.2023	100	109	0,17
JERSEY, KANALINSELN				OCJ NV 5,000 % due 15.04.2023	200	211	0,34	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 0,875 % due 01.03.2021	110	111	0,18
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				Oi European Group BV 3,125 % due 15.11.2024	100	103	0,17	Verisure Holding AB 6,000 % due 01.11.2022	90	93	0,15
Lincoln Finance Ltd. 6,875 % due 15.04.2021	380	394	0,63	3,4875 % due 31.03.2021	100	111	0,18	Volvo Car AB 3,250 % due 18.05.2021	200	215	0,34
LUXEMBURG				6,750 % due 15.09.2020	150	169	0,27	Schweden insgesamt		1.513	2,42
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				Phoenix PIB Dutch Finance BV 3,125 % due 27.05.2020	300	313	0,50	VEREINIGTES KÖNIGREICH			
Aldesa Financial Services S.A. 7,250 % due 01.04.2021	110	95	0,15	Promontoria Holding BV 6,750 % due 15.08.2023	180	182	0,29	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Altice Financing S.A. 5,250 % due 15.02.2023	400	417	0,67	Repsol International Finance BV 3,875 % due 25.03.2021 (b)	320	338	0,54	Algeco Global Finance PLC 6,500 % due 15.02.2023	310	328	0,53
Altice Finco S.A. 9,000 % due 15.06.2023	100	105	0,17	Saipem Finance International BV 2,750 % due 05.04.2022	340	350	0,56	Boparan Finance PLC 4,375 % due 15.07.2021	100	92	0,15
7,250 % due 15.05.2022	930	929	1,49	3,000 % due 08.03.2021	200	208	0,33	EC Finance PLC 2,375 % due 15.11.2022	350	351	0,56
ARD Finance S.A. (6,625 % bar oder 7,375 % PIK) 6,625 % due 15.09.2023(a)	117	121	0,19	SRLEV NV 9,000 % due 15.04.2041	130	153	0,25	INEOS Finance PLC 4,000 % due 01.05.2023	300	307	0,49
BMBG Bond Finance S.C.A. 3,000 % due 15.06.2021	100	101	0,16	Telefonica Europe BV 2,625 % due 07.06.2023 (b)	100	96	0,15	International Game Technology PLC 4,125 % due 15.02.2020	180	188	0,30
Codere Finance Luxembourg S.A. 6,750 % due 01.11.2021	200	189	0,30	3,750 % due 15.03.2022 (b)	300	307	0,49	4,750 % due 15.02.2023	350	378	0,61
ContourGlobal Power Holdings S.A. 3,375 % due 01.08.2023	205	206	0,33	3,875 % due 22.09.2026 (b)	100	94	0,15	5,750 % due 07.04.2021	100	96	0,15
Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % due 15.04.2023	300	295	0,47	4,200 % due 04.12.2019 (b)	300	310	0,50	onal Personal Finance PLC 5,750 % due 07.04.2021	500	521	0,83
Crystal Almond SARL 10,000 % due 01.11.2021	100	108	0,17	5,000 % due 31.03.2020 (b)	200	211	0,34	ntertainments PLC 2,750 % due 15.03.2022	100	103	0,16
DEA Finance S.A. 7,500 % due 15.10.2022	100	107	0,17	United Group BV 4,375 % due 01.07.2022	200	206	0,33	OTE PLC 2,375 % due 18.07.2022	100	210	0,34
Fiat Chrysler Finance Europe S.A. 4,750 % due 22.03.2021	100	110	0,18	Niederlande insgesamt		5.371	8,60	2,375 % due 09.07.2020	200	210	0,34
4,750 % due 15.07.2022	544	613	0,98	PORTUGAL				4,375 % due 02.12.2019	650	679	1,09
6,750 % due 14.10.2019	690	737	1,18	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				ower Corp. Finance PLC 5,500 % due 01.05.2019	287	286	0,46
Galapagos Holding S.A. 7,000 % due 15.06.2022	100	53	0,09	Banco Comercial Portugues S.A. 4,500 % due 07.12.2027	200	197	0,31	Synlab Bondco PLC 6,250 % due 01.07.2022	430	446	0,71
Garfunkelux Holdco S.A. 7,500 % due 01.08.2022	210	207	0,33								
Gestamp Funding Luxembourg S.A. 3,500 % due 15.05.2023	200	206	0,33								

Aufstellung des Wertpapierbestands

PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF (Fortsetzung)

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
TA MFG. Ltd. 3,625 % due 15.04.2023	€ 100	€ 102	0,16
Tesco Corporate Treasury Services PLC 1,375 % due 01.07.2019	480	484	0,78
2,125 % due 12.11.2020	100	103	0,16
Tesco PLC 3,375 % due 02.11.2018	400	401	0,64
Thomas Cook Finance PLC 3,875 % due 15.07.2023	300	285	0,46
Thomas Cook Group PLC 6,250 % due 15.06.2022	290	302	0,48
Titan Global Finance PLC 2,375 % due 16.11.2024	100	98	0,16
Travelex Financing PLC 8,000 % due 15.05.2022	100	98	0,16
Worldpay Finance PLC 3,750 % due 15.11.2022	200	217	0,35
Vereinigtes Königreich insgesamt		6.075	9,73
USA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Ball Corp. 3,500 % due 15.12.2020	200	215	0,35
CGG Holding US, Inc. 7,875 % due 01.05.2023	100	107	0,17
Coty, Inc. 4,000 % due 15.04.2023	300	296	0,47
Federal-Mogul LLC 4,875 % due 15.04.2022	420	439	0,70
5,000 % due 15.07.2024	100	107	0,17
Huntsman International LLC 5,125 % due 15.04.2021	350	388	0,62
Infor U.S., Inc. 5,750 % due 15.05.2022	100	103	0,17
MPT Operating Partnership LP 4,000 % due 19.08.2022	360	395	0,63
PSPC Escrow Corp. 6,000 % due 01.02.2023	300	315	0,51
Vereinigte Staaten insgesamt		2.365	3,79
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt – amtliche Börse/geregelter Markt	€ 61.196	98,04	

Aufstellung des Wertpapierbestands

PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF (Fortsetzung)

30. September 2018

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Typ	Verfallsmonat	# der Kontrakte	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl December Futures	Long	12/2018	3	€ (2)	0,00
Euro-Schatz December Futures	Short	12/2018	18	€ 3	0,00
				€ 1	0,00
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente insgesamt				€ 1	0,00
Anlagen insgesamt				€ 61.197	98,04
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				€ 1.222	1,96
Nettovermögen				€ 62.419	100,00

ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd.*):

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Unbegrenzte Laufzeit; sofern ein Datum angegeben ist, stellt dies den nächsten vertraglichen Abruftermin dar.

(c) Zum 30. September 2018 wurden Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von insgesamt € 207 gemäß den Bedingungen der Rahmen-Rückkaufverträge und/oder globalen Rahmen-Rückkaufverträge als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von € 12 waren zum 30. September 2018 als Sicherheiten für börsengehandelte und zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente verpfändet.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert⁽¹⁾

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 61.196	€ 0	€ 61.196
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	€ 1	€ 0	€ 0	€ 1
Gesamt	€ 1	€ 61.196	€ 0	€ 61.197

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 24.210	€ 0	€ 24.210
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	€ (3)	€ 0	€ 0	€ (3)
Gesamt	€ (3)	€ 24.210	€ 0	€ 24.207

⁽¹⁾ Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

⁽²⁾ Weitere Informationen sind der Aufstellung des Wertpapierbestands zu entnehmen.

⁽³⁾ Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Terminkontrakte, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. September 2018:

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Leihbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	(1,000) %	19.09.2018	TBD ⁽¹⁾	€ (196)	€ (196)	(0,31)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt					€ (196)	(0,31)

⁽¹⁾ Umgekehrte Pensionsgeschäfte mit offener Laufzeit.

Vergleichsangaben

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Vergleichsangaben der Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. September 2018:

	30. Sept. 2018 (%)	31. März 2018 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	98,04	96,55
Sonstige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	0,00	0,43
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,00	(0,01)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,31)	0,00

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE – AMTLICHE BÖRSE/GEREGLER MARKT			
AUSTRALIEN			
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Driver Australia Four Trust 2,780 % due 21.07.2026	AUD 1.863	€ 1.159	0,04
Driver Australia Three Trust 3,550 % due 21.05.2024	2.712	1.699	0,06
Flexi ABS Trust 2,500 % due 23.05.2019	356	221	0,01
2,920 % due 23.06.2023	600	374	0,02
		3.453	0,13
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Optus Finance Pty. Ltd. 3,500 % due 15.09.2020	€ 1.200	1.281	0,05
Origin Energy Finance Ltd. 2,875 % due 11.10.2019	3.480	3.583	0,13
		4.864	0,18
NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES			
Liberty Funding Pty. Ltd. 2,490 % due 10.10.2049	AUD 554	345	0,01
Pepper Residential Securities Trust 2,485 % due 16.09.2059	775	483	0,02
TORRENS Trust 2,935 % due 14.09.2041	2.821	1.757	0,07
		2.585	0,10
Australien insgesamt		10.902	0,41
ÖSTERREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
OeBB-Infrastruktur AG 4,500 % due 02.07.2019	€ 15.333	15.908	0,59
BELGIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Anheuser-Busch InBev S.A. 0,000 % due 19.10.2018	19.800	19.809	0,74
Euroclear Bank S.A. 0,029 % due 10.07.2020	700	703	0,03
0,082 % due 08.03.2021	4.300	4.325	0,16
KBC Group NV 2,375 % due 25.11.2024	3.300	3.379	0,12
Belgien insgesamt		28.216	1,05
BERMUDA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Aircastle Ltd. 7,625 % due 15.04.2020	\$ 200	182	0,01
KANADA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Royal Bank of Canada 0,179 % due 24.07.2020	€ 7.100	7.152	0,27
KAIMANINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Baidu, Inc. 2,750 % due 09.06.2019	\$ 525	450	0,02
Coredoor Tamweel Ltd. 3,039 % due 03.12.2018	1.000	861	0,03
QNB Finance Ltd. 2,400 % due 14.03.2019	4.600	3.915	0,15
3,663 % due 31.05.2021	18.300	15.896	0,59
3,693 % due 07.02.2020	9.100	7.894	0,29
Kaimaninseln insgesamt		29.016	1,08
CHINA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Bank of China Ltd. 0,179 % due 17.04.2021	€ 14.500	14.511	0,54

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0,229 % due 12.10.2020	€ 13.300	€ 13.309	0,49
Sinopec Group Overseas Development Ltd. 1,750 % due 29.09.2019	\$ 6.550	5.547	0,21
2,125 % due 03.05.2019	200	171	0,01
		33.538	1,25
STAATSANLEIHEN			
China Development Bank 0,875 % due 09.10.2018	€ 1.200	1.200	0,04
China insgesamt		34.738	1,29
KOLUMBIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Ecopetrol S.A. 7,625 % due 23.07.2019	\$ 100	89	0,00
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
AP Møller - Maersk A/S 3,375 % due 28.08.2019	€ 12.286	12.671	0,47
ISS Global A/S 1,125 % due 09.01.2020	3.000	3.034	0,12
Dänemark insgesamt		15.705	0,59
FINNLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Fingrid Oyj 0,314 % due 19.11.2018	SEK 20.000	1.938	0,07
FRANKREICH			
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Bavarian Sky S.A. 0,028 % due 22.11.2023	€ 5.512	5.515	0,20
Cars Alliance Auto Loans France 0,029 % due 21.10.2029	9.600	9.628	0,36
Driver France FCT Compartment Driver France Three 0,079 % due 21.04.2024	5.739	5.749	0,21
FCT Ginkgo Compartment Personal Loans 0,000 % due 18.01.2039	4.463	4.473	0,17
FCT Ginkgo Compartment Sales Finance 0,029 % due 25.11.2044	3.500	3.517	0,13
FCT Titrisocram 0,079 % due 25.07.2036	27.800	27.890	1,04
0,109 % due 25.11.2035	1.313	1.315	0,05
Purple Master Credit Cards 0,000 % due 25.10.2028	2.000	2.001	0,07
0,000 % due 25.10.2030 (a)	7.200	7.219	0,27
		67.307	2,50
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Caisse Centrale du Credit Immobilier de France S.A. 1,125 % due 22.04.2019	7.600	7.663	0,29
Carrefour S.A. 1,750 % due 22.05.2019	1.293	1.309	0,05
Christian Dior SE 0,750 % due 24.06.2021	500	506	0,02
CNP Assurances 7,500 % due 18.10.2018 (d)	\$ 700	604	0,02
Dexia Credit Local S.A. 0,040 % due 11.12.2019	€ 27.500	27.615	1,03
0,250 % due 19.03.2020	6.700	6.754	0,25
1,375 % due 18.09.2019	50.000	50.827	1,89
1,625 % due 29.10.2018	14.590	14.611	0,54
Orange S.A. 3,875 % due 09.04.2020	900	954	0,04
RCI Banque S.A. 0,681 % due 18.03.2019	800	803	0,03
Renault S.A. 0,750 % due 26.11.2018	¥ 2.600.000	19.727	0,73
Safran S.A. 0,009 % due 13.07.2020	€ 4.800	4.801	0,18
Sanofi 0,000 % due 21.03.2020 (b)	1.500	1.504	0,06

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Unibail-Rodamco SE 0,125 % due 14.05.2021	€ 2.800	€ 2.804	0,10
Vilmorin & Cie S.A. 2,375 % due 26.05.2021	4.100	4.271	0,16
		144.753	5,39
NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES			
SapphireOne Mortgages FCT 0,181 % due 25.02.2061	14.512	14.541	0,54
0,181 % due 25.06.2061	8.743	8.778	0,33
0,181 % due 27.06.2061	6.194	6.222	0,23
		29.541	1,10
STAATSANLEIHEN			
CANADA			
Caisse Francaise de Financement Local 0,359 % due 20.11.2018	€ 5.600	5.594	0,21
SNCF Réseau 0,050 % due 23.10.2018	7.100	7.102	0,26
UNEDIC 0,040 % due 25.05.2019	15.750	15.793	0,59
		28.489	1,06
Frankreich insgesamt		270.090	10,05
DEUTSCHLAND			
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Asset-Backed European Securitisation Transaction Eleven UG 0,079 % due 21.06.2026	3.354	3.362	0,13
Bavarian Sky S.A. 0,028 % due 20.06.2025	3.529	3.537	0,13
Red & Black Auto Germany UG 0,000 % due 15.02.2024	502	503	0,02
0,128 % due 15.09.2025	4.390	4.402	0,16
SC Germany Auto UG 0,000 % due 13.12.2025	1.707	1.710	0,06
0,028 % due 13.12.2026	3.992	4.003	0,15
		17.517	0,65
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Daimler AG 2,000 % due 07.04.2020	6.000	6.189	0,23
Deutsche Bank AG 0,181 % due 07.12.2020	19.100	18.920	0,70
0,229 % due 15.04.2019	9.800	9.802	0,36
Deutsche Hypothekbank AG 1,072 % due 22.03.2021	€ 12.400	13.917	0,52
Deutsche Pfandbriefbank AG 1,875 % due 20.12.2019	1.900	2.149	0,08
FMS Wertmanagement 0,000 % due 18.02.2019 (b)	€ 20.000	20.038	0,75
0,000 % due 26.02.2019 (b)	24.100	24.147	0,90
0,000 % due 15.04.2019 (b)	4.300	4.311	0,16
0,000 % due 20.10.2020 (b)	20.000	20.134	0,75
Fresenius SE & Co. KGaA 2,375 % due 01.02.2019	400	403	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,875 % due 18.03.2019	18.950	19.072	0,71
Landesbank Baden-Wuerttemberg 1,075 % due 18.05.2021	€ 5.700	6.405	0,24
NRW Bank 4,250 % due 29.04.2019	€ 1.000	1.027	0,04
Volkswagen Bank GmbH 0,101 % due 15.06.2021	500	499	0,02
Volkswagen Financial Services AG 0,029 % due 11.10.2019	15.700	15.715	0,58
Volkswagen Leasing GmbH 0,029 % due 06.07.2019	3.500	3.503	0,13
0,250 % due 16.02.2021	1.200	1.198	0,04
		167.429	6,23
STAATSANLEIHEN			
REPUBLIC OF GERMANY			
1,000 % due 12.10.2018 (f)	100	100	0,00
3,750 % due 04.01.2019 (f)	34.000	34.397	1,28
State of Berlin Germany 0,800 % due 27.09.2019	1.000	1.012	0,04

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
State of North Rhine-Westphalia 1,000 % due 15.02.2019	€ 1.500	€ 1.508	0,06
		37.017	1,38
Deutschland insgesamt		221.963	8,26
INDIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,917 % due 26.02.2019	\$ 200	173	0,01
ONGC Videsh Ltd. 3,250 % due 15.07.2019	200	172	0,01
State Bank of India 3,287 % due 06.04.2020	34.000	29.372	1,09
Indien insgesamt		29.717	1,11
IRLAND			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Bosphorus CLO DAC 0,850 % due 15.04.2027	€ 5.269	5.265	0,20
Harvest CLO DAC 0,601 % due 15.11.2028	1.800	1.801	0,07
SCF Rahoituspalvelut DAC 0,129 % due 25.11.2025	2.233	2.237	0,08
SCF Rahoituspalvelut Kimi DAC 0,029 % due 25.11.2026	2.778	2.782	0,10
		12.085	0,45
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co. Ltd. 7,500 % due 24.07.2039	7.900	8.357	0,31
GE Capital European Funding Unlimited Co. 0,059 % due 21.01.2020	11.400	11.433	0,43
		19.790	0,74
NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES			
Bluestep Mortgage Securities DAC 0,401 % due 10.08.2066	4.131	4.144	0,15
Irland insgesamt		36.019	1,34
ITALIEN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Alba SPV SRL 0,001 % due 27.03.2038	3.049	3.052	0,11
Driver Italia One SRL 0,029 % due 21.04.2029	9.116	9.125	0,34
Quarzo CQS SRL 0,000 % due 18.11.2033	4.910	4.881	0,18
Sunnise SPV 0,090 % due 27.04.2041	2.680	2.683	0,10
0,190 % due 27.06.2041	744	745	0,03
		20.486	0,76
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Intesa Sanpaolo SpA 5,000 % due 25.10.2018	5.530	5.548	0,21
NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES			
Mars SRL 0,979 % due 25.10.2050	1.094	1.102	0,04
Mecenate SRL 0,000 % due 20.10.2048	6	6	0,00
Vela Home SRL 0,000 % due 25.10.2042	2.191	2.184	0,08
		3.292	0,12
STAATSANLEIHEN			
Italy Certificati Di Credito Del Tesoro 0,532 % due 15.12.2020	264.720	260.444	9,69
Italien insgesamt		289.770	10,78

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
JAPAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Chugoku Electric Power Co., Inc. 2,701 % due 16.03.2020	\$ 400	€ 342	0,02
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,985 % due 26.07.2021	700	605	0,02
Japan insgesamt		947	0,04
LUXEMBURG			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Bavarian Sky Europe S.A. 0,028 % due 15.07.2026	€ 2.200	2.201	0,08
Bavarian Sky S.A. 0,028 % due 20.10.2023	1.225	1.227	0,05
0,028 % due 20.05.2024	8.989	9.008	0,34
0,028 % due 20.10.2024	11.098	11.121	0,42
Bumper S.A. 0,258 % due 23.03.2026	11.865	11.886	0,44
Compartment VCL 0,029 % due 21.09.2023	11.096	11.119	0,41
Red & Black Auto Lease Germany S.A. 0,028 % due 15.11.2027	9.484	9.494	0,35
Silver Arrow Compartment Silver Arrow UK 1,076 % due 20.07.2023	£ 561	629	0,02
Silver Arrow S.A. 0,000 % due 15.10.2023	€ 1.215	1.215	0,05
0,078 % due 17.03.2025	14.269	14.306	0,53
		72.206	2,69
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Allergan Funding SCS 0,031 % due 01.06.2019	6.950	6.957	0,26
Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 2,850 % due 25.10.2019	CHF 1.500	1.352	0,05
0,625 % due 15.10.2018	€ 1.600	1.603	0,06
HeidelbergCement Finance Luxembourg S.A. 9,500 % due 15.12.2018	9.400	9.585	0,35
NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank 0,250 % due 10.03.2020	400	402	0,01
Pure Finance S.A. 0,010 % due 24.01.2019	155	156	0,01
		20.055	0,74
Luxemburg insgesamt		92.261	3,43
MALAYSIA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Petronas Capital Ltd. 5,250 % due 12.08.2019	\$ 24.500	21.486	0,80
NIEDERLANDE			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Bumper NL Finance BV 0,028 % due 22.07.2031	€ 22.578	22.599	0,84
Duchess CLO BV 1,031 % due 28.02.2023	800	802	0,03
Globaldrive Auto Receivables BV 0,000 % due 20.01.2024	474	474	0,02
0,028 % due 20.08.2025	2.389	2.397	0,09
0,128 % due 20.08.2024	1.184	1.188	0,04
		27.460	1,02
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
ASR Nederland NV 10,000 % due 26.10.2019 (d)	4.000	4.419	0,16
BMW Finance NV 0,125 % due 03.07.2020	7.300	7.325	0,27
BNG Bank NV 1,875 % due 06.06.2019	3.450	3.504	0,13
Coöperatieve Rabobank UA 0,038 % due 27.11.2019	SEK 135.000	13.085	0,49
6,875 % due 19.03.2020 (e)	€ 17.750	19.446	0,72
Daimler International Finance BV 0,000 % due 15.03.2019 (b)	500	501	0,02

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Deutsche Telekom International Finance BV 0,029 % due 03.04.2020	€ 14.000	€ 14.048	0,52
ING Bank NV 3,500 % due 21.11.2023	1.300	1.307	0,05
4,125 % due 21.11.2023	\$ 7.050	6.079	0,23
LeasePlan Corp. NV 0,201 % due 04.11.2020	€ 5.400	5.422	0,20
1,000 % due 08.04.2020	4.100	4.154	0,16
2,375 % due 23.04.2019	3.300	3.345	0,12
Mylan NV 0,181 % due 24.05.2020	14.200	14.225	0,53
Nederlandse Gasunie NV 0,049 % due 16.10.2018	4.400	4.401	0,16
Schaeffler Finance BV 3,500 % due 15.05.2022	1.200	1.216	0,05
Syngenta Finance NV 3,698 % due 24.04.2020	\$ 994	854	0,03
Toyota Motor Finance Netherlands BV 0,029 % due 27.04.2020	€ 14.200	14.238	0,53
Vesteda Finance BV 1,750 % due 22.07.2019	2.950	2.977	0,11
Volkswagen Financial Services NV 2,375 % due 13.11.2018	£ 5.966	6.708	0,25
Volkswagen International Finance NV 4,000 % due 12.08.2020	\$ 100	87	0,00
Vonovia Finance BV 0,031 % due 20.11.2019	€ 4.500	4.509	0,17
3,125 % due 25.07.2019	7.800	8.005	0,30
		139.855	5,20
NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES			
Arena NHG BV 0,000 % due 17.06.2048	43	43	0,00
0,011 % due 17.06.2048	7.000	7.017	0,26
Dolphin Master Issuer BV 0,051 % due 28.09.2099	4.900	4.908	0,19
		11.968	0,45
STAATSANLEIHEN			
Netherlands Government International Bond 1,250 % due 15.01.2019	80.200	80.630	3,00
Niederlande insgesamt		259.913	9,67
NORWEGEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Telenor ASA 0,245 % due 19.03.2019	SEK 90.000	8.728	0,32
2,375 % due 19.03.2019	30.000	2.937	0,11
Norwegen insgesamt		11.665	0,43
SINGAPUR			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Flex Ltd. 4,625 % due 15.02.2020	\$ 100	87	0,00
SÜDKOREA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Industrial Bank of Korea 2,000 % due 30.10.2018	€ 4.800	4.808	0,18
STAATSANLEIHEN			
Export-Import Bank of Korea 0,375 % due 15.03.2019	8.000	8.015	0,30
Südkorea insgesamt		12.823	0,48
SPANIEN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Asset-Backed European Securitisation Transaction Thirteen FT 0,028 % due 23.08.2030	4.100	4.095	0,15
Driver Espana Four FT 0,009 % due 21.04.2028	19.045	19.058	0,71

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Wizink Master Credit Cards FT 0,078 % due 26.12.2031	€ 15.000	15.026	0,56
		38.179	1,42
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Bankia S.A.			
5,000 % due 28.06.2019	4.000	4.155	0,15
Cajamar Caja Rural SCC 3,750 % due 22.11.2018	4.000	4.022	0,15
Programa Cédulas TDA Fondo de Titulización de Activos 4,000 % due 23.10.2018	10.400	10.426	0,39
		18.603	0,69
NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES			
AyT Fondo de Titulización Hipotecaria			
0,000 % due 15.10.2035	217	217	0,01
AyT Hipotecario Mixto FTA 0,000 % due 15.09.2035	423	422	0,02
Bancaja Fondo de Titulización de Activos 0,000 % due 22.05.2050	6.802	6.770	0,25
RMBS Prado FT 0,581 % due 17.03.2056	14.744	14.897	0,56
TDA Ibercaja Fondo de Titulización de Activos 0,000 % due 26.07.2035	1.426	1.420	0,05
TDA Mixto Fondo de Titulización de Activos 0,000 % due 27.06.2042	97	96	0,00
		23.822	0,89
Spanien insgesamt		80.604	3,00
SUPRANATIONAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
European Bank for Reconstruction & Development 0,000 % due 18.12.2018	7.305.000	5.625	0,21
European Investment Bank 10,170 % due 20.11.2018	5.015	5.123	0,19
Supranational insgesamt		10.748	0,40
SCHWEDEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Essity AB 0,000 % due 27.11.2018 (b)	9.500	9.502	0,35
Lansforsakringar Hypotek AB 3,250 % due 16.09.2020	SEK 386.700	39.912	1,48
Nordea Hypotek AB 2,250 % due 19.06.2019	436.000	43.037	1,60
Skandinaviska Enskilda Banken AB 3,000 % due 19.06.2019	431.000	42.757	1,59
Stadshypotek AB 2,500 % due 18.09.2019	180.000	17.920	0,67
Sveriges Sakerställda Obligationer AB 4,000 % due 18.09.2019	440.000	44.511	1,66
Swedbank Hypotek AB 3,750 % due 19.06.2019	428.000	42.712	1,59
Swedbank Hypotek AB 5,700 % due 12.05.2020	400.000	42.379	1,58
searun AB 0,031 % due 10.08.2020	€ 13.900	13.914	0,52
		296.644	11,04
STAATSANLEIHEN			
Sweden Government International Bond			
0,750 % due 02.05.2019	1.863	1.877	0,07
Schweden insgesamt		298.521	11,11
SCHWEIZ			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
UBS AG 0,179 % due 10.01.2020	3.800	3.817	0,14
0,179 % due 23.04.2021	36.000	36.208	1,35
0,181 % due 05.09.2019	2.000	2.007	0,07
Schweiz insgesamt		42.032	1,56

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Glencore Finance Dubai Ltd. 2,625 % due 19.11.2018	€ 8.800	€ 8.829	0,33
VEREINIGTES KÖNIGREICH			
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Bumper UK Finance PLC 1,256 % due 20.11.2027	£ 1.136	1.276	0,05
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
BAT International Finance PLC 0,375 % due 13.03.2019	€ 2.300	2.302	0,09
2,750 % due 15.06.2020	\$ 600	511	0,02
Coca-Cola European Partners PLC 2,000 % due 05.12.2019	€ 1.000	1.020	0,04
FCE Bank PLC 0,181 % due 26.08.2020	5.000	4.989	0,19
G4S International Finance PLC 2,625 % due 06.12.2018	14.370	14.441	0,54
Imperial Brands Finance PLC 5,000 % due 02.12.2019	11.310	11.975	0,44
INEOS Grangemouth PLC 0,750 % due 30.07.2019	11.310	11.404	0,42
Lloyds Bank PLC 6,500 % due 24.03.2020	35.500	38.805	1,44
10,375 % due 12.02.2024	7.873	8.171	0,30
National Express Group PLC 0,081 % due 15.05.2020	2.100	2.096	0,08
Nationwide Building Society 0,181 % due 02.11.2018	900	900	0,03
6,750 % due 22.07.2020	3.600	4.013	0,15
Natwest Markets PLC 0,081 % due 02.03.2020	38.900	38.862	1,45
Royal Bank of Scotland Group PLC 1,625 % due 25.06.2019	3.100	3.138	0,12
Santander UK PLC 0,081 % due 27.02.2020	26.300	26.370	0,98
2,000 % due 14.01.2019	2.609	2.626	0,10
Sky PLC 0,432 % due 01.04.2020	14.112	14.220	0,53
Yorkshire Building Society 2,125 % due 18.03.2019	17.700	17.879	0,66
4,125 % due 20.11.2024	£ 4.700	5.396	0,20
		209.118	7,78
NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES			
Brunel Residential Mortgage Securitisation PLC			
0,000 % due 13.01.2039	€ 28	28	0,00
Eurosaif PLC 0,000 % due 10.12.2044	1.971	1.956	0,07
0,000 % due 13.03.2045	1.900	1.870	0,07
Gosforth Funding PLC 0,129 % due 24.07.2058	2.896	2.900	0,11
0,131 % due 15.02.2058	5.000	5.018	0,19
Lanark Master Issuer PLC 0,131 % due 22.12.2054	200	200	0,01
Silverstone Master Issuer PLC 0,000 % due 21.01.2070	12.200	12.223	0,45
0,129 % due 21.01.2070	8.960	8.994	0,33
		33.189	1,23
Vereinigtes Königreich insgesamt		243.583	9,06
USA			
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
SLM Student Loan Trust 0,000 % due 15.12.2023	3.364	3.369	0,13
0,000 % due 25.01.2024	1.174	1.174	0,04
0,000 % due 17.06.2024	530	529	0,02
		5.072	0,19
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
AbbVie, Inc. 0,375 % due 18.11.2019	13.100	13.159	0,49

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
American Honda Finance Corp. 0,081 % due 11.03.2019	€ 200	€ 200	0,01
Amgen, Inc. 2,125 % due 13.09.2019	10.815	11.051	0,41
AT&T, Inc. 0,081 % due 03.08.2020	20.600	20.659	0,77
Aviation Capital Group LLC 3,013 % due 30.07.2021	\$ 400	346	0,01
BAT Capital Corp. 0,181 % due 16.08.2021	€ 20.400	20.415	0,76
2,297 % due 14.08.2020	\$ 500	422	0,02
Charter Communications Operating LLC 3,579 % due 23.07.2020	900	776	0,03
Citibank N.A. 2,917 % due 23.07.2021	8.300	7.188	0,27
Citigroup, Inc. 7,375 % due 04.09.2019	€ 6.800	7.276	0,27
CVS Health Corp. 2,957 % due 09.03.2020	\$ 16.300	14.109	0,52
D.R. Horton, Inc. 2,550 % due 01.12.2021	100	84	0,00
Enterprise Products Operating LLC 2,550 % due 15.10.2019	1.600	1.372	0,05
5,200 % due 01.09.2020	100	89	0,00
5,250 % due 31.01.2020	2.900	2.564	0,09
Ford Motor Credit Co. LLC 0,051 % due 01.12.2021	€ 7.600	7.452	0,28
0,111 % due 14.05.2021	7.900	7.831	0,29
2,425 % due 12.06.2020	\$ 200	169	0,01
2,459 % due 27.03.2020	200	169	0,01
3,085 % due 12.10.2021	8.900	7.595	0,28
3,124 % due 12.06.2020	200	172	0,01
3,157 % due 04.08.2020	200	171	0,01
General Electric Co. 0,756 % due 30.07.2019	SEK 58.000	5.650	0,21
General Mills, Inc. 0,409 % due 15.01.2020	€ 6.300	6.350	0,24
Goldman Sachs Group, Inc. 0,131 % due 16.12.2020	29.400	29.431	1,09
0,381 % due 29.05.2020	1.165	1.174	0,04
0,430 % due 29.10.2019	4.700	4.728	0,18
IPALCO Enterprises, Inc. 3,450 % due 15.07.2020	\$ 100	86	0,00
JPMorgan Chase & Co. 2,750 % due 23.06.2020	1.500	1.282	0,05
Kinder Morgan Energy Partners LP 2,650 % due 01.02.2019	300	258	0,01
Kraft Heinz Foods Co. 2,800 % due 02.07.2020	300	256	0,01
2,911 % due 10.02.2021	200	172	0,01
Marathon Oil Corp. 2,700 % due 01.06.2020	100	85	0,00
McDonald's Corp. 0,000 % due 05.04.2019	€ 1.600	1.603	0,06
0,000 % due 26.08.2019	4.200	4.210	0,16
Morgan Stanley 0,061 % due 09.11.2021	28.500	28.453	1,06
0,081 % due 21.05.2021	6.300	6.303	0,23
Pfizer, Inc. 0,000 % due 06.03.2019	500	501	0,02
Philip Morris International, Inc. 1,750 % due 19.03.2020	12.600	12.933	0,48
Reynolds American, Inc. 3,250 % due 12.06.2020	\$ 100	86	0,00
Southern Co. 2,750 % due 15.06.2020	200	171	0,01
Southern Power Co. 2,888 % due 20.12.2020	100	86	0,00
Sprint Spectrum Co. LLC 3,360 % due 20.03.2023	150	129	0,00
Thermo Fisher Scientific, Inc. 0,000 % due 24.07.2019	€ 1.400	1.402	0,05
United Technologies Corp. 0,000 % due 18.05.2020	11.000	11.023	0,41
VMware, Inc. 2,300 % due 21.08.2020	\$ 200	169	0,01

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Wachovia Corp. 4,375 % due 27.11.2018	€ 4.200	€ 4.230	0,16
Wells Fargo & Co. 0,299 % due 26.04.2021	7.000	7.056	0,26
h America Capital, Inc. 2,250 % due 26.04.2019	2.000	2.027	0,08
4,000 % due 29.04.2020	\$ 150	130	0,00
Zimmer Biomet Holdings, Inc. 3,089 % due 19.03.2021	300	259	0,01
		253.512	9,43
Vereinigte Staaten insgesamt		258.584	9,62
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
COMMERCIAL PAPER			
Pure Finance S.A. 0,122 % due 10.01.2019	€ 135	135	0,01
0,122 % due 11.01.2019	596	596	0,02
0,122 % due 16.01.2019	330	330	0,01
0,152 % due 08.02.2019	184	183	0,01
0,152 % due 14.02.2019	158	158	0,01
0,152 % due 27.02.2019	317	317	0,01
0,152 % due 06.03.2019	129	129	0,00
0,152 % due 13.03.2019	105	106	0,00
0,152 % due 15.03.2019	127	127	0,00
2,729 % due 04.01.2019	\$ 615	526	0,02
2,774 % due 17.01.2019	532	455	0,02
2,774 % due 22.01.2019	3.476	2.968	0,11
Ubisoft Entertainment S.A. 0,010 % due 09.10.2018	€ 7.400	7.400	0,28
		13.430	0,50
PENSIONSGESCHÄFTE (g)			
		33.391	1,47
FRANCE TREASURY BILLS			
(0,648)% due 04.01.2019 (b)(c)	44.000	44.079	1,64
(0,640)% due 30.01.2019 (b)(c)	44.000	44.095	1,64
(0,636)% due 04.01.2019 (b)(c)	20.000	20.036	0,75
(0,634)% due 04.01.2019 (b)(c)	44.400	44.479	1,65
(0,622)% due 04.01.2019 (b)(c)	28.400	28.451	1,06
		181.140	6,74
GERMANY TREASURY BILLS			
(0,608)% due 05.12.2018 (b)(c)(f)	400	401	0,01
(0,603)% due 05.12.2018 (b)(c)(f)	230	230	0,01
		631	0,02
ESM TREASURY BILLS			
(0,545)% due 22.11.2018 (b)(c)	310	310	0,01
(0,544)% due 20.12.2018 (b)(c)	1.000	1.001	0,04
(0,497)% due 24.01.2019 (b)(c)	52.500	52.591	1,96
(0,395)% due 04.10.2018 (b)(c)	24.500	24.501	0,91
		78.403	2,92
Kurzfristige Instrumente insgesamt		312.995	11,65
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt – amtliche Börse/geregelter Markt	€ 2.646.483		98,48

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

DEVISENKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettvermögens
AZD	11/2018	\$ 297	€ 256	€ 2	€ 0	€ 2	0,00
BOA	11/2018	3.789	3.247	6	(10)	(4)	0,00
	01/2019	€ 63.525	DKK 472.291	0	(159)	(159)	(0,01)
BPS	11/2018	AUD 11.354	€ 7.177	125	0	125	0,00
	11/2018	€ 1.316	£ 1.177	3	0	3	0,00
	11/2018	5.444	\$ 6.326	5	(21)	(16)	0,00
	11/2018	¥ 2.611.000	€ 20.498	712	0	712	0,03
	11/2018	\$ 6.224	5.391	61	(10)	51	0,00
BRC	11/2018	€ 1.199	SEK 12.565	18	0	18	0,00
	11/2018	\$ 503	€ 428	0	(4)	(4)	0,00
CBK	10/2018	€ 973	DKK 7.256	0	0	0	0,00
	11/2018	\$ 149.405	€ 129.312	1.132	(9)	1.123	0,04
	01/2019	DKK 7.256	973	0	0	0	0,00
HUS	11/2018	SEK 425.735	40.302	0	(920)	(920)	(0,04)
	11/2018	\$ 660	567	1	0	1	0,00
JPM	11/2018	CHF 1.543	1.364	3	0	3	0,00
	11/2018	€ 2.102	SEK 22.100	38	0	38	0,00
	11/2018	1.318	\$ 1.551	13	0	13	0,00
	11/2018	£ 34.202	€ 37.998	0	(344)	(344)	(0,01)
	11/2018	\$ 727	619	0	(5)	(5)	0,00
NAB	11/2018	153	130	0	(1)	(1)	0,00
RBC	11/2018	€ 1.134	\$ 1.324	2	0	2	0,00
	11/2018	\$ 3.000	€ 2.556	0	(18)	(18)	0,00
RYL	10/2018	€ 36.446	DKK 271.064	0	(97)	(97)	0,00
	01/2019	\$ 3.476	€ 2.932	0	(32)	(32)	0,00
SCX	11/2018	2.620	2.250	2	0	2	0,00
	01/2019	DKK 469.953	63.238	185	0	185	0,01
SOG	10/2018	278.319	37.466	144	0	144	0,01
	11/2018	SEK 2.790.752	267.735	0	(2.475)	(2.475)	(0,09)
SSB	11/2018	€ 926	AUD 1.509	12	0	12	0,00
	11/2018	\$ 1.138	€ 990	14	0	14	0,00
	01/2019	532	448	0	(6)	(6)	0,00
				€ 2.478	€ (4.111)	€ (1.633)	(0,06)

Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt

€ (1.633) (0,06)

Anlagen insgesamt

€ 2.644.850 98,42

Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

€ 42.469 1,58

Nettvermögen

€ 2.687.319 100,00

ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd. *):

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

(a) „When-issued“-Wertpapier.

(b) Nullkupon-Papier.

(c) Kupon stellt eine Rendite bis Fälligkeit dar.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; sofern ein Datum angegeben ist, stellt dies den nächsten vertraglichen Abruftermin dar.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Zum 30. September 2018 wurden Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von insgesamt \$ 1.004 und Barmittel in Höhe von \$ 3.118 als Sicherheiten für derivative Finanzinstrumente verpfändet, die von Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. geregelt werden.

(g) Pensionsgeschäfte zum 30. September 2018:

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	(Erhaltene Sicherheiten)	Pensionsge- schäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsge- schäften ⁽¹⁾	% des Nettvermögens
BPS	(0,850) %	28.09.2018	01.10.2018	€ 2.000	Republic of Germany 4,750 % due 04.07.2034	€ (2.043)	€ 2.000	€ 2.000	0,07
COM	(0,550)	28.09.2018	01.10.2018	37.200	FMS Wertmanagement 0,000 % due 30.07.2020	(37.456)	37.200	37.198	1,39
SSB	1,100	28.09.2018	01.10.2018	\$ 222	U.S. Treasury Notes 2,000 % due 31.08.2021	(198)	191	191	0,01
Pensionsgeschäfte insgesamt						€ (39.697)	€ 39.391	€ 39.389	1,47

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert⁽¹⁾

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 2.646.356	€ 127	€ 2.646.483
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	0	(1.633)	0	(1.633)
Gesamt	€ 0	€ 2.644.723	€ 127	€ 2.644.850

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 2.839.385	€ 0	€ 2.839.385
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	0	8.715	0	8.715
Gesamt	€ 0	€ 2.848.100	€ 0	€ 2.848.100

⁽¹⁾ Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

⁽²⁾ Weitere Informationen sind der Aufstellung des Wertpapierbestands zu entnehmen.

⁽³⁾ Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Terminkontrakte, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2018:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC-Derivaten insgesamt	(Erhaltene)/verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement ⁽¹⁾
AZD	€ 2	€ 0	€ 2
BOA	(163)	145	(18)
BPS	875	(960)	(85)
BRC	14	0	14
CBK	1.123	(1.827)	(704)
HUS	(919)	869	(50)
JPM	(295)	241	(54)
NAB	(1)	0	(1)
RBC	(16)	0	(16)
RYL	(129)	(80)	(209)
SCX	187	0	187
SOG	(2.331)	2.867	536
SSB	20	0	20

⁽¹⁾ Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.

Vergleichsangaben

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Vergleichsangaben der Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. September 2018:

	30. Sept. 2018 (%)	31. März 2018 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	90,18	89,04
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	6,30	8,82
Sonstige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	2,00	2,33
Derivative OTC-Finanzinstrumente	(0,06)	0,31
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	0,00	(0,02)

* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Aufstellung des Wertpapierbestands
PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
BESCHREIBUNG WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE – AMTLICHE BÖRSE/GEREGLTER MARKT				FRANKREICH				INDONESIEN			
ARGENTINIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				STAATSANLEIHEN			
STAATSANLEIHEN				Banque Federative du Credit Mutuel S.A.				Indonesia Government International Bond			
Argentina Government International Bond				0,500 % due 16.11.2022				2,625 % due 14.06.2023			
6,250 % due 22.04.2019	\$ 1.000	€ 864	0,34	€ 900	€ 898	0,35			€ 1.600	€ 1.682	0,66
6,875 % due 22.04.2021	700	578	0,22	BNP Paribas S.A.							
Argentinien insgesamt		1.442	0,56	1,125 % due 22.11.2023							
				2,500 % due 19.03.2025							
AUSTRALIEN				Dexia Credit Local S.A.							
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				0,625 % due 21.01.2022							
National Australia Bank Ltd.				HSBC France S.A.							
2,000 % due 12.11.2024 (e)	€ 1.800	1.829	0,71	0,200 % due 04.09.2021							
				0,600 % due 20.03.2023							
BELGIEN				Ingenico Group S.A.							
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				1,625 % due 13.09.2024							
Euroclear Bank S.A.				2,500 % due 20.05.2021							
0,250 % due 07.09.2022	2.500	2.482	0,97	RCI Banque S.A.							
KBC Group NV				0,129 % due 08.07.2020							
0,875 % due 27.06.2023	900	901	0,35	0,681 % due 18.03.2019							
UCB S.A.				1,125 % due 30.09.2019							
1,875 % due 02.04.2022	1.200	1.245	0,49	Safran S.A.							
3,750 % due 27.03.2020	1.400	1.472	0,57	0,251 % due 28.06.2021							
4,125 % due 04.01.2021	1.920	2.080	0,81	SEB S.A.							
5,125 % due 02.10.2023	217	255	0,10	2,375 % due 25.11.2022							
Belgien insgesamt		8.435	3,29	TDF Infrastructure S.A.S.							
				2,875 % due 19.10.2022							
BERMUDA				Ubisoft Entertainment S.A.							
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				1,289 % due 30.01.2023							
Bacardi Ltd.				500							
2,750 % due 03.07.2023	1.900	2.023	0,79	Frankreich insgesamt				24.657			
								9,62			
KANADA				DEUTSCHLAND				IRLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
WestJet Airlines Ltd.				Deutsche Bank AG				Abbott Ireland Financing DAC			
3,500 % due 16.06.2021	\$ 225	191	0,07	1,125 % due 30.08.2023				0,000 % due 27.09.2020 (b)			
				4,250 % due 14.10.2021				0,875 % due 27.09.2023			
KAIMANINSSELN				5,000 % due 24.06.2020				Bank of Ireland			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				Deutsche Pfandbriefbank AG				4,250 % due 11.06.2024			
Hutchison Whampoa Finance Ltd.				1,625 % due 30.08.2019				German Postal Pensions Securitisation PLC			
1,375 % due 31.10.2021	€ 1.200	1.234	0,48	Hochtief AG				3,750 % due 18.01.2021			
				2,625 % due 28.05.2019				4,375 % due 18.01.2022			
CHINA				IHO Verwaltungs GmbH (2,750 % bar oder 3,500 % PIK)				2,000			
STAATSANLEIHEN				2,750 % due 15.09.2021 (a)				2,400			
China Development Bank				Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				0,000 % due 15.12.2022 (b)(f)			
0,375 % due 16.11.2021	700	696	0,27	0,000 % due 15.09.2023 (b)(f)				1,600			
				ProSiebenSat.1 Media SE				2,625 % due 15.04.2021			
ZYPERN				Symrise AG							
STAATSANLEIHEN				1,750 % due 10.07.2019							
Cyprus Government International Bond				thyssenkrupp AG							
2,750 % due 27.06.2024 (f)	1.100	1.197	0,47	3,125 % due 25.10.2019							
				Volkswagen Bank GmbH							
DÄNEMARK				0,101 % due 15.06.2021							
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				0,381 % due 08.12.2021							
AP Moller - Maersk A/S				Volkswagen Financial Services AG							
1,750 % due 18.03.2021	1.200	1.240	0,48	0,375 % due 12.04.2021							
Danske Bank A/S				Volkswagen Leasing GmbH							
0,125 % due 09.03.2021	1.800	1.809	0,71	0,250 % due 05.10.2020							
ISS Global A/S				0,250 % due 16.02.2021							
1,125 % due 09.01.2020	1.300	1.315	0,51	Deutschland insgesamt				27.752			
Nykredit Realkredit A/S								10,82			
0,750 % due 14.07.2021	100	101	0,04	GUERNSEY, KANALINSSELN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Dänemark insgesamt		4.465	1,74	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
				Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.							
FINNLAND				1,250 % due 14.04.2022							
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				2,500 % due 26.09.2020							
Sampo Oyj				Eastern Creation Investment Holdings Ltd.							
1,125 % due 24.05.2019	2.700	2.721	1,06	\$ 400							
Teollisuuden Voima Oyj											
2,500 % due 17.03.2021	1.000	1.041	0,41	INDIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Finland insgesamt		3.762	1,47	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
				Bharti Airtel International Netherlands BV							
				4,000 % due 10.12.2018							
				€ 1.800				1.813			
								0,71			

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS		
CPI Property Group S.A. 2,125 % due 04.10.2024	€	300	€	298	0,12	STAATSANLEIHEN		Santander UK Group Holdings PLC 0,531 % due 27.03.2024	€	1.700	€	1.684	0,66
Eurofins Scientific SE 2,125 % due 25.07.2024	1.900	1.911	0,74	Autonomous Community of Catalonia 4,900 % due 15.09.2021	€	900	€	968	1,400	1.385	0,54		
Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 3,389 % due 20.03.2020	2.700	2.810	1,10	Spain Government International Bond 1,400 % due 31.01.2020 (f)	2.100	2.147	0,84	Santander UK PLC 0,875 % due 25.11.2020	500	508	0,20		
SELP Finance SARL 1,250 % due 25.10.2023	200	199	0,08					3,812 % due 14.03.2019	\$	2.300	1.992	0,78	
		12.472	4,86	Spanien insgesamt		3.745	1,46	Sky PLC 0,432 % due 01.04.2020	€	1.550	1.562	0,61	
Luxemburg insgesamt		12.794	4,99			9.753	3,80	Tesco Corporate Treasury Services PLC 1,375 % due 01.07.2019	427	431	0,17		
				SCHWEDEN				Tesco PLC 3,375 % due 02.11.2018	600	602	0,23		
MEXIKO				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				Virgin Money PLC 2,250 % due 21.04.2020	€	1.400	1.580	0,62	
Petroleos Mexicanos 3,750 % due 15.03.2019	3.200	3.251	1,27	Fastighets AB Balder 1,125 % due 14.03.2022	1.400	1.410	0,55	Yorkshire Building Society 2,125 % due 18.03.2019	€	500	505	0,20	
				Molnlycke Holding AB 1,500 % due 28.02.2022	1.000	1.030	0,40	Vereinigtes Königreich insgesamt		44.451	17,34		
				Schweden insgesamt		2.644	1,03	USA					
								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN					
								American Tower Corp. 1,375 % due 04.04.2025	1.200	1.181	0,46		
								AT&T, Inc. 0,081 % due 03.08.2020	3.600	3.610	1,41		
								Bank of America Corp. 0,052 % due 21.09.2021	1.500	1.500	0,58		
								0,379 % due 25.04.2024	1.300	1.300	0,51		
								0,481 % due 07.02.2022	2.100	2.118	0,83		
								BAT Capital Corp. 0,181 % due 16.08.2021	4.100	4.103	1,60		
								Bayer U.S. Finance LLC 3,003 % due 25.06.2021	\$	1.600	1.383	0,54	
								3,344 % due 15.12.2023	1.600	1.381	0,54		
								Celanese U.S. Holdings LLC 3,250 % due 15.10.2019	€	600	620	0,24	
								Citigroup, Inc. 0,750 % due 26.10.2023	2.900	2.868	1,12		
								1,375 % due 27.10.2021	400	414	0,16		
								CVS Health Corp. 3,700 % due 09.03.2023	\$	1.100	943	0,37	
								Discovery Communications LLC 3,048 % due 20.09.2019	1.300	1.124	0,44		
								Equinix, Inc. 2,875 % due 15.03.2024	€	600	609	0,24	
								General Motors Financial Co., Inc. 0,955 % due 07.09.2023	500	490	0,19		
								Goldman Sachs Group, Inc. 0,131 % due 16.12.2020	1.500	1.502	0,59		
								0,311 % due 09.09.2022	1.400	1.404	0,55		
								0,679 % due 27.07.2021	1.100	1.119	0,44		
								2,000 % due 27.07.2023	2.000	2.091	0,81		
								International Flavors & Fragrances, Inc. 0,500 % due 25.09.2021	1.100	1.103	0,43		
								0,17JP Morgan Chase & Co. 0,625 % due 25.01.2024	1.300	1.282	0,50		
								2,750 % due 24.08.2022	600	653	0,25		
								Kinder Morgan, Inc. 1,500 % due 16.03.2022	900	927	0,36		
								Kraft Heinz Foods Co. 2,000 % due 30.06.2023	700	735	0,29		
								Molson Coors Brewing Co. 0,031 % due 15.03.2019	200	200	0,08		
								Morgan Stanley 0,081 % due 21.05.2021	2.500	2.501	0,97		
								1,000 % due 02.12.2022	1.100	1.115	0,43		
								Pfizer, Inc. 0,000 % due 06.03.2020 (b)	1.000	1.003	0,39		
								Philip Morris International, Inc. 2,875 % due 30.05.2024	1.200	1.328	0,52		
								Thermo Fisher Scientific, Inc. 1,500 % due 01.12.2020	1.000	1.028	0,40		
								United Technologies Corp. 1,150 % due 18.05.2024	200	201	0,08		
								Wells Fargo & Co. 2,625 % due 16.08.2022	500	541	0,21		
								3,572 % due 31.10.2023	\$	1.700	1.493	0,58	

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
ZF North America Capital, Inc. 2,750 % due 27.04.2023	€ 1.200	€ 1.282	0,50
Zimmer Biomet Holdings, Inc. 1,414 % due 13.12.2022	1.000	1.021	0,40
		46.173	18,01
US-TREASURY-OBLIGATIONEN			
U.S. Treasury Notes 1,875 % due 31.08.2022	\$ 5.400	4.469	1,74
Vereinigte Staaten insgesamt		50.642	19,75
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
PENSIONSGESCHÄFTE (g)		115	0,04
Kurzfristige Instrumente insgesamt		115	0,04
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt – amtliche Börse/geregelter Markt		€ 256.833	100,16

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Typ	Verfallsmonat	# der Kontrakte		Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Call Options Strike @ EUR 132.250 on Euro-Bobl December 2018 Futures	Short	11/2018	66	€	3	0,00
Call Options Strike @ EUR 132.500 on Euro-Bobl December 2018 Futures	Short	11/2018	40		4	0,00
Call Options Strike @ EUR 162.000 on Euro-Bobl November 2018 Futures	Short	10/2018	14		6	0,00
Euro-Bobl December Futures	Long	12/2018	466		(299)	(0,12)
Euro-Bund 10-Year Bond December Futures	Short	12/2018	95		161	0,06
Euro-Schatz December Futures	Long	12/2018	507		(65)	(0,03)
Put Options Strike @ EUR 130.500 on Euro-Bobl December 2018 Futures	Short	11/2018	66		(11)	0,00
Put Options Strike @ EUR 130.750 on Euro-Bobl December 2018 Futures	Short	11/2018	40		(8)	0,00
Put Options Strike @ EUR 159.000 on Euro-Bobl November 2018 Futures	Short	10/2018	14		(4)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note December Futures	Short	12/2018	74		92	0,04
United Kingdom Long Gilt December Futures	Short	12/2018	64		116	0,05
				€	(5)	0,00
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente insgesamt				€	(5)	0,00

ZENTRAL ABGEWICKELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF EMISSIONEN VON UNTERNEHMEN, STAATEN UND US-KOMMUNEN - SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu (zahlender) Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag ⁽³⁾		Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Wendel S.A.	(5,000) %	20.06.2022	€ 2.600	€	95	0,04

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF EMISSIONEN VON UNTERNEHMEN, STAATEN UND US-KOMMUNEN - ALS SICHERUNGSGEBER⁽²⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag ⁽³⁾		Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
CDX.IG-31 5-Year Index	1,000 %	20.12.2023	\$ 5.200	€	7	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.06.2021	€ 600		4	0,00
Telefonica Emisiones S.A.U.	1,000	20.06.2022	1.600		(5)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.U.	1,000	20.12.2022	1.300		(4)	0,00
				€	2	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - ALS SICHERUNGSGEBER⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag ⁽³⁾		Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
CDX.IG-30 5-Year Index	1,000 %	20.06.2023	\$ 1.200	€	2	0,00
iTraxx Europe Senior 29 5-Year Index	1,000	20.06.2023	€ 6.400		(17)	(0,01)
				€	(15)	(0,01)

ZINSSWAPS

Zu zahlen/ zu erhalten variabler Zins	Zinsvariabler Index	Festzins	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag		Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens	
Zu erhalten	6-Month JPY-LIBOR	0,300 %	20.09.2027	¥ 380.000	€	8	0,01	
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente insgesamt						€	90	0,04

⁽¹⁾ Agiert der Fonds als Sicherungsnehmer und es kommt zu einem Ausfall wie in den Bedingungen der betreffenden Swap-Vereinbarung definiert, erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen dem Nominalbetrag des Swaps entsprechenden Betrag und liefert die Referenzschuldverschreibung oder Basiswerte des Referenzindex oder (ii) den Betrag des Nettoausgleichs in Form von liquiden Mitteln, Wertpapieren oder sonstigen lieferbaren Schuldverschreibungen im Gegenwert des Nominalbetrags des Swaps abzüglich der Erlösquote der Referenzschuldverschreibung oder Basiswerte des Referenzindex.

⁽²⁾ Agiert der Fonds als Sicherungsgeber und es kommt zu einem Ausfall wie in den Bedingungen der betreffenden Swap-Vereinbarung definiert, zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen dem Nominalbetrag des Swaps entsprechenden Betrag und erhält die Referenzschuldverschreibung oder Basiswerte des Referenzindex geliefert oder (ii) den Betrag des Nettoausgleichs in Form von liquiden Mitteln, Wertpapieren oder sonstigen lieferbaren Schuldverschreibungen im Gegenwert des Nominalbetrags des Swaps abzüglich der Erlösquote der Referenzschuldverschreibung oder Basiswerte des Referenzindex.

⁽³⁾ Der Maximalbetrag, der vom Fonds bei einem Kreditereignis nach Maßgabe der betreffenden Swap-Vereinbarung als Sicherungsgeber potenziell gefordert oder als Sicherungsnehmer potenziell vereinnahmt werden kann.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

VERKAUFTE OPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf- verkauf	Ausübungssatz	Verfallsdatum	Nominalbetrag	Prämie	Beizulegen- der Zeitwert	% des Nettovermögens
BRC	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900 %	17.10.2018	€ 8.000	€ (12)	€ 0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	17.10.2018	10.000	(12)	0	0,00
						€ (24)	€ 0	0,00

DEWISENKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
BPS	11/2018	€ 937	\$ 1.100	€ 7	€ 0	€ 7	0,00
	11/2018	\$ 1.038	€ 904	13	0	13	0,01
CBK	11/2018	26.164	22.651	202	0	202	0,08
HUS	11/2018	€ 278	€ 250	2	0	2	0,00
JPM	11/2018	£ 8.973	€ 9.969	0	(90)	(90)	(0,04)
RBC	11/2018	€ 268	\$ 313	1	0	1	0,00
SOG	11/2018	1.062	€ 950	3	0	3	0,00
	11/2018	SEK 1.900	€ 182	0	(2)	(2)	0,00
				€ 228	€ (92)	€ 136	0,05

Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt

€ 136 0,05

Anlagen insgesamt

€ 257.054 100,25

Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

€ (640) (0,25)

Nettovermögen

€ 256.414 100,00

ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd.*):

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Nullkupon-Papier.

(c) Unbegrenzte Laufzeit; sofern ein Datum angegeben ist, stellt dies den nächsten vertraglichen Abruftermin dar.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Zum 30. September 2018 wurden Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von insgesamt € 8.456 gemäß den Bedingungen der Rahmen-Rückkaufverträge und/oder globalen Rahmen-Rückkaufverträge als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von € 3.297 waren zum 30. September 2018 als Sicherheiten für börsenhandelte und zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente verpfändet.

(g) Pensionsgeschäfte zum 30. September 2018:

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	(Erhaltene) Sicherheiten	Pensionsge- schäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsge- schäften ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
SSB	1,100 %	28.09.2018	01.10.2018	\$ 140	U.S. Treasury Notes 2,000 % due 31.08.2021	€ (118)	€ 115	€ 115	0,04
Pensionsgeschäfte insgesamt						€ (118)	€ 115	€ 115	0,04

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert⁽¹⁾

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 0	€ 256.833	€ 0	€ 256.833
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	(5)	226	0	221
Gesamt	€ (5)	€ 257.059	€ 0	€ 257.054

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	€ 2.258	€ 244.673	€ 0	€ 246.931
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	83	(216)	0	(133)
Gesamt	€ 2.341	€ 244.457	€ 0	€ 246.798

⁽¹⁾ Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

⁽²⁾ Weitere Informationen sind der Aufstellung des Wertpapierbestands zu entnehmen.

⁽³⁾ Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Terminkontrakte, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. September 2018:

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Leihbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	(0,400) %	15.08.2018	18.10.2018	€ (3.105)	€ (3.103)	(1,21)
	(0,300)	02.08.2018	18.10.2018	(2.172)	(2.171)	(0,84)
	(0,180)	10.08.2018	18.10.2018	(1.057)	(1.057)	(0,41)
IND	(0,400)	30.08.2018	18.10.2018	(1.507)	(1.506)	(0,59)
	(0,300)	28.08.2018	18.10.2018	(532)	(532)	(0,21)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt					€ (8.369)	(3,26)

(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2018:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC-Derivaten insgesamt	(Erhaltene)/verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement ⁽¹⁾
BPS	€ 20	€ 0	€ 20
CBK	202	(540)	(338)
HUS	2	0	2
JPM	(90)	0	(90)
RBC	1	0	1
SOG	1	0	1

⁽¹⁾ Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.

Vergleichsangaben

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Vergleichsangaben der Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. September 2018:

	30. Sept. 2018 (%)	31. März 2018 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	99,88	89,26
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	0,24	1,27
Sonstige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	0,04	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	0,00	0,03
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente	0,04	0,02
Derivative OTC-Finanzinstrumente	0,05	(0,10)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(3,26)	0,00

* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

BESCHREIBUNG
WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE –
AMTLICHE BÖRSE/GEREGLTER MARKT

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
AUSTRALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Newcrest Finance Pty. Ltd. 4,450 % due 15.11.2021	\$ 500	\$ 507	0,24
Pacific National Finance Pty Ltd. 4,625 % due 23.09.2020	3.939	3.985	1,89
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 5,125 % due 22.02.2021	600	615	0,29
Telstra Corp. Ltd. 4,800 % due 12.10.2021	2.500	2.574	1,22
Woodside Finance Ltd. 4,600 % due 10.05.2021	2.494	2.533	1,20
Australien insgesamt		10.214	4,84

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
BERMUDA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Aircastle Ltd. 5,500 % due 15.02.2022	1.000	1.040	0,49
IHS Markt Ltd. 5,000 % due 01.11.2022	1.700	1.759	0,84
Bermuda insgesamt		2.799	1,33

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
BRASILIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Banco do Brasil S.A. 4,875 % due 19.04.2023	400	384	0,18
Centrais Elétricas Brasileiras S.A. 6,875 % due 30.07.2019	400	408	0,20
Vale Overseas Ltd. 4,375 % due 11.01.2022	254	257	0,12
Brasilien insgesamt		1.049	0,50

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
STAATSANLEIHEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social 4,000 % due 14.04.2019	200	200	0,09
Brasilien insgesamt		1.249	0,59

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
KANADA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Air Canada Pass-Through Trust 5,375 % due 15.11.2022	65	67	0,03
Canovus Energy, Inc. 5,700 % due 15.10.2019	700	716	0,34
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust 3,125 % due 20.03.2022	800	785	0,37
WestJet Airlines Ltd. 3,500 % due 16.06.2021	3.000	2.953	1,40
Kanada insgesamt		4.521	2,14

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
KAIMANINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Ambac LSNi LLC 7,396 % due 12.02.2023	189	192	0,09
Baidu, Inc. 2,750 % due 09.06.2019	200	199	0,09
Country Garden Holdings Co. Ltd. 7,500 % due 09.03.2020	200	204	0,10
HPHT Finance Ltd. 2,750 % due 11.09.2022	200	189	0,09
Park Aerospace Holdings Ltd. 5,250 % due 15.08.2022	200	203	0,10
QNB Finance Ltd. 2,750 % due 31.10.2018	500	500	0,24
Tencent Holdings Ltd. 3,688 % due 12.02.2020	1.800	1.816	0,86
Tencent Holdings Ltd. 3,375 % due 02.05.2019	200	200	0,09
Kaimaninseln insgesamt		3.503	1,66

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
CHILE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Banco Santander Chile 3,135 % due 25.07.2020	\$ 400	\$ 402	0,19
Corp. Nacional del Cobre de Chile 7,500 % due 15.01.2019	500	506	0,24
Chile insgesamt		908	0,43

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
CHINA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
China Uranium Development Co. Ltd. 3,500 % due 08.10.2018	400	400	0,19
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 0,229 % due 12.10.2020	€ 600	697	0,33
Sinopec Group Overseas Development Ltd. 3,093 % due 08.11.2020	\$ 1.000	999	0,47
Sinopec Group Overseas Development Ltd. 2,500 % due 13.09.2022	1.600	1.519	0,72
China insgesamt		3.615	1,71

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
AP Moller - Maersk A/S 2,875 % due 28.09.2020	900	885	0,42
Danske Bank A/S 3,394 % due 12.09.2023	1.000	991	0,47
Dänemark insgesamt		1.876	0,89

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 2,000 % due 12.04.2019	111	111	0,05
BPCE S.A. 2,750 % due 02.12.2021	500	487	0,23
Pernod Ricard S.A. 4,450 % due 15.01.2022	200	204	0,10
Frankreich insgesamt		802	0,38

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Deutsche Bank AG 2,500 % due 13.02.2019	500	499	0,24
2,700 % due 13.07.2020	500	490	0,23
3,150 % due 22.01.2021	800	782	0,37
3,300 % due 16.11.2022	400	381	0,18
3,307 % due 13.07.2020	1.300	1.295	0,61
3,505 % due 16.11.2022	1.000	981	0,47
Deutschland insgesamt		4.428	2,10

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
GUERNSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 2,750 % due 26.03.2020	1.100	1.090	0,52

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
HONGKONG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
AIA Group Ltd. 2,858 % due 20.09.2021	200	201	0,10
Bao-trans Enterprises Ltd. 3,750 % due 12.12.2018	200	200	0,10
China Shenhu Overseas Capital Co. Ltd. 3,125 % due 20.01.2020	200	198	0,09
CNOOC Finance Australia Pty. Ltd. 2,625 % due 05.05.2020	200	197	0,09
Eastern Creation Investment Holdings Ltd. 3,625 % due 20.03.2019	200	200	0,10
Franshion Brilliant Ltd. 5,750 % due 19.03.2019	400	403	0,19
Poly Real Estate Finance Ltd. 5,250 % due 25.04.2019	800	806	0,38
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 3,950 % due 23.12.2019	1.400	1.398	0,66
Hongkong insgesamt		3.603	1,71

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
INDIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
State Bank of India 3,287 % due 06.04.2020	\$ 1.100	\$ 1.104	0,52

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
IRLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
AerCap Ireland Capital DAC 3,750 % due 15.05.2019	700	703	0,33
4,625 % due 30.10.2020	300	306	0,14
Bank of Ireland Group PLC 4,500 % due 25.11.2023	500	500	0,24
Iberdrola Finance Ireland DAC 5,000 % due 11.09.2019	2.895	2.945	1,40
SMBC Aviation Capital Finance DAC 2,650 % due 15.07.2021	4.365	4.209	2,00
3,000 % due 15.07.2022	2.310	2.221	1,05
Irland insgesamt		10.884	5,16

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
ITALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Intesa Sanpaolo SpA 6,500 % due 24.02.2021	100	104	0,05

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
JAPAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Central Nippon Expressway Co. Ltd. 2,849 % due 03.03.2022	400	390	0,19
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,190 % due 13.09.2021	200	193	0,09
2,985 % due 26.07.2021	700	703	0,33
3,195 % due 26.07.2023	1.200	1.204	0,57
Mizuho Bank Ltd. 2,650 % due 25.09.2019	9	9	0,01
Mizuho Financial Group, Inc. 2,632 % due 12.04.2021	200	195	0,09
2,953 % due 28.02.2022	500	487	0,23
MUFG Bank Ltd 2,300 % due 05.03.2020	200	198	0,09
2,750 % due 14.09.2020	200	198	0,09
ORIX Corp. 2,900 % due 18.07.2022	200	198	0,09
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,058 % due 14.07.2021	300	290	0,14
Japan insgesamt		3.963	1,88

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
JERSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Aptiv PLC 3,150 % due 19.11.2020	1.600	1.586	0,75

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
LUXEMBURG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Holcim U.S. Finance SARL & Cie SCS 6,000 % due 30.12.2019	4.996	5.155	2,45
Schlumberger Investment S.A. 2,400 % due 01.08.2022	800	767	0,36
Luxemburg insgesamt		5.922	2,81

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Idelos Finance SARL 4,136 % due 06.10.2023	50	50	0,02
Ortho-Clinical Diagnostics S.A. 5,492 % due 30.06.2025	96	97	0,05
Luxemburg insgesamt		147	0,07

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
MEXIKO			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
Petroleos Mexicanos 2,500 % due 21.08.2021	€ 500	593	0,28
8,000 % due 03.05.2019	\$ 169	174	0,08
Mexiko insgesamt		767	0,36

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
NIEDERLANDE				USA				USA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN			
ABN AMRO Bank NV				Barclays PLC				CNH Industrial Capital LLC			
2.450 % due 04.06.2020	\$	200	0,19	2.875 % due 08.06.2020	\$	400	0,19	3.375 % due 15.07.2019	\$	700	0,33
British Transco International Finance BV				3.200 % due 10.08.2021		200	0,09	Community Health Systems, Inc.			
0,000 % due 04.11.2021 (b)		450	0,19	HSBC Holdings PLC				5.125 % due 01.08.2021		300	0,14
Cooperative Rabobank UA				2.984 % due 11.09.2021		3.000	1,43	Continental Airlines Pass-Through Trust			
3.234 % due 26.09.2023		1.100	0,52	Lloyds Bank PLC				7.250 % due 10.05.2021		61	0,03
ING Bank NV				2.700 % due 17.08.2020		200	0,09	Continental Resources, Inc.			
2.450 % due 16.03.2020		300	0,14	Lloyds Banking Group PLC				5.000 % due 15.09.2022		480	0,23
2.500 % due 01.10.2019		850	0,40	2.907 % due 07.11.2023		1.000	0,45	CRH America, Inc.			
ING Groep NV				3.153 % due 21.06.2021		200	0,10	5.750 % due 15.01.2021		975	0,48
3.398 % due 02.10.2023 (a)		400	0,19	4.050 % due 16.08.2023		200	0,09	Crown Castle Towers LLC			
LeasePlan Corp. NV				Royal Bank of Scotland Group PLC				3.222 % due 15.05.2042		290	0,13
2.875 % due 22.01.2019		400	0,19	6.400 % due 21.10.2019		100	0,05	D.R. Horton, Inc.			
Petrobras Global Finance BV				Santander UK Group Holdings PLC				2.550 % due 01.12.2020		600	0,28
8.375 % due 10.12.2018		1.200	0,58	2.875 % due 16.10.2020		400	0,19	3.750 % due 01.03.2019		1.500	0,71
Schaeffler Finance BV				Santander UK PLC				DAE Funding LLC			
4.750 % due 15.05.2023		2.965	1,42	2.375 % due 16.03.2020		800	0,38	4.000 % due 01.08.2020		300	0,14
Syngenta Finance NV				2.500 % due 14.03.2019		100	0,05	Digital Realty Trust LP			
3.698 % due 24.04.2020		1.022	0,48	3.400 % due 01.06.2021		700	0,33	3.400 % due 01.10.2020		100	0,05
5.700 % due 23.04.2021		700	0,33	Standard Chartered PLC				DISH DBS Corp.			
Niederlande insgesamt		9.570	4,54	3.594 % due 20.01.2023 (a)		300	0,14	6.750 % due 01.06.2021		100	0,05
				Verenigtes Königreich insgesamt		9.893	4,69	Dominion Energy Gas Holdings LLC			
								2.934 % due 15.06.2021		800	0,38
								Duke Energy Corp.			
								2.819 % due 14.05.2021		1.100	0,52
								Duquesne Light Holdings, Inc.			
								6.400 % due 15.09.2020		1.119	0,56
								Emera U.S. Finance LP			
								2.700 % due 15.06.2021		100	0,05
								Enable Oklahoma Intrastate Transmission LLC			
								6.250 % due 15.03.2020		4.795	2,34
								Energy Transfer Partners LP			
								4.150 % due 01.10.2020		200	0,10
								5.750 % due 01.09.2020		1.400	0,69
								Entergy Texas, Inc.			
								7.125 % due 01.02.2019		600	0,29
								Equifax, Inc.			
								3.184 % due 15.08.2021		2.500	1,19
								Exelon Corp.			
								5.150 % due 01.12.2020		100	0,05
								Fidelity National Financial, Inc.			
								5.500 % due 01.09.2022		200	0,10
								Florida Gas Transmission Co. LLC			
								5.450 % due 15.07.2020		700	0,34
								7.900 % due 15.05.2019		300	0,15
								Ford Motor Credit Co. LLC			
								3.296 % due 24.09.2020		1.100	0,52
								5.750 % due 01.02.2021		700	0,35
								8.125 % due 15.01.2020		500	0,25
								Fortune Brands Home & Security, Inc.			
								3.000 % due 15.06.2020		1.180	0,55
								4.000 % due 21.09.2023		1.000	0,48
								Genesis Energy LP			
								6.750 % due 01.08.2022		100	0,05
								Gerdau Holdings, Inc.			
								7.000 % due 20.01.2020		360	0,18
								Goldman Sachs Group, Inc.			
								2.908 % due 05.06.2023		700	0,32
								Hyundai Capital America			
								3.137 % due 18.09.2020		1.100	0,52
								Incitec Pivot Finance LLC			
								6.000 % due 10.12.2019		4.804	2,34
								International Lease Finance Corp.			
								8.250 % due 15.12.2020		1.600	0,83
								8.625 % due 15.01.2022		150	0,08
								Interpublic Group of Cos., Inc.			
								3.500 % due 01.10.2020		300	0,14
								3.750 % due 01.10.2021		300	0,14
								4.000 % due 15.03.2022		500	0,24
								Intrepid Aviation Group Holdings LLC			
								8.500 % due 15.08.2021		25	0,01
								IPALCO Enterprises, Inc.			
								3.450 % due 15.07.2020		2.436	1,16
								3.700 % due 01.09.2024		100	0,05
								Jackson National Life Global Funding			
								1.875 % due 15.10.2018		100	0,05

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Jefferies Finance LLC				SLM Corp.				2,500 % due 31.05.2020 (e)	\$ 22.300	\$ 22.195	10,52
6,875 % due 15.04.2022	300	303	0,14	5,125 % due 05.04.2022	100	100	0,05	2,500 % due 30.06.2020 (e)	7.500	7.462	3,54
7,375 % due 01.04.2020	400	409	0,19	Southern Co.				2,625 % due 15.05.2021	2.600	2.584	1,22
JPMorgan Chase & Co.				2,802 % due 14.02.2020	500	500	0,24	2,750 % due 31.08.2023	400	397	0,19
3,801 % due 01.03.2021	100	103	0,05	Southern Power Co.				3,500 % due 15.05.2020	3.000	3.034	1,44
Kansas City Southern				1,950 % due 15.12.2019	317	313	0,15				
2,350 % due 15.05.2020	200	196	0,09	Spirit AeroSystems, Inc.							
Kilroy Realty LP				3,134 % due 15.06.2021	1.100	1.102	0,52				
6,625 % due 01.06.2020	300	315	0,15	Springleaf Finance Corp.							
KLAT-Tencor Corp.				5,250 % due 15.12.2019	450	457	0,22				
4,125 % due 01.11.2021	380	386	0,18	6,125 % due 15.05.2022	700	725	0,34				
Marathon Oil Corp.				8,250 % due 15.12.2020	200	218	0,10				
2,700 % due 01.06.2020	500	494	0,23	Sprint Capital Corp.							
Masco Corp.				6,900 % due 01.05.2019	200	204	0,10				
3,500 % due 01.04.2021	400	400	0,19	Sprint Communications, Inc.							
MGM Growth Properties Operating Partnership LP				9,000 % due 15.11.2018	148	149	0,07				
5,625 % due 01.05.2024	100	103	0,05	Sprint Corp.							
MGM Resorts International				7,250 % due 15.09.2021	400	424	0,20				
6,750 % due 01.10.2020	800	843	0,40	Sprint Spectrum Co. LLC							
8,625 % due 01.02.2019	400	408	0,19	3,360 % due 20.03.2023	600	599	0,28				
Mississippi Power Co.				Synchrony Financial							
3,048 % due 27.03.2020	2.505	2.505	1,19	2,800 % due 15.01.2019	100	100	0,05				
MUFG Americas Holdings Corp.				Tallgrass Energy Partners LP							
2,250 % due 10.02.2020	150	148	0,07	4,750 % due 01.10.2023	100	100	0,05				
National Grid North America, Inc.				Time Warner Cable LLC							
2,375 % due 30.09.2020	200	195	0,09	5,000 % due 01.02.2020	1.710	1.746	0,83				
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.				8,250 % due 01.04.2019	310	318	0,15				
2,771 % due 30.06.2021	400	401	0,19	Trimble, Inc.							
Navient Corp.				4,150 % due 15.06.2023	300	300	0,14				
4,875 % due 17.06.2019	1.100	1.110	0,53	Tyson Foods, Inc.							
5,500 % due 15.01.2019	1.300	1.308	0,62	2,250 % due 23.08.2021	325	313	0,15				
8,000 % due 25.03.2020	250	264	0,13	UDR, Inc.							
NetApp, Inc.				4,625 % due 10.01.2022	800	820	0,39				
3,250 % due 15.12.2022	1.000	975	0,46	VEREIT Operating Partnership LP							
NGPL PipeCo LLC				3,000 % due 06.02.2019	275	275	0,13				
4,375 % due 15.08.2022	1.000	1.013	0,48	4,125 % due 01.06.2021	100	101	0,05				
Niagara Mohawk Power Corp.				Vulcan Materials Co.							
4,881 % due 15.08.2019	300	305	0,14	2,934 % due 15.06.2020	100	100	0,05				
ONEOK, Inc.				Wabtec Corp.							
4,250 % due 01.02.2022	200	203	0,10	3,382 % due 15.09.2021	1.100	1.102	0,52				
Owens Corning				Washington Prime Group LP							
4,200 % due 15.12.2022	2.325	2.332	1,11	3,850 % due 01.04.2020	500	495	0,23				
Pennsylvania Electric Co.				WEA Finance LLC							
5,200 % due 01.04.2020	1.500	1.535	0,73	3,150 % due 05.04.2022	500	491	0,23				
Penske Truck Leasing Co. LP				3,250 % due 05.10.2020	600	598	0,28				
4,875 % due 11.07.2022	117	121	0,06	Wells Fargo Bank N.A.							
Plains All American Pipeline LP				3,550 % due 14.08.2023	1.100	1.096	0,52				
2,600 % due 15.12.2019	1.274	1.264	0,60	Welltower, Inc.							
5,750 % due 15.01.2020	798	819	0,39	4,950 % due 15.01.2021	100	103	0,05				
Protective Life Global Funding				Wyndham Destinations, Inc.							
1,999 % due 14.09.2021	200	192	0,09	5,625 % due 01.03.2021	600	615	0,29				
Puget Energy, Inc.				ZF North America Capital, Inc.							
6,000 % due 01.09.2021	500	532	0,25	4,000 % due 29.04.2020	3.113	3.127	1,48				
QVC, Inc.				4,500 % due 29.04.2022	500	507	0,24				
3,125 % due 01.04.2019	2.800	2.800	1,33	Zimmer Biomet Holdings, Inc.							
5,125 % due 02.07.2022	750	760	0,36	3,375 % due 30.11.2021	1.000	989	0,47				
Realty Income Corp.											
3,250 % due 15.10.2022	800	790	0,37								
Reckson Operating Partnership LP											
7,750 % due 15.03.2020	250	264	0,13								
Reliance Standard Life Global Funding											
2,375 % due 04.05.2020	440	433	0,21								
3,050 % due 20.01.2021	200	197	0,09								
RELX Capital, Inc.											
8,625 % due 15.01.2019	600	609	0,29								
S&P Global, Inc.											
3,300 % due 14.08.2020	200	200	0,09								
Sanchez Energy Corp.											
7,750 % due 15.06.2021	400	282	0,13								
Santander Holdings USA, Inc.											
3,700 % due 28.03.2022	700	692	0,33								
SBA Tower Trust											
2,877 % due 10.07.2046	200	197	0,09								
SES Global Americas Holdings GP											
2,500 % due 25.03.2019	2.875	2.868	1,36								
SL Green Operating Partnership LP											
3,345 % due 16.08.2021	300	300	0,14								

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Vereinigte Staaten insgesamt			
	151.534	151.534	71,84

KURZFRISTIGE INSTRUMENTE	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
PENSIONSGESCHÄFTE (f)			
	3.100	3.100	1,47

ARGENTINA TREASURY BILLS	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
(17,566) % due			
12.10.2018 (b)(c) ARS	1.810	49	0,02
(2,381) % due			
28.12.2018 (b)(c)	5.890	148	0,07
(1,816) % due			
28.12.2018 (b)(c)	900	23	0,01
	220	220	0,10
Kurzfristige Instrumente insgesamt			
	3.320	3.320	1,57

Wertpapiere und Geldmarktinstrumente insgesamt – amtliche Börse/geregelter Markt	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
	\$ 247.197	\$ 247.197	117,19

KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
HCA, Inc.			
3,992 % due 18.03.2023	82	82	0,04
Las Vegas Sands LLC			
3,992 % due 27.03.2025	286	286	0,13
RPI Finance Trust			
4,386 % due 27.03.2023	38	39	0,02
	407	407	0,19

EMISSIONEN VON US-BEHÖRDEN	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Fannie Mae, TBA			
3,000 % due 01.11.2048	100	96	0,05
3,500 % due 01.11.2048	500	491	0,23
	587	587	0,28

US-TREASURY OBLIGATIONEN	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
U.S. Treasury Notes			
1,750 % due 30.04.2022 (e)	13.700	13.162	6,24

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Typ	Verfallsmonat	# der Kontrakte	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl December Futures	Short	12/2018	22	\$ 17	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note December Futures	Long	12/2018	29	(18)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note December Futures	Long	12/2018	174	(140)	(0,07)
				\$ (141)	(0,07)
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente insgesamt				\$ (141)	(0,07)

ZENTRAL ABGEWICKELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF EMISSIONEN VON UNTERNEHMEN, STAATEN UND US-KOMMUNEN - ALS SICHERUNGSGEBER⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Daimler AG	1,000 %	20.12.2020	€ 100	\$ 0	0,00
Deutsche Bank AG	1,000	20.06.2019	200	2	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2021	\$ 1.100	66	0,03
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.06.2022	200	9	0,01
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2023	200	(1)	0,00
Host Hotels & Resorts LP	1,000	20.12.2020	100	1	0,00
Kroger Co.	1,000	20.06.2022	100	2	0,00
Morgan Stanley	1,000	20.12.2020	100	0	0,00
Sherwin Williams Co.	1,000	20.06.2022	400	2	0,00
Sherwin Williams Co.	1,000	20.12.2022	600	0	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2019	1.600	(6)	0,00
				\$ 75	0,04

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - ALS SICHERUNGSGEBER⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
CDX.EM-29 5-Year Index	1,000 %	20.06.2023	\$ 950	\$ 15	0,01

ZINSSWAPS

Zu zahlen/ zu erhalten variabler Zins	Zinsvariabler Index	Festzins	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
Zu zahlen	3-Month USD-LIBOR	2,860 %	08.05.2023	\$ 500	\$ 0	0,00
Zu zahlen	3-Month USD-LIBOR	2,960	26.09.2023	1.000	(4)	0,00
Zu zahlen	3-Month USD-LIBOR	3,000	24.09.2023	2.100	(4)	0,00
Zu zahlen	3-Month USD-LIBOR	3,000	26.09.2023	900	(2)	0,00
Zu zahlen	3-Month USD-LIBOR	3,000	02.10.2023	1.000	(3)	0,00
Zu zahlen	3-Month USD-LIBOR	3,040	02.10.2023	2.100	(1)	0,00
Zu erhalten ⁽³⁾	6-Month GBP-LIBOR	1,500	20.03.2024	£ 2.000	5	0,00
Zu erhalten	6-Month JPY-LIBOR	0,500	17.09.2021	¥ 18.000	0	0,00
Zu zahlen	28-Day MXN-TIIE	5,620	18.11.2021	MXN 1.500	1	0,00
Zu zahlen	28-Day MXN-TIIE	5,738	03.05.2023	1.800	(8)	0,00
Zu zahlen	28-Day MXN-TIIE	5,740	02.05.2023	8.400	(38)	(0,02)
Zu zahlen	28-Day MXN-TIIE	7,710	07.03.2025	12.000	(10)	(0,01)
Zu zahlen	CPURNSA	1,273	30.09.2020	\$ 250	4	0,00
Zu zahlen	CPURNSA	1,303	30.09.2020	250	3	0,00
					\$ (57)	(0,03)
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente insgesamt					\$ 33	0,02

⁽¹⁾ Agiert der Fonds als Sicherungsgeber und es kommt zu einem Ausfall wie in den Bedingungen der betreffenden Swap-Vereinbarung definiert, zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen dem Nominalbetrag des Swaps entsprechenden Betrag und erhält die Referenzschuldverschreibung oder Basiswerte des Referenzindex geliefert oder (ii) den Betrag des Nettoausgleichs in Form von liquiden Mitteln, Wertpapieren oder sonstigen lieferbaren Schuldverschreibungen im Gegenwert des Nominalbetrags des Swaps abzüglich der Erlösquote der Referenzschuldverschreibung oder Basiswerte des Referenzindex.

⁽²⁾ Der Maximalbetrag, der vom Fonds bei einem Kreditereignis nach Maßgabe der betreffenden Swap-Vereinbarung als Sicherungsgeber potenziell gefordert oder als Sicherungsnehmer potenziell vereinnahmt werden kann.

⁽³⁾ Dieses Instrument hat ein in der Zukunft liegendes Datum des Inkrafttretens.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

GEKAUFTE OPTIONEN

ZINS-SWAPPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Zinsvariabler Index	Zu zahlen/zu erhalten variabler Zins	Ausübungssatz	Verfallsdatum	Nominalbetrag	Kosten	Beizu- legender Zeitwert	% des Nettovermö- gens
BOA	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu zahlen	3,107 %	12.09.2019	\$ 9.600	\$ 45	\$ 36	0,02
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu zahlen	2,000	04.12.2018	4.300	9	0	0,00
							\$ 54	\$ 36	0,02

VERKAUFTE OPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungssatz	Verfallsdatum	Nominalbetrag	Prämie	Beizu- legender Zeitwert	% des Nettovermö- gens
BPS	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,800 %	17.10.2018	€ 1.000	\$ (1)	\$ 0	0,00
BRC	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.10.2018	\$ 13.000	(17)	(2)	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.10.2018	€ 2.100	(3)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index	Verkauf	0,950	17.10.2018	2.100	(3)	0	0,00
CKL	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	19.12.2018	1.100	(1)	(1)	0,00
DUB	Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index	Verkauf	0,800	19.12.2018	\$ 1.000	(1)	(1)	0,00
FBF	Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index	Verkauf	0,800	21.11.2018	1.100	(1)	0	0,00
GST	Put - OTC CDX.IG-30 5-Year Index	Verkauf	0,700	17.10.2018	1.800	(2)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,950	17.10.2018	€ 900	(1)	0	0,00
JLN	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,850	17.10.2018	1.100	(1)	0	0,00
	Put - OTC iTraxx Europe 29 5-Year Index	Verkauf	0,900	17.10.2018	1.000	(1)	0	0,00
						\$ (32)	\$ (4)	0,00

ZINS-SWAPPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Zinsvariabler Index	Zu zahlen/ zu erhalten variabler Zins	Ausübungssatz	Verfallsdatum	Nominalbetrag	Prämie	Beizu- legender Zeitwert	% des Nettovermö- gens
BOA	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu erhalten	2,910 %	12.10.2018	\$ 1.500	\$ (2)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu zahlen	3,110	12.10.2018	1.500	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu erhalten	2,950	15.10.2018	2.100	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu zahlen	3,150	15.10.2018	2.100	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu erhalten	3,010	24.10.2018	1.000	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu zahlen	3,220	24.10.2018	1.000	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu erhalten	3,100	12.09.2019	2.100	(45)	(35)	(0,02)
BPS	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu erhalten	2,970	18.10.2018	900	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu zahlen	3,170	18.10.2018	900	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu erhalten	3,000	29.10.2018	900	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu zahlen	3,200	29.10.2018	900	(1)	(1)	0,00
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu erhalten	2,875	10.10.2018	900	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu zahlen	3,085	10.10.2018	900	(1)	(1)	0,00
CBK	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu erhalten	3,020	22.10.2018	900	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu zahlen	3,220	22.10.2018	900	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu erhalten	2,173	04.12.2018	900	(9)	0	0,00
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu erhalten	2,840	09.10.2018	800	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu zahlen	3,050	09.10.2018	800	(1)	(2)	0,00
JPM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu erhalten	2,830	04.10.2018	1.000	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zu zahlen	3,040	04.10.2018	1.000	(1)	(2)	(0,01)
						\$ (75)	\$ (51)	(0,03)	

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF EMISSIONEN VON UNTERNEHMEN, STAATEN UND US-KOMMUNEN - ALS SICHERUNGSGEBER⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/erhaltene Prämien	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	Beizu- legender Zeitwert	% des Nettovermö- gens
BRC	Mexico Government International Bond	1,000 %	20.12.2021	\$ 100	\$ (3)	\$ 4	\$ 1	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2022	100	(4)	2	(2)	0,00
	Springleaf Finance Corp.	5,000	20.06.2022	100	8	4	12	0,01
GST	Argentine Republic Government International Bond	5,000	20.06.2022	300	26	(31)	(5)	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2022	200	(8)	3	(5)	0,00
HUS	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	100	(1)	0	(1)	0,00
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2022	100	(9)	3	(6)	(0,01)
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.09.2020	100	(5)	5	0	0,00
JPM	AP Moller - Maersk	1,000	20.06.2022	€ 200	(1)	3	2	0,00
	Petroleos Mexicanos	1,000	20.12.2018	\$ 300	(3)	3	0	0,00
UAG	Park Aerospace Holdings Ltd.	5,000	01.07.2020	100	6	0	6	0,00
					\$ 6	\$ (4)	\$ 2	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - ALS SICHERUNGSGEBER⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Prämien	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	Beizulegender Zeitwert	% des Nettovermögens
DUB	CMBX.NA.BBB-7 Index	3,000 %	17.01.2047	\$ 100	\$ (9)	\$ 4	\$ (5)	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(5)	6	1	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(6)	7	1	0,00
					\$ (20)	\$ 17	\$ (3)	0,00

⁽¹⁾ Agiert der Fonds als Sicherungsgeber und es kommt zu einem Ausfall wie in den Bedingungen der betreffenden Swap-Vereinbarung definiert, zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen dem Nominalbetrag des Swaps entsprechenden Betrag und erhält die Referenzschuldverschreibung oder Basiswerte des Referenzindex geliefert oder (ii) den Betrag des Nettoausgleichs in Form von liquiden Mitteln, Wertpapieren oder sonstigen lieferbaren Schuldverschreibungen im Gegenwert des Nominalbetrags des Swaps abzüglich der Erlösquote der Referenzschuldverschreibung oder Basiswerte des Referenzindex.

⁽²⁾ Der Maximalbetrag, der vom Fonds bei einem Kreditereignis nach Maßgabe der betreffenden Swap-Vereinbarung als Sicherungsgeber potenziell gefordert oder als Sicherungsnehmer potenziell vereinnahmt werden kann.

DEISENTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
BOA	01/2019	\$ 363	EGP 6.799	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
BPS	10/2018	ARS 8.661	\$ 222	12	0	12	0,01
	11/2018	MXN 3.809	198	0	(5)	(5)	0,00
	12/2018	PEN 1.159	348	0	(2)	(2)	0,00
BRC	11/2018	MXN 8.507	440	0	(12)	(12)	(0,01)
CBK	10/2018	€ 1.139	1.326	3	0	3	0,00
	11/2018	MXN 4.616	240	0	(6)	(6)	0,00
GLM	10/2018	TRY 3.481	560	0	(17)	(17)	(0,01)
	10/2018	\$ 859	MXN 16.207	5	0	5	0,00
	10/2018	489	TRY 3.058	14	0	14	0,01
HUS	10/2018	MXN 16.207	\$ 856	0	(8)	(8)	0,00
	11/2018	\$ 891	MXN 16.932	8	0	8	0,01
JPM	10/2018	TRY 3.058	\$ 486	0	(17)	(17)	(0,01)
SCX	10/2018	£ 223	287	0	(3)	(3)	0,00
	01/2019	\$ 229	EGP 4.280	2	0	2	0,00
UAG	10/2018	\$ 528	TRY 3.481	48	0	48	0,02
	11/2018	498	RUB 31.974	0	(12)	(12)	(0,01)
				\$ 96	\$ (82)	\$ 14	0,01

ABSICHERUNG DURCH DEISENTRAKTE

Zum 30. September 2018 hatte die (abgesicherte) thesaurierende CHF-Klasse die folgenden ausstehenden Deiseinterminkontrakte:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
BOA	10/2018	CHF 1.000	\$ 1.036	\$ 12	\$ 0	\$ 12	0,01
	10/2018	\$ 9.632	CHF 9.574	0	(30)	(30)	(0,02)
CBK	10/2018	9.689	9.569	0	(92)	(92)	(0,04)
GLM	10/2018	CHF 11.374	\$ 11.739	96	0	96	0,04
	11/2018	\$ 8.442	CHF 8.158	0	(67)	(67)	(0,03)
IND	10/2018	CHF 8.175	\$ 8.445	76	0	76	0,04
	11/2018	\$ 8.468	CHF 8.175	0	(76)	(76)	(0,04)
JPM	10/2018	9.843	9.501	0	(116)	(116)	(0,06)
				\$ 184	\$ (381)	\$ (197)	(0,10)

Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt

\$ (203) (0,10)

Anlagen insgesamt

\$ 246.886 117,04

Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

\$ (35.946) (17,04)

Nettovermögen

\$ 210.940 100,00

ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd.*):

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

(a) „When-issued“-Wertpapier.

(b) Nullkupon-Papier.

(c) Kupon stellt eine Rendite bis Fälligkeit dar.

(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(e) Zum 30. September 2018 wurden Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von insgesamt \$ 38.977 gemäß den Bedingungen der Rahmen-Rückkaufverträge und/oder globalen Rahmen-Rückkaufverträge als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von \$ 1.776 waren zum 30. September 2018 als Sicherheiten für börsengehandelte und zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente verpfändet.

(f) Pensionsgeschäfte zum 30. September 2018:

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	(Erhaltene) Sicherheiten	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäften ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
TDM	2,340 %	28.09.2018	01.10.2018	\$ 3.100	U.S. Treasury Notes 2,000 % due 30.04.2024	\$ (3.192)	\$ 3.100	\$ 3.101	1,47
Pensionsgeschäfte insgesamt						\$ (3.192)	\$ 3.100	\$ 3.101	1,47

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert⁽¹⁾

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	\$ 0	\$ 247.197	\$ 0	\$ 247.197
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	(141)	(176)	6	(311)
Gesamt	\$ (141)	\$ 247.021	\$ 6	\$ 246.886

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	\$ 0	\$ 240.314	\$ 0	\$ 240.314
Einlagen bei Kreditinstituten	0	1.397	0	1.397
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	(8)	(614)	4	(618)
Gesamt	\$ (8)	\$ 241.097	\$ 4	\$ 241.093

⁽¹⁾ Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

⁽²⁾ Weitere Informationen sind der Aufstellung des Wertpapierbestands zu entnehmen.

⁽³⁾ Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Terminkontrakte, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. September 2018:

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Leihbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	2,180 %	08.08.2018	08.11.2018	\$ (5.515)	\$ (5.533)	(2,62)
	2,300	18.09.2018	02.10.2018	(1.938)	(1.939)	(0,92)
GRE	2,240	24.09.2018	07.11.2018	(22.412)	(22.421)	(10,63)
	2,340	19.09.2018	03.10.2018	(7.500)	(7.506)	(3,56)
	2,460	26.09.2018	10.10.2018	(1.933)	(1.933)	(0,92)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt					\$ (39.332)	(18,65)

(Erhaltene)/verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2018:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC-Derivaten insgesamt	(Erhaltene)/verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (20)	\$ 0	\$ (20)
BPS	2	0	2
BRC	(4)	0	(4)
CBK	(96)	0	(96)
CKL	(1)	0	(1)
DUB	(6)	0	(6)
FBF	1	0	1
GLM	29	0	29
GST	(10)	0	(10)
HUS	(7)	0	(7)
JPM	(133)	0	(133)
MYC	1	0	1
SCX	(1)	0	(1)
UAG	42	0	42

⁽¹⁾ Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.

Vergleichsangaben

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Vergleichsangaben der Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. September 2018:

	30. Sept. 2018 (%)	31. März 2018 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	62,52	76,56
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	52,66	40,24
Sonstige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	2,01	2,26
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	(0,07)	0,00
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente	0,02	0,02
Derivative OTC-Finanzinstrumente	(0,10)	(0,32)
Einlagenzertifikate	0,00	0,69
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(18,65)	(20,35)
Sale-Buyback-Finanzierungsgeschäfte	0,00	(1,23)

* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Aufstellung des Wertpapierbestands
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE –				INDUSTRIESEKTOR							
AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN											
BANKEN UND FINANZEN											
Abe Investment Holdings, Inc. 10,500 % due 16.10.2020	\$ 1.200	\$ 1.249	0,09	24 Hour Fitness Worldwide, Inc. 8,000 % due 01.06.2022	\$ 5.850	\$ 5.850	0,43	Cablevision Systems Corp. 8,000 % due 15.04.2020	\$ 4.368	\$ 4.614	0,34
AGFC Capital Trust 4,089 % due 15.01.2067	500	260	0,02	Acadia Healthcare Co., Inc. 5,625 % due 15.02.2023	1.106	1.117	0,08	California Resources Corp. 8,000 % due 15.12.2022	5.090	4.874	0,36
Aircastle Ltd. 5,125 % due 15.03.2021	2.890	2.968	0,22	ADT Corp. 3,500 % due 15.07.2022	4.381	4.162	0,31	Calumet Specialty Products Partners LP 6,500 % due 15.04.2021	6.163	6.163	0,45
5,500 % due 15.02.2022	5.222	5.432	0,40	Alfred's 5,250 % due 15.03.2020	4.695	4.789	0,35	Carrizo Oil & Gas, Inc. 7,500 % due 15.09.2020	487	488	0,04
Ally Financial, Inc. 3,500 % due 27.01.2019	4.252	4.257	0,31	6,250 % due 15.10.2021	3.865	4.074	0,30	CCO Holdings LLC 5,250 % due 15.03.2021	3.035	3.056	0,22
3,750 % due 18.11.2019	3.207	3.203	0,24	Afren PLC 11,500 % due 01.02.2016 ^	976	3	0,00	Centene Corp. 4,750 % due 15.05.2022	6.708	6.817	0,50
4,125 % due 30.03.2020	3.920	3.944	0,29	Alberta ULC (14,000 % bar oder 14,000 % PIK) 14,000 % due 13.02.2020 ^a)	327	3	0,00	5,625 % due 15.02.2021	4.596	4.688	0,34
4,250 % due 15.04.2021	4.910	4.947	0,36	Aleris International, Inc. 10,750 % due 15.07.2023	2.860	3.039	0,22	Cequel Communications Holdings LLC 5,125 % due 15.12.2021	6.694	6.753	0,50
4,625 % due 19.05.2022	2.100	2.121	0,16	Algeco Global Finance PLC 8,000 % due 15.02.2023	2.230	2.297	0,17	CF Industries, Inc. 7,125 % due 01.05.2020	4.882	5.163	0,38
8,000 % due 15.03.2020	3.276	3.481	0,26	Allegheny Technologies, Inc. 5,950 % due 15.01.2021	2.941	3.003	0,22	Chesapeake Energy Corp. 4,875 % due 15.04.2022	6.210	6.063	0,44
Avolon Holdings Funding Ltd. 5,125 % due 01.10.2023	1.800	1.824	0,13	Altice Financing S.A. 6,625 % due 15.02.2023	3.035	3.065	0,22	5,375 % due 15.06.2021	1.009	1.009	0,07
5,500 % due 15.01.2023	461	469	0,03	Altice Luxembourg S.A. 7,750 % due 15.05.2022	10.955	10.681	0,78	6,625 % due 15.08.2020	3.760	3.948	0,29
CIT Group, Inc. 5,000 % due 15.08.2022	4.884	4.994	0,37	American Airlines Group, Inc. 5,500 % due 01.10.2019	4.465	4.549	0,33	8,000 % due 15.12.2022	950	995	0,07
5,375 % due 15.05.2020	790	814	0,06	Anixter, Inc. 5,125 % due 01.10.2021	4.956	5.068	0,37	CITGO Holding, Inc. 10,750 % due 15.02.2020	5.554	5.915	0,43
CoreCivic, Inc. 5,000 % due 15.10.2022	5.630	5.588	0,41	Antero Resources Corp. 5,125 % due 01.12.2022	1.599	1.628	0,12	Clean Harbors, Inc. 5,125 % due 01.06.2021	6.060	6.090	0,45
5,000 % due 15.01.2022	5.630	5.588	0,41	5,375 % due 01.11.2021	5.844	5.933	0,44	Clear Channel Worldwide Holdings, Inc. 6,500 % due 15.11.2022	5.947	6.081	0,45
Credit Agricole S.A. 8,375 % due 13.10.2019 (b)	408	425	0,03	APX Group, Inc. 8,750 % due 01.12.2020	3.755	3.764	0,28	7,625 % due 15.03.2020	2.759	2.776	0,20
Equinix, Inc. 5,375 % due 01.01.2022	4.919	5.091	0,37	ArcelorMittal 5,125 % due 01.06.2020	2.605	2.669	0,20	Clearwater Paper Corp. 4,500 % due 01.02.2023	1.500	1.403	0,10
Genworth Holdings, Inc. 7,200 % due 15.02.2021	854	865	0,06	5,250 % due 05.08.2020	1.240	1.277	0,09	CNX Resources Corp. 5,875 % due 15.04.2022	7.450	7.471	0,55
7,200 % due 15.02.2021	854	865	0,06	5,500 % due 01.03.2021	5.263	5.465	0,40	Cogent Communications Group, Inc. 5,375 % due 01.03.2022	3.255	3.320	0,24
Icahn Enterprises LP 6,250 % due 01.02.2022	3.177	3.264	0,24	6,250 % due 25.02.2022	6.399	6.868	0,50	Commscope, Inc. 5,000 % due 15.06.2021	3.535	3.553	0,26
International Lease Finance Corp. 6,250 % due 15.05.2019	4.476	4.564	0,33	Arconic, Inc. 5,400 % due 15.04.2021	7.543	7.788	0,57	Community Health Systems, Inc. 6,250 % due 31.03.2023	8.315	7.918	0,58
iStar, Inc. 5,000 % due 01.07.2019	1.220	1.223	0,09	5,150 % due 15.08.2020	3.960	4.123	0,30	6,875 % due 01.02.2022	4.275	2.417	0,18
5,250 % due 15.09.2022	2.485	2.454	0,18	Ardayh Packaging Finance PLC 4,250 % due 15.09.2022	6.783	6.698	0,49	11,000 % due 30.06.2023	6.118	5.534	0,41
6,000 % due 01.04.2022	2.250	2.272	0,17	Ascent Resources Utica Holdings LLC 10,000 % due 01.04.2022	4.588	5.184	0,38	Consolidated Communications, Inc. 6,500 % due 01.10.2022	2.439	2.317	0,17
Jefferies Finance LLC 7,375 % due 01.04.2020	5.485	5.602	0,41	Avis Budget Car Rental LLC 5,125 % due 01.06.2022	1.036	1.064	0,08	Continental Resources, Inc. 5,000 % due 15.09.2022	800	812	0,06
7,500 % due 15.04.2021	1.907	1.959	0,14	Avon International Operations, Inc. 7,875 % due 15.08.2022	2.565	2.658	0,19	CPG Merger Sub LLC 8,000 % due 01.10.2021	6.286	6.388	0,47
KCA Deutag UK Finance PLC 9,875 % due 01.04.2022	3.796	3.796	0,28	Avon Products, Inc. 6,600 % due 15.03.2020	4.486	4.531	0,33	4,500 % due 15.01.2023	3.515	3.538	0,26
LoanCore Capital Markets LLC 6,875 % due 01.06.2020	890	902	0,07	6,000 % due 15.03.2020	4.486	4.531	0,33	CSC Holdings LLC 6,750 % due 15.11.2021	4.180	4.415	0,32
Navient Corp. 4,875 % due 17.06.2019	6.347	6.403	0,47	7,000 % due 15.03.2023	2.313	2.128	0,16	DAE Funding LLC 4,000 % due 01.08.2020	600	595	0,04
5,000 % due 26.10.2020	5.140	5.216	0,38	Ball Corp. 4,375 % due 15.12.2020	4.729	4.806	0,35	4,500 % due 01.08.2022	100	98	0,01
5,500 % due 15.01.2019	1.980	1.992	0,15	Barmingo Finance Pty. Ltd. 6,625 % due 15.05.2022	2.125	2.114	0,16	Darling Ingredients, Inc. 5,375 % due 15.01.2022	2.050	2.073	0,15
6,500 % due 15.06.2022	2.000	2.081	0,15	Bausch Health Cos., Inc. 5,500 % due 01.03.2023	3.728	3.602	0,26	DCP Midstream Operating LP 5,350 % due 15.03.2020	3.215	3.295	0,24
6,625 % due 26.07.2021	4.460	4.661	0,34	5,875 % due 15.05.2023	3.910	3.827	0,28	Dell International LLC 5,875 % due 15.06.2021	9.004	9.296	0,68
7,250 % due 25.01.2022	3.336	3.532	0,26	6,500 % due 15.03.2022	5.510	5.744	0,42	Dell, Inc. 4,625 % due 01.04.2021	3.019	3.066	0,22
8,000 % due 25.03.2020	2.962	3.125	0,23	7,500 % due 15.07.2021	6.720	6.863	0,50	Denbury Resources, Inc. 9,000 % due 15.05.2021	4.237	4.602	0,34
Radian Group, Inc. 5,250 % due 15.06.2020	1.465	1.500	0,11	Baytex Energy Corp. 5,125 % due 01.06.2021	2.802	2.774	0,20	DISH DBS Corp. 5,125 % due 01.05.2020	4.395	4.444	0,33
7,000 % due 15.03.2021	1.435	1.541	0,11	BC Unlimited Liability Co. 4,625 % due 15.01.2022	3.593	3.606	0,26	5,875 % due 15.07.2022	8.822	8.644	0,63
Realogy Group LLC 4,500 % due 15.04.2019	1.958	1.968	0,14	BMC Software Finance, Inc. 8,125 % due 15.07.2021	9.050	9.251	0,68	6,750 % due 01.06.2021	6.851	7.044	0,52
Royal Bank of Scotland Group PLC 6,125 % due 15.12.2022	2.255	2.360	0,17	Bombardier, Inc. 6,125 % due 15.01.2023	2.485	2.508	0,18	7,875 % due 01.09.2019	3.975	4.125	0,30
7,648 % due 30.09.2031 (b)	587	737	0,05	7,750 % due 15.03.2020	5.378	5.644	0,41	DJO Finance LLC 8,125 % due 15.06.2021	7.769	7.973	0,58
SBA Communications Corp. 4,000 % due 01.10.2022	6.240	6.146	0,45	8,750 % due 01.12.2021	10.031	11.115	0,81	10,750 % due 15.04.2020	970	968	0,07
Springleaf Finance Corp. 5,625 % due 15.03.2023	3.710	3.705	0,27	Bristow Group, Inc. 6,250 % due 15.10.2022	3.922	2.883	0,21	DKT Finance ApS 9,375 % due 17.06.2023	900	951	0,07
6,125 % due 15.05.2022	5.217	5.406	0,40	Brookfield Residential Properties, Inc. 6,500 % due 15.12.2020	2.142	2.155	0,16	DriveTime Automotive Group, Inc. 8,000 % due 01.06.2021	875	903	0,07
7,750 % due 01.10.2021	436	472	0,04	Bruin E&P Partners LLC 8,875 % due 01.08.2023	1.300	1.341	0,10				
8,250 % due 15.12.2020	2.515	2.737	0,20								
Starwood Property Trust, Inc. 5,000 % due 15.12.2021	4.055	4.096	0,30								
Stearns Holdings LLC 9,375 % due 15.08.2020	3.055	3.009	0,22								
		138.655	10,16								

Aufstellung des Wertpapierbestands

PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF (Fortsetzung)

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
DynCorp International, Inc. (10,375 % bar und 1,500 % PIK)				IHO Verwaltungs GmbH (4,125 % bar oder 4,875 % PIK)				7,750 % due 15.03.2022	\$ 3.713	4.075	0,30
11,875 % due 30.11.2020 (a)	\$ 953	\$ 996	0,07	4,125 % due 15.09.2021 (a)	\$ 2.935	\$ 2.913	0,21	8,625 % due 01.02.2019	4.718	4.812	0,35
Eagle Holding Co. LLC (7,625 % bar oder 8,375 % PIK)	6.045	6.136	0,45	Imperial Metals Corp.				Momentive Performance Materials, Inc.			
7,625 % due 15.05.2022 (a)				7,000 % due 15.03.2019	1.200	1.020	0,07	3,880 % due 24.10.2021	2.345	2.536	0,19
Edgewell Personal Care Co.				Infor Software Parent LLC (7,125 % bar oder 7,875 % PIK)				Murphy Oil Corp.			
4,700 % due 19.05.2021	2.634	2.641	0,19	7,125 % due 01.05.2021 (a)	3.885	3.938	0,29	4,000 % due 01.06.2022	1.970	1.950	0,14
EMC Corp.				Infor U.S., Inc.				4,450 % due 01.12.2022	4.465	4.443	0,33
2,650 % due 01.06.2020	5.738	5.636	0,41	6,500 % due 15.05.2022	6.444	6.564	0,48	Murray Energy Corp.			
Endo Dac				Informatica LLC				11,250 % due 15.04.2021	3.151	2.269	0,17
6,000 % due 15.07.2023	1.500	1.339	0,10	7,125 % due 15.07.2023	900	926	0,07	Nabors Industries, Inc.			
Endo Finance LLC				Inmarsat Finance PLC				4,625 % due 15.09.2021	2.956	2.926	0,21
5,750 % due 15.01.2022	7.475	7.017	0,51	4,875 % due 15.05.2022	2.555	2.555	0,19	5,000 % due 15.09.2020	3.285	3.329	0,24
Energy Transfer Equity LP				Intelsat Connect Finance S.A.				National CineMedia LLC			
7,500 % due 15.10.2020	3.269	3.506	0,26	9,500 % due 15.02.2023	900	897	0,07	6,000 % due 15.04.2022	1.273	1.295	0,10
EnPro Industries, Inc.				Intelsat Jackson Holdings S.A.				Navios Maritime Acquisition Corp.			
5,875 % due 15.09.2022	1.310	1.341	0,10	7,500 % due 01.04.2021	6.272	6.382	0,47	8,125 % due 15.11.2021	1.200	997	0,07
Envision Healthcare Corp.				9,500 % due 30.09.2022	2.500	2.919	0,21	Navios Maritime Holdings, Inc.			
5,625 % due 15.07.2022	1.664	1.712	0,13	International Game Technology PLC				7,375 % due 15.01.2022	3.462	2.744	0,20
Ferrelgas LP				6,250 % due 15.02.2022	4.105	4.269	0,31	NCL Corp. Ltd.			
6,500 % due 01.05.2021	1.465	1.319	0,10	INVISTA Finance LLC				4,750 % due 15.12.2021	1.356	1.368	0,10
6,750 % due 15.01.2022	3.019	2.649	0,19	4,250 % due 15.10.2019	2.730	2.740	0,20	NCR Corp.			
Fiat Chrysler Automobiles NV				IQVIA, Inc.				5,000 % due 15.07.2022	2.905	2.896	0,21
4,500 % due 15.04.2020	8.182	8.254	0,61	4,875 % due 15.05.2023	3.205	3.237	0,24	5,875 % due 15.12.2021	900	912	0,07
5,250 % due 15.04.2023	1.700	1.738	0,13	Jack Ohio Finance LLC				Neiman Marcus Group Ltd. LLC			
FMG Resources Pty. Ltd.				6,750 % due 15.11.2021	2.420	2.511	0,18	8,000 % due 15.10.2021	3.474	2.299	0,17
4,750 % due 15.05.2022	5.122	5.090	0,37	Jaguar Land Rover Automotive PLC				Netfilix, Inc.			
Freight-McMurray, Inc.				3,500 % due 15.03.2020	1.991	1.974	0,14	5,500 % due 15.02.2022	6.293	6.521	0,48
3,100 % due 15.03.2020	6.666	6.608	0,48	4,125 % due 15.12.2018	4.144	4.152	0,30	Newfield Exploration Co.			
3,550 % due 01.03.2022	8.025	7.784	0,57	JC Penney Corp., Inc.				5,750 % due 30.01.2022	4.025	4.231	0,31
3,875 % due 15.03.2023	1.700	1.648	0,12	5,650 % due 01.06.2020	12	11	0,00	Nielsen Finance LLC			
4,000 % due 14.11.2021	2.745	2.735	0,20	Jurassic Holdings, Inc.				5,000 % due 15.04.2022	7.080	6.921	0,51
GameStop Corp.				6,875 % due 15.02.2021	2.018	1.978	0,15	Nokia Oyj			
6,750 % due 15.03.2021	1.839	1.888	0,14	KB Home				3,375 % due 12.06.2022	4.245	4.175	0,31
Gates Global LLC				4,750 % due 15.05.2019	3.227	3.255	0,24	5,375 % due 15.05.2019	2.992	3.045	0,22
6,000 % due 15.07.2022	3.315	3.344	0,25	7,000 % due 15.12.2021	1.600	1.692	0,12	Northwest Acquisitions ULC			
GFL Environmental, Inc.				7,500 % due 15.09.2022	2.608	2.826	0,21	7,125 % due 01.11.2022	1.400	1.435	0,11
5,625 % due 01.05.2022	4.500	4.376	0,32	8,000 % due 15.03.2020	3.045	3.228	0,24	Nuance Communications, Inc.			
Global Partners LP				KGA Escrow LLC				5,375 % due 15.08.2020	1.101	1.105	0,08
6,250 % due 15.07.2022	3.264	3.264	0,24	7,500 % due 15.08.2023	1.300	1.352	0,10	NuStar Logistics LP			
Global Ship Lease, Inc.				Kinetic Concepts, Inc.				4,800 % due 01.09.2020	2.710	2.740	0,20
9,875 % due 15.11.2022	900	898	0,07	7,875 % due 15.02.2021	1.500	1.551	0,11	NXP BV			
GLP Capital LP				12,500 % due 01.11.2021	2.455	2.714	0,20	3,875 % due 01.09.2022	2.909	2.887	0,21
4,375 % due 15.04.2021	280	283	0,02	Kinross Gold Corp.				4,125 % due 15.06.2020	2.400	2.421	0,18
4,875 % due 01.11.2020	8.051	8.223	0,60	5,125 % due 01.09.2021	2.723	2.811	0,21	4,125 % due 01.06.2021	8.930	8.943	0,66
goeasy Ltd.				KLX, Inc.				Oasis Petroleum, Inc.			
7,875 % due 01.11.2022	2.145	2.239	0,16	5,875 % due 01.12.2022	1.829	1.894	0,14	6,875 % due 15.03.2022	2.310	2.353	0,17
Gogo Intermediate Holdings LLC				L Brands, Inc.				Open Text Corp.			
12,500 % due 01.07.2022	1.326	1.457	0,11	5,625 % due 15.02.2022	2.913	2.958	0,22	5,625 % due 15.01.2023	2.255	2.300	0,17
Griffon Corp.				6,625 % due 01.04.2021	8.970	9.500	0,70	Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.			
5,250 % due 01.03.2022	3.865	3.836	0,28	Lennar Corp.				6,625 % due 15.05.2022	8.239	8.091	0,59
Harland Clarke Holdings Corp.				4,125 % due 15.01.2022	3.345	3.324	0,24	Owens-Brockway Glass Container, Inc.			
8,375 % due 15.08.2022	1.911	1.842	0,14	4,500 % due 15.11.2019	3.690	3.727	0,27	5,000 % due 15.01.2022	1.309	1.320	0,10
HCA Healthcare, Inc.				4,750 % due 01.04.2021	4.561	4.631	0,34	Park Aerospace Holdings Ltd.			
6,250 % due 15.02.2021	5.990	6.260	0,46	4,750 % due 15.11.2022	1.000	1.007	0,07	3,625 % due 15.03.2021	1.355	1.324	0,10
HCA, Inc.				6,250 % due 15.12.2021	1.200	1.260	0,09	4,500 % due 15.03.2023	5.899	5.774	0,42
4,250 % due 15.10.2019	905	914	0,07	6,625 % due 01.05.2020	1.631	1.703	0,12	5,250 % due 15.08.2022	1.702	1.723	0,13
5,875 % due 15.03.2022	3.578	3.802	0,28	Level 3 Financing, Inc.				5,500 % due 15.02.2024	100	103	0,01
6,500 % due 15.02.2020	10.926	11.396	0,84	6,125 % due 15.01.2021	966	974	0,07	Parker Drilling Co.			
7,500 % due 15.02.2022	4.795	5.263	0,39	LifePoint Health, Inc.				6,750 % due 15.07.2022	3.117	2.455	0,18
Herc Rentals, Inc.				5,500 % due 01.12.2021	5.637	5.744	0,42	Perstorp Holding AB			
7,500 % due 01.06.2022	2.391	2.540	0,19	Lightstream Resources Ltd.				11,000 % due 30.09.2021	2.048	2.232	0,16
Hertz Corp.				8,625 % due 01.02.2020 ^	1.425	267	0,02	PHI, Inc.			
5,875 % due 15.10.2020	3.097	3.097	0,23	LKQ Corp.				5,250 % due 15.03.2019	3.855	3.691	0,27
7,625 % due 01.06.2022	4.557	4.511	0,33	4,750 % due 15.05.2023	1.000	1.003	0,07	Platform Specialty Products Corp.			
Hexion, Inc.				4,875 % due 15.04.2020	2.088	2.078	0,15	6,500 % due 01.02.2022	3.423	3.496	0,26
6,625 % due 15.04.2020	5.856	5.519	0,40	5,750 % due 01.08.2022	5.580	5.175	0,38	PolyOne Corp.			
Hillman Group, Inc.				Masonite International Corp.				5,250 % due 15.03.2023	2.100	2.184	0,16
6,375 % due 15.07.2022	1.180	1.068	0,08	5,625 % due 15.03.2023	960	984	0,07	Precision Drilling Corp.			
Hughes Satellite Systems Corp.				MEG Energy Corp.				6,500 % due 15.12.2021	676	689	0,05
7,625 % due 15.06.2021	3.099	3.356	0,25	6,375 % due 30.01.2023	2.431	2.224	0,16	7,750 % due 15.12.2023	813	867	0,06
Huntsman International LLC				Men's Wearhouse, Inc.				QEP Resources, Inc.			
4,875 % due 15.11.2020	7.077	7.219	0,53	7,000 % due 01.07.2022	765	790	0,06	5,375 % due 01.10.2022	4.062	4.092	0,30
iHeartCommunications, Inc.				MGM Resorts International				Radiate Holdco LLC			
9,000 % due 15.12.2019 ^	6.555	4.965	0,36	5,250 % due 31.03.2020	2.194	2.238	0,16	6,875 % due 15.02.2023	1.760	1.703	0,12
9,000 % due 01.03.2021 ^	11.275	8.456	0,62	6,625 % due 15.12.2021	3.875	4.117	0,30	Range Resources Corp.			
11,250 % due 01.03.2021 ^	2.200	1.595	0,12	6,750 % due 01.10.2020	4.343	4.576	0,34	5,000 % due 15.08.2022	6.895	6.852	0,50

Aufstellung des Wertpapierbestands

PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF (Fortsetzung)

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Resolute Energy Corp. 8,500 % due 01.05.2020	\$ 1.320	\$ 1.323	0,10	TransDigm, Inc. 5,500 % due 15.10.2020	\$ 3.181	\$ 3.189	0,23	NRG Energy, Inc. 6,250 % due 15.07.2022	\$ 1.653	\$ 1.710	0,13
Revlon Consumer Products Corp. 5,750 % due 15.02.2021	3.485	2.814	0,21	6,000 % due 15.07.2022	5.511	5.614	0,41	SemGroup Corp. 5,625 % due 15.07.2022	3.340	3.332	0,24
Reynolds Group Issuer, Inc. 5,750 % due 15.10.2020	5.566	5.586	0,41	Transocean, Inc. 5,800 % due 15.10.2022	3.067	3.063	0,22	Sprint Capital Corp. 6,900 % due 01.05.2019	2.075	2.114	0,15
Riverbed Technology, Inc. 8,875 % due 01.03.2023	1.890	1.788	0,13	TRI Pointe Group, Inc. 4,875 % due 01.07.2021	747	749	0,06	Sprint Communications, Inc. 6,000 % due 15.11.2022	5.825	5.956	0,44
Rivers Pittsburgh Borrower LP 6,125 % due 15.08.2021	1.894	1.894	0,14	Triumph Group, Inc. 4,875 % due 01.04.2021	4.781	4.638	0,34	7,000 % due 01.03.2020	3.738	3.887	0,28
Rockies Express Pipeline LLC 5,625 % due 15.04.2020	5.646	5.829	0,43	TRU Taj LLC 12,000 % due 15.08.2021	3.284	2.151	0,16	7,000 % due 15.08.2020	5.425	5.683	0,42
6,000 % due 15.01.2019	3.085	3.112	0,23	Ultra Resources, Inc. 6,875 % due 15.04.2022	2.599	1.248	0,09	Sprint Corp. 7,250 % due 15.09.2021	8.410	8.915	0,65
Rowan Cos., Inc. 4,875 % due 01.06.2022	2.215	2.137	0,16	Unisys Corp. 10,750 % due 15.04.2022	2.760	3.115	0,23	Talen Energy Supply LLC 4,600 % due 15.12.2021	2.953	2.540	0,19
7,875 % due 01.08.2019	2.300	2.380	0,17	Unit Corp. 6,625 % due 15.05.2021	2.568	2.581	0,19	9,500 % due 15.07.2022	1.836	1.845	0,13
RR Donnelley & Sons Co. 7,875 % due 15.03.2021	3.080	3.284	0,24	United Continental Holdings, Inc. 4,250 % due 01.10.2022	1.930	1.913	0,14	Targa Resources Partners LP 4,125 % due 15.11.2019	2.429	2.432	0,18
Sable Permian Resources Land LLC 7,125 % due 01.11.2020	3.840	2.630	0,19	Urban One, Inc. 9,250 % due 15.02.2020	635	630	0,05	Texas Competitive Electric Holdings Company LLC 10,250 % due 01.11.2015 ^	2.000	7	0,00
13,000 % due 30.11.2020	2.498	2.735	0,20	VeriSign, Inc. 4,625 % due 01.05.2023	4.679	4.771	0,35			85.229	6,24
Sabre Global, Inc. 5,375 % due 15.04.2023	4.300	4.348	0,32	Vertiv Intermediate Holding Corp. (12,000 % bar oder 13,000 % PIK) 12,000 % due 15.02.2022 (a)	1.501	1.540	0,11	Unternehmensanleihen u. Schuldverschreibungen insgesamt		1.237.895	90,72
Sanchez Energy Corp. 7,250 % due 15.02.2023	2.040	2.017	0,15	Videotron Ltd. 5,000 % due 15.07.2022	2.070	2.135	0,16	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
7,750 % due 15.06.2021	7.105	5.009	0,37	Virgin Australia Holdings Ltd. 7,875 % due 15.10.2021	1.101	1.093	0,08	PENSIONSGESCHÄFTE (c)			
Sannina Corp. 4,375 % due 01.06.2019	1.630	1.638	0,12	Virgin Media Secured Finance PLC 5,250 % due 15.01.2021	2.846	2.931	0,22	Kurzfristige Instrumente insgesamt		110.917	8,13
Scientific Games International, Inc. 10,000 % due 01.12.2022	5.627	5.979	0,44	Watco Cos. LLC 6,375 % due 01.04.2023	2.011	2.059	0,15	Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
Sears Holdings Corp. 8,000 % due 15.12.2019	3.200	720	0,05	Weatherford International Ltd. 4,500 % due 15.04.2022	4.070	3.582	0,26	insgesamt – amtliche Börsegeregelter Markt	\$ 1.348.812	98,85	
Select Medical Corp. 6,375 % due 01.06.2021	2.180	2.213	0,16	7,750 % due 15.06.2021	4.347	4.342	0,32				
SESI LLC 7,125 % due 15.12.2021	2.143	2.178	0,16	WEX, Inc. 4,750 % due 01.02.2023	2.000	2.003	0,15				
Sinclair Television Group, Inc. 5,375 % due 01.04.2021	1.484	1.488	0,11	Whiting Petroleum Corp. 5,750 % due 15.03.2021	4.538	4.668	0,34				
6,125 % due 01.10.2022	1.796	1.836	0,13	WPX Energy, Inc. 6,000 % due 15.01.2022	3.477	3.620	0,27				
Sirius XM Radio, Inc. 3,875 % due 01.08.2022	6.865	6.787	0,50	WR Grace & Co-Conn 5,125 % due 01.10.2021	3.922	4.030	0,30				
Sotera Health Topco, Inc. (8,125 % bar oder 8,875 % PIK) 8,125 % due 01.11.2021 (a)	5.640	5.710	0,42	XPO Logistics, Inc. 6,500 % due 15.06.2022	2.810	2.912	0,21				
Southwestern Energy Co. 4,100 % due 15.03.2022	5.717	5.724	0,42	Yum! Brands, Inc. 3,875 % due 01.11.2020	3.045	3.041	0,22				
Spectrum Brands Holdings, Inc. 7,750 % due 15.01.2022	3.587	3.702	0,27	ZF North America Capital, Inc. 4,000 % due 29.04.2020	3.051	3.064	0,22				
Standard Industries, Inc. 5,500 % due 15.02.2023	1.480	1.500	0,11			1.014.011	74,32				
SUPERVALU, Inc. 7,750 % due 15.11.2022	1.200	1.253	0,09	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN							
Syniverse Holdings, Inc. 9,125 % due 15.01.2019	474	470	0,03	AES Corp. 4,000 % due 15.03.2021	2.218	2.218	0,16				
T-Mobile USA, Inc. 4,000 % due 15.04.2022	5.586	5.576	0,41	American Midstream Partners LP 9,500 % due 15.12.2021	2.230	2.241	0,16				
Taylor Morrison Communities, Inc. 5,250 % due 15.04.2021	2.415	2.433	0,18	CenturyLink, Inc. 5,625 % due 01.04.2020	3.738	3.817	0,28				
Teekay Corp. 8,500 % due 15.01.2020	1.589	1.625	0,12	5,800 % due 15.03.2022	13.671	13.979	1,02				
TEGNA, Inc. 5,125 % due 15.10.2019	1.418	1.421	0,10	6,450 % due 15.06.2021	4.791	4.989	0,37				
Teine Energy Ltd. 6,875 % due 30.09.2022	3.064	3.102	0,23	Covanta Holding Corp. 6,375 % due 01.10.2022	1.312	1.341	0,10				
Tenet Healthcare Corp. 4,375 % due 01.10.2021	4.504	4.507	0,33	Frontier Communications Corp. 10,500 % due 15.09.2022	1.350	1.208	0,09				
4,500 % due 01.04.2021	1.290	1.290	0,09	Genesis Energy LP 6,750 % due 01.08.2022	5.181	5.311	0,39				
4,750 % due 01.06.2020	3.732	3.793	0,28	Great Western Petroleum LLC 9,000 % due 30.09.2021	3.265	3.232	0,24				
5,500 % due 01.03.2019	8.040	8.120	0,60	NGL Energy Partners LP 6,875 % due 15.10.2021	2.425	2.470	0,18				
6,000 % due 01.10.2020	2.455	2.542	0,19	NGPL PipeCo LLC 4,375 % due 15.08.2022	5.928	6.002	0,44				
7,500 % due 01.01.2022	600	629	0,05								
8,125 % due 01.04.2022	8.965	9.481	0,70								
Toil Brothers Finance Corp. 5,875 % due 15.02.2022	3.752	3.944	0,29								
TPC Group, Inc. 8,750 % due 15.12.2020	2.895	2.902	0,21								

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Typ	Verfallsmonat	# der Kontrakte	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 5-Year Note December Futures	Long	12/2018	276	\$ (268)	(0,02)
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente insgesamt				\$ (268)	(0,02)

ZENTRAL ABGEWICKELTE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - ALS SICHERUNGSGEBER⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
CDX.HY-30 5-Year Index	5,000 %	20.06.2023	\$ 105.300	\$ 1.383	0,10
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente insgesamt				\$ 1.383	0,10

⁽¹⁾ Agiert der Fonds als Sicherungsgeber und es kommt zu einem Ausfall wie in den Bedingungen der betreffenden Swap-Vereinbarung definiert, zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen dem Nominalbetrag des Swaps entsprechenden Betrag und erhält die Referenzschuldverschreibung oder Basiswerte des Referenzindex geliefert oder (ii) den Betrag des Nettoausgleichs in Form von liquiden Mitteln, Wertpapieren oder sonstigen lieferbaren Schuldverschreibungen im Gegenwert des Nominalbetrags des Swaps abzüglich der Erlösquote der Referenzschuldverschreibung oder Basiswerte des Referenzindex.

⁽²⁾ Der Maximalbetrag, der vom Fonds bei einem Kreditereignis nach Maßgabe der betreffenden Swap-Vereinbarung als Sicherungsgeber potenziell gefordert oder als Sicherungsnehmer potenziell vereinnahmt werden kann.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

Kontrahent	Zu zahlender/ zu erhaltender	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	variabler Zinssatz	Nominalbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Prämien	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	Beizulegender Zeitwert	% des Nettovermögens
BNP	Zu erhalten	iBoxx USD Liquid High Yield Index	-	3-Month USD-LIBOR	\$ 24.000	20.03.2019	\$ (91)	\$ 365	\$ 274	0,02
GST	Zu erhalten	iBoxx USD Liquid High Yield Index	-	3-Month USD-LIBOR	11.000	20.03.2019	(45)	130	85	0,01
JPM	Zu erhalten	iBoxx USD Liquid High Yield Index	-	3-Month USD-LIBOR	33.500	20.03.2019	(126)	552	426	0,03
							\$ (262)	\$ 1.047	\$ 785	0,06

ABSICHERUNG DURCH DEVISETERMINKONTRAKTE

Zum 30. September 2018 hatte die (abgesicherte) thesaurierende CHF-Klasse die folgenden ausstehenden Devisenterminkontrakte:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
BOA	10/2018	\$ 13.259	CHF 12.912	\$ 0	\$ (40)	\$ (40)	(0,01)
CBK	10/2018	\$ 13.340	CHF 12.909	0	(124)	(124)	(0,01)
GLM	10/2018	CHF 13.752	\$ 14.190	112	0	112	0,01
	10/2018	\$ 111	CHF 107	0	(1)	(1)	0,00
	11/2018	\$ 14.229	CHF 13.752	0	(112)	(112)	(0,01)
IND	10/2018	CHF 13.781	\$ 14.237	129	0	129	0,01
	11/2018	\$ 14.276	CHF 13.781	0	(129)	(129)	(0,01)
JPM	10/2018	\$ 13.162	CHF 12.705	0	(156)	(156)	(0,01)
RBC	10/2018	CHF 108	\$ 113	2	0	2	0,00
	10/2018	\$ 2.628	CHF 2.533	0	(35)	(35)	0,00
				\$ 243	\$ (597)	\$ (354)	(0,03)

Zum 30. September 2018 hatten die (abgesicherte) thesaurierende EUR-Klasse und die (abgesicherte) ausschüttende EUR-Klasse die folgenden ausstehenden Devisenterminkontrakte:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
AZD	10/2018	\$ 1.377	€ 1.177	\$ 0	\$ (10)	\$ (10)	0,00
BRC	10/2018	\$ 1.581	€ 1.361	1	0	1	0,00
CBK	10/2018	277.008	237.024	10	(1.715)	(1.705)	(0,12)
GLM	10/2018	\$ 4.789	€ 4.130	7	0	7	0,00
MYI	10/2018	€ 233.264	\$ 273.362	2.426	0	2.426	0,18
	10/2018	\$ 479	€ 407	0	(7)	(7)	0,00
	11/2018	\$ 274.025	€ 233.264	0	(2.434)	(2.434)	(0,18)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermogens
RBC	10/2018	\$ 3.592	€ 3.080	\$ 0	\$ (15)	\$ (15)	0,00
RYL	10/2018	1.266	1.087	0	(3)	(3)	0,00
SCX	10/2018	265.575	226.324	0	(2.700)	(2.700)	(0,20)
SSB	10/2018	259.525	221.604	0	(2.132)	(2.132)	(0,16)
TOR	10/2018	€ 232.197	\$ 273.389	3.692	0	3.692	0,27
	11/2018	\$ 274.048	€ 232.197	0	(3.699)	(3.699)	(0,27)
				\$ 6.136	\$ (12.715)	\$ (6.579)	(0,48)

Zum 30. September 2018 hatte die (abgesicherte) ausschüttende GBP-Klasse die folgenden ausstehenden Devisenterminkontrakte:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter (Wertverlust)	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermogens
GLM	10/2018	£ 11.598	\$ 15.212	\$ 88	\$ 0	\$ 88	0,01
	10/2018	\$ 14.700	£ 11.285	16	0	16	0,00
	11/2018	15.233	11.598	0	(87)	(87)	(0,01)
JPM	10/2018	£ 11.530	\$ 15.190	154	0	154	0,01
	11/2018	\$ 15.210	£ 11.530	0	(154)	(154)	(0,01)
RBC	10/2018	14.934	11.481	37	0	37	0,01
SCX	10/2018	14.944	11.481	27	0	27	0,00
SSB	10/2018	476	368	3	0	3	0,00
				\$ 325	\$ (241)	\$ 84	0,01

Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt

\$ (6.064) (0,44)

Anlagen insgesamt

\$ 1.343.863 98,49

Sonstige kurzfristige Vermogenswerte und Verbindlichkeiten

\$ 20.584 1,51

Nettovermogen

\$ 1.364.447 100,00

ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Betrage in Tsd.*):

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsachlichen Betrage auf weniger als 1.000 zuruckzufuhren sein.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Unbegrenzte Laufzeit; sofern ein Datum angegeben ist, stellt dies den nachsten vertraglichen Abruffertermin dar.

Barmittel in Hohe von \$ 4.940 waren zum 30. September 2018 als Sicherheiten fur borsengehandelte und zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente verpfandet.

Zum 30. September 2018 wurden Barmittel in Hohe von \$ 2.630 als Sicherheiten fur derivative Finanzinstrumente verpfandet, die von Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. geregelt werden.

(c) Pensionsgeschafte zum 30. September 2018:

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungsdatum	Falligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	(Erhaltene) Sicherheiten	Pensionsgeschafte, zum Wert	Zu erhaltende Erlose aus Pensionsgeschaften ⁽¹⁾	% des Nettovermogens
BPS	2,330 %	28.09.2018	01.10.2018	\$ 57.000	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % due 15.01.2026	\$ (58.113)	\$ 57.000	\$ 57.011	4,18
JPS	2,340	28.09.2018	01.10.2018	50.000	U.S. Treasury Notes 1,875 % due 28.02.2022	(51.132)	50.000	50.010	3,66
SSB	1,100	28.09.2018	01.10.2018	3.917	U.S. Treasury Notes 2,000 % due 31.08.2021	(3.999)	3.917	3.917	0,29
						\$ (113.244)	\$ 110.917	\$ 110.938	8,13

Pensionsgeschafte insgesamt

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert⁽¹⁾

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gema den zum 30. September 2018 fur die Bewertung der Vermogenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Markten notierte Preise fur identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.348.805	\$ 7	\$ 1.348.812
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	(268)	(4.681)	0	(4.949)
Gesamt	\$ (268)	\$ 1.344.124	\$ 7	\$ 1.343.863

Aufstellung des Wertpapierbestands

PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF (Fortsetzung)

30. September 2018

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.191.340	\$ 0	\$.191.340
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	59	(2.198)	0	(2.139)
Gesamt	\$ 59	\$ 1.189.142	\$ 0	\$.189.201

⁽¹⁾ Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

⁽²⁾ Weitere Informationen sind der Aufstellung des Wertpapierbestands zu entnehmen.

⁽³⁾ Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Terminkontrakte, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2018:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC-Derivaten insgesamt	(Erhaltene)/verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement ⁽¹⁾
ÄZD	\$ (10)	\$ 0	\$ (10)
BNP	274	0	274
BOA	(40)	0	(40)
BRC	1	0	1
CBK	(1.829)	320	(1.509)
GLM	23	(100)	(77)
GST	85	0	85
JPM	270	(290)	(20)
MYI	(15)	0	(15)
RBC	(11)	(50)	(61)
RYL	(3)	0	(3)
SCX	(2.673)	1.160	(1.513)
SSB	(2.129)	1.150	(979)
TOR	(7)	0	(7)

⁽¹⁾ Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.

Vergleichsangaben

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Vergleichsangaben der Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. September 2018:

	30. Sept. 2018 (%)	31. März 2018 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	57,96	57,45
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	32,76	34,72
Sonstige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	8,13	10,43
An einem geregelten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente	(0,02)	0,01
Zentral abgewickelte derivative Finanzinstrumente	0,10	(0,06)
Derivative OTC-Finanzinstrumente	(0,44)	(0,13)

* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Aufstellung des Wertpapierbestands
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE – AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT								INDUSTRIESEKTOR			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN											
BANKEN UND FINANZEN											
ABN AMRO Bank NV 4,875 % due 16.01.2019	£ 500	£ 505	0,18	Intesa Sanpaolo SpA 0,731 % due 15.06.2020	€ 1.000	£ 892	0,31	Amgen, Inc. 2,910 % due 22.05.2019	\$ 800	£ 616	0,22
American Express Credit Corp. 2,804 % due 15.08.2019	\$ 1.450	1.116	0,39	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,625 % due 05.06.2020	£ 1.000	1.010	0,36	Anheuser-Busch InBev S.A. 0,000 % due 19.10.2018	€ 1.000	891	0,32
Aroundtown S.A. 1,500 % due 03.05.2022	€ 1.000	913	0,32	Landwirtschaftliche Rentenbank 1,500 % due 23.12.2019	1.000	1.006	0,35	BAT International Finance PLC 6,375 % due 12.12.2019	£ 1.400	1.480	0,52
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 1,309 % due 11.02.2019	£ 500	501	0,18	Lansforsakringar Hypotek AB 2,250 % due 21.09.2022	SEK 57.100	5.239	1,85	Davide Campari-Milano SpA 2,750 % due 30.09.2020	€ 800	747	0,26
Bank of America Corp. 1,141 % due 06.05.2019	€ 1.100	986	0,35	Lloyds Bank PLC 0,880 % due 10.01.2021	£ 1.700	1.699	0,60	EE Finance PLC 4,375 % due 28.03.2019	£ 300	304	0,11
Bank of Nova Scotia 1,875 % due 26.04.2021	1.200	890	0,31	Lloyds Banking Group PLC 0,750 % due 09.11.2021	€ 1.500	1.353	0,48	Glencore Finance Europe Ltd. 6,000 % due 03.04.2022	200	223	0,08
Bank of Scotland PLC 6,375 % due 16.08.2019	£ 2.100	2.187	0,77	Macquarie Bank Ltd. 3,459 % due 29.07.2020	\$ 1.700	1.323	0,47	Imperial Brands Finance PLC 9,000 % due 17.02.2022	1.000	1.223	0,43
Barclays Bank PLC 10,000 % due 21.05.2021	1.900	2.248	0,79	Merlin Properties Socimi S.A. 2,375 % due 23.05.2022	€ 1.000	937	0,33	Kinder Morgan, Inc. 1,500 % due 16.03.2022	€ 200	184	0,07
Barclays Bank UK PLC 1,036 % due 22.05.2020	1.800	1.802	0,64	MetLife, Inc. 5,250 % due 29.06.2020	£ 900	957	0,34	Marks & Spencer PLC 6,125 % due 02.12.2019	£ 3.112	3.272	1,15
Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL 1,400 % due 06.07.2022	€ 1.000	896	0,32	Morgan Stanley 1,000 % due 02.12.2022	€ 1.500	1.354	0,48	6,125 % due 06.12.2021	150	168	0,06
BNG Bank NV 1,375 % due 09.12.2019	£ 2.000	2.009	0,71	National Westminster Bank PLC 1,062 % due 15.05.2020	£ 400	401	0,14	Network Rail Infrastructure Finance PLC 4,625 % due 21.07.2020	1.350	1.437	0,51
Canadian Imperial Bank of Commerce 1,321 % due 11.03.2019	1.000	1.002	0,35	Nationwide Building Society 0,181 % due 02.11.2018	€ 1.000	891	0,31	RELX Investments PLC 2,750 % due 01.08.2019	400	403	0,14
Citigroup, Inc. 6,250 % due 02.09.2019	2.600	2.717	0,96	Nederlandsche Waterschapsbank NV 1,000 % due 09.12.2019	£ 1.000	1.000	0,35	Sky PLC 0,432 % due 01.04.2020	€ 1.800	1.616	0,57
Citycon Treasury BV 2,375 % due 16.09.2022	€ 300	279	0,10	Nordea Eiendomskreditt A/S 1,130 % due 18.06.2023	3.200	3.206	1,13	2,875 % due 24.11.2020	£ 1.000	1.028	0,36
Council of Europe Development Bank 1,250 % due 23.12.2019	£ 1.100	1.103	0,39	Nordea Hypotek AB 1,173 % due 14.01.2019	1.000	1.001	0,35	Southern Gas Networks PLC 5,125 % due 02.11.2018	2.235	2.242	0,79
Credit Agricole S.A. 3,139 % due 15.04.2019	\$ 1.200	924	0,33	Nytkredit Realcredit A/S 0,875 % due 13.06.2019	€ 100	90	0,03	TDF Infrastructure S.A.S. 2,875 % due 19.10.2022	€ 1.700	1.626	0,57
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 1,250 % due 14.04.2022	€ 1.800	1.631	0,57	Oesterreichische Kontrollbank AG 2,000 % due 17.12.2018	£ 4.000	4.009	1,41	Telefonica Emisiones S.A.U. 5,597 % due 12.03.2020	£ 3.500	3.697	1,30
Deutsche Bank AG 1,750 % due 16.12.2021	£ 1.500	1.468	0,52	Royal Bank of Canada 1,032 % due 08.12.2022	2.200	2.198	0,77	1,100 % due 01.07.2019	1.000	1.001	0,35
Deutsche Hypothekenbank AG 1,072 % due 22.03.2021	1.300	1.300	0,46	1,072 % due 08.06.2021	3.100	3.104	1,09	Vilmorin & Cie S.A. 2,375 % due 26.05.2021	€ 100	93	0,03
Deutsche Pfandbriefbank AG 1,287 % due 13.01.2020	5.000	5.019	1,77	2,200 % due 23.09.2019	\$ 3.100	2.362	0,83	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
1,875 % due 20.12.2019	1.100	1.108	0,39	Santander UK PLC 0,306 % due 22.05.2019	€ 1.500	1.341	0,47	British Telecommunications PLC 8,625 % due 26.03.2020	£ 1.000	1.104	0,39
2,250 % due 04.05.2020	\$ 6.000	4.530	1,60	0,957 % due 13.04.2021	£ 2.900	2.900	1,02	E.ON International Finance BV 6,000 % due 30.10.2019	2.300	2.414	0,85
Dexia Credit Local S.A. 0,945 % due 04.04.2019	£ 5.000	5.002	1,76	1,035 % due 16.11.2022	1.200	1.199	0,42	Enel SpA 6,250 % due 20.06.2019	1.100	1.137	0,40
2,000 % due 17.06.2020	1.000	1.012	0,36	1,080 % due 05.05.2020	700	701	0,25	innogy Finance BV 5,500 % due 06.07.2022	150	170	0,06
European Investment Bank 0,625 % due 17.01.2020	1.000	996	0,35	1,132 % due 20.09.2021	2.000	2.002	0,71	Koninklijke KPN NV 6,000 % due 29.05.2019	1.300	1.339	0,47
2,250 % due 07.03.2020	1.000	1.018	0,36	1,875 % due 17.02.2020	1.900	1.908	0,67	National Grid Gas PLC 6,375 % due 03.03.2020	250	268	0,10
5,375 % due 07.03.2019	4.000	4.076	1,44	Skandinaviska Enskilda Banken AB 1,500 % due 15.12.2021	SEK 54.000	4.832	1,70	Orange S.A. 7,250 % due 10.11.2020	1.000	1.118	0,39
Fastighets AB Balder 1,125 % due 14.03.2022	€ 1.000	897	0,32	Stadshypotek AB 1,500 % due 15.12.2021	34.000	3.042	1,07	SSE PLC 5,000 % due 01.10.2018	2.700	2.700	0,95
FMS Wertmanagement 1,125 % due 13.12.2019	£ 1.000	1.002	0,35	2,500 % due 18.09.2019	7.000	621	0,22	Vodafone Group PLC 8,125 % due 26.11.2018	1.800	1.819	0,64
1,250 % due 08.03.2019	1.000	1.001	0,35	4,500 % due 21.09.2022	35.000	3.485	1,23	NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES			
Ford Motor Credit Co. LLC 3,271 % due 04.11.2019	\$ 1.500	1.153	0,41	Svensk Exportkredit AB 0,625 % due 07.12.2020	£ 1.000	989	0,35	BAMS CMBS DAC 1,792 % due 17.05.2028	1.400	1.401	0,49
Friends Life Holdings PLC 8,250 % due 21.04.2022	£ 1.200	1.431	0,50	1,875 % due 21.12.2018	5.000	5.011	1,77	Brass PLC 1,432 % due 16.10.2059	1.700	1.702	0,60
GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % due 04.11.2020	1.000	1.086	0,38	Sveriges Sakerstald Obligationer AB 1,250 % due 15.06.2022	SEK 39.000	3.462	1,22	Dukinfield PLC 1,802 % due 15.08.2045	1.324	1.328	0,47
General Motors Financial Co., Inc. 3,899 % due 15.01.2020	\$ 1.300	1.010	0,36	Swedbank Hypotek AB 1,000 % due 15.09.2021	18.700	1.651	0,58	Eurosail PLC 1,750 % due 13.06.2045	1.380	1.376	0,48
Goldman Sachs Group, Inc. 0,381 % due 29.05.2020	€ 800	718	0,25	1,174 % due 29.10.2018	£ 1.000	1.001	0,35	Finsbury Square PLC 1,451 % due 12.09.2065	875	873	0,31
3,507 % due 23.04.2020	\$ 1.000	777	0,27	Toronto-Dominion Bank 1,282 % due 01.02.2019	1.200	1.203	0,42	1,481 % due 12.09.2065	738	738	0,26
HSBC Holdings PLC 4,567 % due 08.03.2021	1.600	1.280	0,45	2,250 % due 15.03.2021	\$ 1.200	899	0,32	1,501 % due 12.03.2059	2.381	2.382	0,84
				TSB Bank PLC 1,042 % due 07.12.2022	£ 800	800	0,28				
				UBS AG 1,250 % due 10.12.2020	1.200	1.192	0,42				
				2,959 % due 14.08.2019	\$ 1.600	1.233	0,43				
				UBS Group Funding Switzerland AG 1,750 % due 16.11.2022	€ 700	650	0,23				
				Virgin Money PLC 2,250 % due 21.04.2020	£ 1.200	1.206	0,42				
				Volkswagen Financial Services NV 1,500 % due 12.04.2021	1.000	991	0,35				
				2,625 % due 22.07.2019	600	605	0,21				
						143.826	50,68				

Aufstellung des Wertpapierbestands
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (Fortsetzung)

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Gosforth Funding PLC	£ 2.100	£ 2.102	0,74	Jubilee CLO BV	£ 1.000	£ 889	0,31
1,327 % due 25.08.2060	327	328	0,12	0,481 % due 15.12.2029	700	622	0,22
1,402 % due 15.02.2058	234	235	0,08	0,519 % due 12.07.2028			
1,582 % due 24.07.2058				Orwell Park CLO Designated Activity Co.	100	89	0,03
Holmes Master Issuer PLC				0,780 % due 18.07.2029			
1,033 % due 15.10.2054	1.000	999	0,35	Silver Arrow Compartment Silver Arrow UK	£ 795	794	0,28
Ludgate Funding PLC				1,076 % due 20.07.2023			
0,990 % due 01.12.2060	163	156	0,05	SLM Student Loan Trust			
1,280 % due 01.01.2061	170	167	0,06	0,000 % due 25.01.2024	£ 124	110	0,04
Oak PLC				0,000 % due 17.06.2024	85	75	0,03
1,476 % due 26.02.2052	412	412	0,15	Sorrento Park CLO DAC			
Precise Mortgage Funding PLC				0,631 % due 16.11.2027	700	624	0,22
1,451 % due 12.12.2054	188	187	0,07	1,200 % due 16.11.2027	250	223	0,08
Residential Mortgage Securities PLC				Sunrise SPV			
1,604 % due 20.03.2050	2.888	2.889	1,02	0,280 % due 31.07.2040	110	98	0,04
1,754 % due 20.12.2046	1.307	1.310	0,46	Tikehau CLO BV			
1,947 % due 15.06.2046	402	404	0,14	0,600 % due 04.08.2028	200	178	0,06
Ripon Mortgages PLC				Toro European CLO DAC			
1,605 % due 20.08.2056	863	865	0,30	0,000 % due 15.10.2030 (a)	1.400	1.247	0,44
Rochester Financing PLC				Turbo Finance PLC			
2,097 % due 20.06.2045	792	798	0,28	1,476 % due 20.02.2023	£ 193	193	0,07
Stanlington PLC				Tymon Park CLO Ltd.			
1,801 % due 12.06.2046	2.519	2.524	0,89	0,590 % due 21.01.2029	£ 400	356	0,13
Taurus UK DAC						28.478	10,04
1,654 % due 17.11.2027	398	398	0,14				
Thrones PLC				STAATSANLEIHEN			
1,652 % due 15.11.2049	502	503	0,18	Caisse des Depots et Consignations			
Trinidad Mortgage Securities PLC				1,500 % due 23.12.2019	£ 1.000	1.005	0,35
1,545 % due 24.01.2059	1.700	1.697	0,60	Export Development Canada			
		25.774	9,08	0,837 % due 13.10.2022	1.800	1.802	0,63
				Japan Finance Organization for Municipalities			
				5,750 % due 09.08.2019	1.600	1.661	0,59
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Kommunalbanken A/S			
Adagio CLO Ltd.				0,875 % due 08.12.2020	1.000	994	0,35
0,660 % due 15.10.2029	£ 200	177	0,06	Municipality Finance PLC			
Arbour CLO DAC				0,750 % due 15.12.2020	1.000	991	0,35
0,580 % due 15.03.2029	400	356	0,13			6.453	2,27
Aurium CLO DAC							
0,680 % due 13.10.2029	200	177	0,06	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
0,800 % due 26.04.2029	800	714	0,25	PENSIONSGESCHÄFTE (d)			
Babson Euro CLO BV						4.556	1,61
0,499 % due 25.10.2029	1.750	1.552	0,55				
Barings Euro CLO BV				JAPAN TREASURY BILLS			
0,680 % due 27.07.2030	200	177	0,06	(0,138) % due 09.10.2018 (b)(c)	¥ 120.000	810	0,29
Bavarian Sky S.A.							
1,096 % due 20.11.2025	£ 3.300	3.292	1,16	U.K. TREASURY BILLS			
Bosphorus CLO DAC				0,469 % due 12.11.2018 (b)(c)	£ 1.000	999	0,35
0,850 % due 15.04.2027	£ 497	443	0,16	0,510 % due 05.11.2018 (b)(c)	2.980	2.978	1,05
Bumper UK Finance PLC				0,520 % due 01.10.2018 (b)(c)	700	700	0,25
1,256 % due 20.11.2027	£ 2.139	2.140	0,75	0,540 % due 01.10.2018 (b)(c)	1.500	1.500	0,53
Cairn CLO BV				0,540 % due 22.10.2018 (b)(c)	7.000	6.997	2,46
0,580 % due 30.01.2028	£ 200	178	0,06	0,550 % due 03.12.2018 (b)(c)	6.060	6.053	2,13
0,650 % due 20.10.2028	800	711	0,25	0,620 % due 15.10.2018 (b)(c)	3.690	3.689	1,30
0,790 % due 25.07.2029	1.900	1.688	0,60	0,720 % due 19.11.2018 (b)(c)	14.800	14.786	5,21
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC						37.702	13,28
0,730 % due 21.09.2029	200	178	0,06	Kurzfristige Instrumente insgesamt		43.068	15,18
1,200 % due 21.09.2029	200	178	0,06				
Compartment Driver UK				Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
1,224 % due 25.01.2024	£ 988	988	0,35	insgesamt – amtliche Börse/geregelter Markt	£ 282.123	99,41	
Cork Street CLO Designated Activity Co.							
0,590 % due 27.11.2028	£ 200	177	0,06				
CVC Cordatus Loan Fund Ltd.							
0,780 % due 24.01.2028	2.000	1.784	0,63				
Dartry Park CLO DAC							
0,830 % due 28.04.2029	200	178	0,06				
Delamare Cards MTN Issuer PLC							
1,376 % due 19.05.2021	£ 3.800	3.808	1,34				
E-Carat PLC							
1,576 % due 18.06.2024	242	242	0,09				
FCT Titrisocram							
0,109 % due 25.11.2035	£ 139	124	0,04				
Globaldrive Auto Receivables UK PLC							
1,196 % due 20.09.2024	£ 1.624	1.625	0,57				
Gracechurch Card Funding PLC							
1,224 % due 15.07.2021	2.000	2.004	0,71				
Harvest CLO DAC							
0,630 % due 18.11.2029	£ 100	89	0,03				

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*)

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

DEVISENKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu liefernde Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierter Wertzuwachs	Nicht realisierter Wertverlust	Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ Wertverlust	% des Nettovermögens
AZD	11/2018	¥ 5.900	£ 42	£ 2	£ 0	£ 2	0,00
BOA	11/2018	£ 482	£ 540	0	0	0	0,00
BRC	10/2018	¥ 50.000	\$ 455	11	0	11	0,00
	11/2018	SEK 348.730	£ 29.998	0	(122)	(122)	(0,04)
CBK	10/2018	¥ 30.000	\$ 273	6	0	6	0,00
	11/2018	£ 762	£ 847	0	(7)	(7)	0,00
	11/2018	SEK 2.500	£ 215	0	0	0	0,00
	11/2018	\$ 1.419	1.104	18	0	18	0,01
HUS	11/2018	€ 1.728	1.554	13	0	13	0,01
JPM	11/2018	38.555	34.704	312	0	312	0,11
RBC	11/2018	\$ 365	286	6	0	6	0,00
RYL	11/2018	£ 4.141	SEK 48.300	31	0	31	0,01
SOG	11/2018	\$ 24.162	£ 18.869	376	0	376	0,13
SSB	11/2018	£ 3.327	€ 3.733	4	(1)	3	0,00
UAG	10/2018	¥ 40.000	\$ 364	9	0	9	0,00
				£ 788	£ (130)	£ 658	0,23
Derivative OTC-Finanzinstrumente insgesamt						£ 658	0,23
Anlagen insgesamt						£ 282.781	99,64
Sonstige kurzfristige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten						£ 1.024	0,36
Nettovermögen						£ 283.805	100,00

ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd. *):

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

(a) „When-issued“-Wertpapier.

(b) Nullkupon-Papier.

(c) Kupon stellt eine Rendite bis Fälligkeit dar.

(d) Pensionsgeschäfte zum 30. September 2018:

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	(Erhaltene) Sicherheiten	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäften ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BRC	0,700 %	28.09.2018	01.10.2018	£ 1.600	United Kingdom Gilt 3.500 % due 22.07.2068	£ (1.606)	£ 1.600	£ 1.600	0,57
	0,750	28.09.2018	01.10.2018	2.900	Albion Capital Corp. 0.000 % due 25.10.2018	(2.899)	2.900	2.900	1,02
SSB	1,100	28.09.2018	01.10.2018	\$ 73	U.S. Treasury Notes 2,000 % due 31.08.2021	(60)	56	56	0,02
Pensionsgeschäfte insgesamt						£ (4.565)	£ 4.556	£ 4.556	1,61

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert⁽¹⁾

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	£ 0	£ 282.123	£ 0	£ 282.123
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	0	658	0	658
Gesamt	£ 0	£ 282.781	£ 0	£ 282.781

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	£ 0	£ 284.756	£ 0	£ 284.756
Derivative Finanzinstrumente ⁽³⁾	0	1.911	0	1.911
Gesamt	£ 0	£ 286.667	£ 0	£ 286.667

⁽¹⁾ Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

⁽²⁾ Weitere Informationen sind der Aufstellung des Wertpapierbestands zu entnehmen.

⁽³⁾ Derivative Finanzinstrumente umfassen ggf. offene Terminkontrakte, Swap-Vereinbarungen, verkaufte Optionen, gekaufte Optionen und Devisenterminkontrakte.

(Erhaltene) / verpfändete Sicherheiten für derivative OTC-Finanzinstrumente

Die folgende Tabelle ist eine Zusammenfassung des beizulegenden Zeitwerts der derivativen OTC-Finanzinstrumente und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten zum 30. September 2018:

Kontrahent	Beizulegender Zeitwert von OTC-Derivaten insgesamt	(Erhaltene)/verpfändete Sicherheiten	Nettoengagement ⁽¹⁾
	£	£	£
AZD	2	0	2
BRC	(111)	0	(111)
CBK	17	0	17
HUS	13	0	13
JPM	312	(304)	8
RBC	6	0	6
RYL	31	(60)	(29)
SOG	376	(450)	(74)
SSB	3	0	3
UAG	9	0	9

⁽¹⁾ Das Netto-Engagement stellt die Nettoforderung/(-verbindlichkeit) dar, die bei einem Ausfall vom bzw. an den Kontrahenten zu zahlen wäre.

Vergleichsangaben

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Vergleichsangaben der Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. September 2018:

	30. Sept. 2018 (%)	31. März 2018 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	82,31	74,54
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	15,49	1,36
Sonstige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1,61	23,28
Derivative OTC-Finanzinstrumente	0,23	0,66

* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Aufstellung des Wertpapierbestands
PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE – AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN				BANKEN UND FINANZEN			
Danske Bank A/S 1,650 % due 06.09.2019	\$	3.755	\$	3.701	0,13	John Deere Capital Corp. 2,556 % due 07.01.2020	\$	4.600	\$	4.606	0,16
2,831 % due 02.03.2020	6.500	6.489	0,23	JPMorgan Chase & Co. 3,417 % due 07.06.2021	4.000	4.081	0,14	JPMorgan Chase & Co. 3,801 % due 01.03.2021	300	308	0,01
DBS Group Holdings Ltd. 2,246 % due 16.07.2019	500	498	0,02	JPMorgan Chase Bank N.A. 2,545 % due 01.09.2020	3.500	3.506	0,12	2,588 % due 13.02.2020	5.000	5.003	0,17
2,817 % due 08.06.2020	2.250	2.255	0,08	2,633 % due 01.02.2021 (c)	16.400	16.424	0,57	Landesreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank 2,501 % due 27.09.2019	21.300	21.366	0,75
2,839 % due 16.07.2019	2.400	2.402	0,08	LeasePlan Corp. NV 2,875 % due 22.01.2019	9.600	9.593	0,34	Lloyds Bank PLC 2,350 % due 05.09.2019	5.000	4.966	0,17
2,955 % due 25.07.2022	8.500	8.555	0,30	2,833 % due 07.05.2021	5.000	5.019	0,18	Macquarie Bank Ltd. 2,600 % due 24.06.2019	6.500	6.485	0,23
Dexia Credit Local S.A. 1,875 % due 28.03.2019	17.386	17.314	0,60	2,687 % due 04.04.2019	10.850	10.858	0,38	3,459 % due 29.07.2020	16.300	16.540	0,58
1,875 % due 29.01.2020 (c)	1.700	1.675	0,06	3,459 % due 29.07.2020	16.300	16.540	0,58	Macquarie Group Ltd. 3,000 % due 03.12.2018	1.574	1.575	0,06
2,250 % due 30.01.2019 (c)	16.200	16.178	0,57	Metropolitan Life Global Funding 2,730 % due 07.09.2020	11.400	11.424	0,40	Mitsubishi Corp. Finance PLC 2,819 % due 30.04.2019	2.000	2.000	0,07
2,500 % due 25.01.2021	3.800	3.745	0,13	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3,061 % due 02.03.2023	5.900	5.921	0,21	3,125 % due 25.07.2022	8.200	8.252	0,29
DNB Bank ASA 2,768 % due 02.10.2020	5.000	5.018	0,18	3,230 % due 22.02.2022	10.199	10.298	0,36	3,394 % due 13.09.2021	8.351	8.488	0,30
Erste Abwicklungsanstalt 2,500 % due 13.03.2020	15.200	15.090	0,53	3,394 % due 13.09.2021	8.351	8.488	0,30	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd. 3,122 % due 23.07.2019	8.582	8.607	0,30
2,537 % due 09.03.2020	13.400	13.436	0,47	3,247 % due 20.02.2019	1.425	1.429	0,05	Mizuho Bank Ltd. 2,450 % due 16.04.2019	2.500	2.496	0,09
EXIM Sukuk Malaysia Bhd. 2,874 % due 19.02.2019	1.800	1.798	0,06	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3,211 % due 11.09.2022	14.750	14.857	0,52	Mizuho Financial Group, Inc. 3,251 % due 28.02.2022	3.500	3.530	0,12
FMS Wertmanagement 2,638 % due 11.02.2019	3.000	3.003	0,11	3,474 % due 13.09.2021	2.600	2.644	0,09	3,817 % due 12.04.2021	8.000	8.189	0,29
Ford Motor Credit Co. LLC 2,021 % due 03.05.2019	2.000	1.988	0,07	Morgan Stanley 2,375 % due 23.07.2019	9.000	8.965	0,31	2,891 % due 10.02.2021	11.500	11.539	0,40
2,262 % due 28.03.2019	3.200	3.189	0,11	2,891 % due 10.02.2021	11.500	11.539	0,40	3,277 % due 22.07.2022	8.000	8.072	0,28
2,597 % due 04.11.2019	1.000	992	0,03	3,300 % due 13.05.2019	6.400	6.571	0,23	Nasdaq, Inc. 2,756 % due 22.03.2019	13.000	13.016	0,45
2,681 % due 09.01.2020	2.500	2.475	0,09	National Bank of Canada 2,894 % due 12.06.2020	2.760	2.775	0,10	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. 2,771 % due 30.06.2021	3.000	3.007	0,11
3,164 % due 12.03.2019	15.500	15.517	0,54	2,936 % due 17.01.2020	2.400	2.414	0,08	Niederlandse Waterschapsbank NV 2,354 % due 15.03.2019	10.000	10.002	0,35
3,168 % due 12.08.2019	2.350	2.354	0,08	Nissan Motor Acceptance Corp. 2,727 % due 13.07.2020	8.600	8.610	0,30	2,854 % due 13.09.2019	9.593	9.618	0,34
3,296 % due 24.09.2020	3.800	3.805	0,13	2,854 % due 13.09.2019	9.593	9.618	0,34	2,983 % due 21.09.2021	4.170	4.179	0,15
3,339 % due 09.01.2020	12.800	12.852	0,45	2,987 % due 13.07.2022	4.000	4.009	0,14	3,076 % due 28.09.2022	8.400	8.419	0,29
3,919 % due 08.01.2019	500	502	0,02	Nomura Holdings, Inc. 2,750 % due 19.03.2019	14.585	14.592	0,51	NRW Bank 2,463 % due 01.02.2022	10.000	10.060	0,35
8,125 % due 15.01.2020	2.527	2.670	0,09	NRW Bank 2,508 % due 11.02.2019	3.000	3.002	0,11	NTT Finance Corp. 2,916 % due 29.06.2020	20.000	20.092	0,70
General Motors Financial Co., Inc. 2,350 % due 04.10.2019	1.200	1.193	0,04	Protective Life Global Funding 2,906 % due 28.06.2021	2.800	2.805	0,10	QNB Finance Ltd. 2,750 % due 31.10.2018	2.700	2.700	0,09
2,400 % due 09.05.2019	6.850	6.833	0,24	2,906 % due 28.06.2021	2.800	2.805	0,10	3,688 % due 12.02.2020	8.400	8.474	0,30
3,100 % due 15.01.2019	1.900	1.902	0,07	Reliance Standard Life Global Funding 2,500 % due 15.01.2020	1.500	1.485	0,05	3,693 % due 07.02.2020	25.000	25.187	0,88
3,150 % due 15.01.2020	700	699	0,02								
3,189 % due 09.04.2021	2.400	2.410	0,08								
3,500 % due 10.07.2019	4.900	4.922	0,17								
3,791 % due 09.05.2019	1.245	1.253	0,04								
3,899 % due 15.01.2020	11.358	11.508	0,40								
Goldman Sachs Group, Inc. 3,445 % due 26.04.2022	4.000	4.049	0,14								
3,484 % due 15.11.2021	15.690	15.874	0,55								
3,507 % due 23.04.2020	1.332	1.349	0,05								
3,695 % due 23.04.2021	1.694	1.732	0,06								
Harley-Davidson Financial Services, Inc. 2,400 % due 15.09.2019	800	795	0,03								
2,677 % due 08.03.2019	3.000	3.001	0,11								
2,812 % due 21.05.2020	2.900	2.911	0,10								
Hitachi Capital UK PLC 3,012 % due 20.11.2020	14.600	14.564	0,51								
HSBC Holdings PLC 2,922 % due 18.05.2021	2.000	2.004	0,07								
2,984 % due 11.09.2021	6.000	6.009	0,21								
3,971 % due 25.05.2021	21.100	21.743	0,76								
HSH Portfoliomanagement AoeR 2,000 % due 23.10.2019	12.000	11.878	0,41								
2,652 % due 19.11.2021	15.000	15.094	0,53								
Hutchinson Whampoa International Ltd. 7,625 % due 09.04.2019	1.659	1.698	0,06								
ICICI Bank Ltd. 3,500 % due 18.03.2020	700	695	0,02								
4,800 % due 22.05.2019	16.769	16.930	0,59								
Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,917 % due 26.02.2019	2.500	2.504	0,09								
Industrial Bank of Korea 2,000 % due 23.04.2020	1.000	982	0,03								
ING Bank NV 2,924 % due 15.08.2019	2.000	2.006	0,07								
3,086 % due 01.10.2019	8.200	8.236	0,29								
International Lease Finance Corp. 5,875 % due 01.04.2019	4.000	4.056	0,14								
6,250 % due 15.05.2019	9.257	9.439	0,33								
Intesa Sanpaolo SpA 3,875 % due 15.01.2019	6.000	6.006	0,21								
Jackson National Life Global Funding 3,111 % due 27.06.2022	9.200	9.300	0,32								

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ZEITWERT (in Tsd.)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
GM Financial Consumer Automobile Receivables Trust	\$ 5.013	\$ 4.996	0,17	2,885 % due 25.01.2028	\$ 6.819	\$ 6.846	0,24	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
Gracechurch Card Funding PLC				3,485 % due 25.04.2019	300	300	0,01	COMMERCIAL PAPER			
2,558 % due 15.07.2022	6.000	5.999	0,21	SMB Private Education Loan Trust	2.852	2.854	0,10	Campbell Soup Co.	\$ 1.200	\$ 1.191	0,04
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.				2,508 % due 16.03.2026	6.000	6.043	0,21	2,900 % due 15.01.2019			
3,268 % due 20.04.2027	5.000	4.991	0,17	3,058 % due 15.09.2034	5.000	5.066	0,18	Electricite De France S.A.	3.700	3.690	0,13
3,814 % due 15.08.2023	321	321	0,01	SoFi Consumer Loan Program LLC	2.200	2.200	0,08	Florida Power & Light Co.	11.600	11.551	0,40
KVK CLO Ltd.				2,770 % due 25.05.2026	1.412	1.404	0,05	2,700 % due 28.11.2018	10.500	10.455	0,37
3,489 % due 15.01.2026	1.955	1.956	0,07	SoFi Professional Loan Program LLC	2.079	2.061	0,07	Ford Motor Credit Co.	1.800	1.779	0,06
LCM LP				1,830 % due 25.05.2040	962	957	0,03	2,780 % due 19.02.2019	1.800	1.779	0,06
3,379 % due 20.10.2027 (b)	500	500	0,02	2,566 % due 25.02.2042	949	949	0,03	Marriott International	1.000	998	0,03
Master Credit Card Trust				3,066 % due 25.07.2039	268	270	0,01	2,520 % due 26.10.2018	1.000	1.000	0,03
2,672 % due 22.07.2024	4.000	4.009	0,14	3,316 % due 27.10.2036	710	720	0,03	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC	1.600	1.593	0,06
Mercedes-Benz Auto Lease Trust				3,516 % due 25.02.2040	511	515	0,02	2,500 % due 07.12.2018	1.600	1.593	0,06
2,200 % due 15.04.2020	1.870	1.867	0,07	SoFi Professional Loan Program Trust	2.640	2.640	0,12	Royal Caribbean Cruise	1.000	1.000	0,03
Mercedes-Benz Auto Receivables Trust				2,640 % due 25.08.2047	3.558	3.539	0,12	2,610 % due 05.10.2018	1.000	1.000	0,03
2,350 % due 15.08.2019	3.828	3.829	0,13	Starwood Waypoint Homes Trust	3.108	3.108	0,11	Virginia Electric & Power	2.550	2.549	0,09
Mountain View CLO Ltd.				3,108 % due 17.01.2035	198	199	0,01	2,290 % due 02.10.2018	6.000	5.986	0,21
3,157 % due 13.10.2027	6.000	5.980	0,21	THL Credit Wind River CLO Ltd.	2.000	2.003	0,07	2,400 % due 01.11.2018			
Navient Private Education Refi Loan Trust				3,789 % due 15.01.2026	2.000	2.003	0,07	VW CR, Inc.	4.000	3.979	0,14
3,010 % due 16.06.2042	6.529	6.520	0,23	Towd Point Mortgage Trust	2.816	2.816	0,10	2,800 % due 10.12.2018			
Navient Student Loan Trust				2,816 % due 25.02.2057	223	224	0,01				
2,816 % due 26.07.2066	4.000	4.030	0,14	Tralee CLO Ltd.	4.000	4.003	0,14				
2,966 % due 26.07.2066	1.000	1.005	0,04	Trillium Credit Card Trust	5.000	5.003	0,17				
3,066 % due 25.06.2065	2.151	2.164	0,08	2,315 % due 27.02.2023	5.000	5.003	0,17				
3,266 % due 27.12.2066	7.664	7.777	0,27	Utah State Board of Regents	4.517	4.520	0,16				
Neinet Student Loan Trust				2,966 % due 25.09.2056	2.852	2.856	0,10				
2,420 % due 23.08.2027	1.973	1.972	0,07	VOL1 LLC	1.725	1.720	0,06				
2,816 % due 25.03.2030	1.405	1.415	0,05	3,250 % due 25.05.2047	5.276	5.254	0,18				
3,016 % due 25.09.2065	7.844	7.920	0,28	3,250 % due 25.06.2047							
3,066 % due 25.02.2066	4.606	4.638	0,16	Whitehorse Ltd.	898	898	0,03				
Nissan Auto Lease Trust				3,496 % due 17.07.2026							
1,640 % due 16.09.2019	1.483	1.480	0,05	Zais CLO Ltd.	1.300	1.300	0,05				
Nissan Auto Receivables Owner Trust				0,000 % due 15.04.2028(b)	1.300	1.300	0,05				
1,790 % due 17.01.2022	3.206	3.182	0,11								
Northstar Education Finance, Inc.											
2,916 % due 26.12.2031	282	284	0,01								
Oak Hill Credit Partners Ltd.											
3,478 % due 20.07.2026	10.800	10.809	0,38								
Ocean Trails CLO											
3,238 % due 13.08.2025	1.621	1.622	0,06								
OFSI Fund Ltd.											
2,989 % due 20.03.2025	5.323	5.326	0,19								
OSCAR U.S. Funding Trust LLC											
2,603 % due 10.08.2021	3.000	3.003	0,10								
Palmer Square CLO Ltd.											
3,185 % due 15.08.2026	1.500	1.500	0,05								
Palmer Square Loan Funding Ltd.											
0,000 % due 15.11.2026 (b)	3.000	3.000	0,10								
2,939 % due 15.04.2026	19.178	19.157	0,67								
Penarth Master Issuer PLC											
2,545 % due 18.03.2022	6.000	5.998	0,21								
PHEAA Student Loan Trust											
3,166 % due 25.11.2065	3.718	3.770	0,13								
Prestige Auto Receivables Trust											
1,460 % due 15.07.2020	67	67	0,00								
SBA Tower Trust											
2,898 % due 15.10.2044	500	499	0,02								
SLC Student Loan Trust											
2,414 % due 15.02.2025	3.369	3.368	0,12								
2,444 % due 15.03.2027	2.439	2.437	0,09								
2,454 % due 15.06.2029	7.517	7.482	0,26								
2,474 % due 15.05.2023	929	928	0,03								
SLM Private Education Loan Trust											
3,258 % due 17.06.2030	2.070	2.079	0,07								
4,408 % due 16.06.2042	2.100	2.153	0,08								
SLM Student Loan Trust											
2,445 % due 27.01.2025	1.396	1.395	0,05								
2,445 % due 27.10.2025	595	595	0,02								
2,445 % due 25.01.2027	2.564	2.561	0,09								
2,475 % due 25.10.2028	1.458	1.455	0,05								
2,485 % due 25.10.2029	3.055	3.053	0,11								
2,505 % due 25.07.2023	5.413	5.414	0,19								
2,804 % due 15.12.2027	4.467	4.485	0,16								
2,835 % due 25.04.2024	1.568	1.571	0,05								
2,866 % due 27.12.2038	785	790	0,03								
2,885 % due 26.10.2026	791	791	0,03								

ANGABEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Beträge in Tsd.*):

* Ein Saldo von null kann auf die Rundung der tatsächlichen Beträge auf weniger als 1.000 zurückzuführen sein.

(a) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(b) „When-issued“-Wertpapier.

(c) Zum 30. September 2018 wurden Wertpapiere mit einem beizulegenden Zeitwert von insgesamt \$ 72.407 und Barmittel in Höhe von \$ 30 gemäß den Bedingungen der Rahmen-Rückkaufverträge und/oder globalen Rahmen-Rückkaufverträge als Sicherheiten verpfändet.

(d) Pensionsgeschäfte zum 30. September 2018:

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	(Erhaltene) Sicherheiten	Pensionsgeschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäften ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
SSB	1,100 %	28.09.2018	01.10.2018	\$ 19.331	U.S. Treasury Notes 2,000 % due 31.08.2021	\$ (19.721)	\$ 19.331	\$ 19.331	0,67
Pensionsgeschäfte insgesamt						\$ (19.721)	\$ 19.331	\$ 19.331	0,67

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Bewertung zum beizulegenden Zeitwert⁽¹⁾

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 30. September 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.929.746	\$ 0	\$ 2.929.746
Einlagen bei Kreditinstituten	0	8.016	0	8.016
Gesamt	\$ 0	\$ 2.937.762	\$ 0	\$ 2.937.762

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Zeitwertbewertung gemäß den zum 31. März 2018 für die Bewertung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds verwendeten Parametern:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Preise für identische Anlagen (Ebene 1)	Sonstige wesentliche beobachtbare Parameter (Ebene 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Parameter (Ebene 3)	Beizulegender Zeitwert
Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.224.383	\$ 3.800	\$ 3.228.183
Einlagen bei Kreditinstituten	0	6.994	0	6.994
Gesamt	\$ 0	\$ 3.231.377	\$ 3.800	\$ 3.235.177

⁽¹⁾ Siehe Anmerkung 3 in den Anmerkungen zum Abschluss für weitere Informationen.

⁽²⁾ Weitere Informationen sind der Aufstellung des Wertpapierbestands zu entnehmen.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. September 2018:

Kontrahent	Leihzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Leihbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BOS	2,390 %	24.09.2018	24.10.2018	\$ (12.274)	\$ (12.280)	(0,43)
IND	2,420	25.09.2018	11.10.2018	(17.919)	(17.927)	(0,62)
UBS	2,450	24.09.2018	24.10.2018	(4.776)	(4.778)	(0,17)
	2,450	28.09.2018	12.10.2018	(34.986)	(34.993)	(1,22)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte insgesamt					\$ (69.978)	(2,44)

Vergleichsangaben

Die folgende Darstellung ist eine Zusammenfassung der Vergleichsangaben der Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. September 2018:

	30. Sept. 2018 (%)	31. März 2018 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene Wertpapiere	60,01	68,32
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere*	37,85	30,32
Sonstige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	4,42	8,31
Einlagenzertifikate	0,28	0,23
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(2,44)	(5,70)

* Gemäß der in Anhang 2 des Verkaufsprospekt angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Anmerkungen zum Abschluss

1. ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Jeder der in diesem Bericht aufgeführten Fonds (im Folgenden einzeln ein „Fonds“ und zusammen die „Fonds“) ist ein Teilfonds der PIMCO Fixed Income Source ETFs plc (die „Gesellschaft“), eine offene Umbrella-Investmentgesellschaft mit beschränkter Haftung, mit veränderlichem Kapital und getrennter Haftung zwischen den Fonds gemäß dem irischen Companies Act 2014 in der Rechtsform einer Aktiengesellschaft nach irischem Recht unter der Registernummer 489440. Die Gesellschaft wurde von der irischen Zentralbank (die „Zentralbank“) gemäß den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (Durchführungsverordnung Nr. 352 von 2011) in der jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Vorschriften“) zugelassen. Die Gesellschaft ist eine Umbrella-Gesellschaft, so dass von Zeit zu Zeit für verschiedene Fonds Anteilklassen ausgegeben werden dürfen. Im Ermessen des Verwaltungsrats kann für einen Fonds mehr als eine Anteilklasse („Klasse“) ausgegeben werden. Für jeden Fonds wird ein gesondertes Portfolio von Vermögenswerten unterhalten, das in Übereinstimmung mit dem Anlageziel und der Anlagepolitik dieses Fonds angelegt wird. Von Zeit zu Zeit darf der Verwaltungsrat mit vorheriger schriftlicher Zustimmung der Zentralbank weitere Fonds auflegen. Von Zeit zu Zeit darf der Verwaltungsrat im Einklang mit den Anforderungen der Zentralbank weitere Klassen auflegen. Die Gesellschaft wurde am 24. September 2010 gegründet.

Bei den Fonds handelt es sich um börsengehandelte Fonds („ETFs“). Die Anteile der Fonds (wie im Verkaufsprospekt definiert) werden zu Marktpreisen an einer oder mehreren relevanten Börsen (wie im Verkaufsprospekt definiert) und anderen Sekundärmärkten notiert und gehandelt. Der Marktpreis für die Anteile der jeweiligen Fonds kann vom NIW des Fonds abweichen. In aller Regel dürfen nur befugte Teilnehmer (gemäß der im Verkaufsprospekt angegebenen Definition) von der Gesellschaft Anteile zum Nettoinventarwert kaufen. Befugte Teilnehmer können Anteile gegen Barmittel oder gegen eine Sacheinlage von Wertpapieren zeichnen, die dem Portfolio eines Fonds entsprechen (und als solche von den Anlageberatern anerkannt werden).

Der PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF, der PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF, der PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF und der PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF werden an der Deutsche Börse AG gehandelt, und der PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF, der PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF, der PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF, der PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF und der PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF werden an der Euronext Dublin notiert und an der London Stock Exchange gehandelt.

2. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE

Die von der Gesellschaft übernommenen und bei der Erstellung dieses Abschlusses angewandten wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze und Schätzungsmethoden entsprechen denjenigen, die auf den geprüfte Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. März 2018 (der „geprüfte Jahresabschluss“) angewandt wurden.

Bilanzierungsgrundlage

Bei dem vorliegenden Abschluss handelt es sich um den ungeprüften verkürzten Abschluss für den Sechsmonatszeitraum zum 30. September 2018. Er wurde gemäß Financial Reporting Standard („FRS“) 104: „Zwischenberichterstattung“, der vom Financial Reporting Council („FRC“) veröffentlicht wurde, und den OGAW-Vorschriften erstellt.

Der ungeprüfte verkürzte Abschluss sollte in Verbindung mit dem geprüften Jahresabschluss gelesen werden, der von den Abschlussprüfern einen uneingeschränkten Bestätigungsvermerk erhalten hat und gemäß den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen („FRS 102“) und den

irischen Rechtsvorschriften, bestehend aus dem Companies Act von 2014 und den OGAW-Vorschriften, erstellt wurde. Bei den in Irland allgemein für die Erstellung von Rechnungsabschlüssen anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen handelt es sich um diejenigen, die vom FRC herausgegeben werden.

Die in die Gesamtergebnisrechnung (Statement of Total Recognised Gains and Losses) und die Eigenkapitalveränderungsrechnung (Reconciliation of Movements in Shareholders Funds) aufzunehmenden Informationen sind nach Auffassung des Verwaltungsrats in der Gewinn- und Verlustrechnung und der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens enthalten.

Die Gesellschaft hat von der Befreiung von der Erstellung einer Kapitalflussrechnung gemäß FRS 102 Gebrauch gemacht.

Der Abschluss wird nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, modifiziert durch die erfolgswirksame Neubewertung der gehaltenen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert.

Die Angaben im Abschluss wurden auf Tausend gerundet, sofern nichts Gegenteiliges im Bericht angegeben ist.

3. ANLAGEN ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT

Die Gesellschaft ist verpflichtet, die Zeitwerthierarchie anzugeben, in der Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert für die finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten kategorisiert werden. Diese Offenlegungen beruhen auf einer Zeitwerthierarchie mit drei Ebenen für die Parameter, die bei Bewertungstechniken zur Ermittlung des Zeitwertes verwendet werden.

Der beizulegende Zeitwert ist definiert als der Betrag, für den ein Vermögenswert zwischen sachverständigen, vertragswilligen Parteien im Rahmen einer Transaktion zu marktüblichen Konditionen getauscht, eine Verbindlichkeit beglichen oder ein Eigenkapitalinstrument übertragen werden konnte. Die Angabe einer Zeitwerthierarchie ist erforderlich, gemäß der separat für jede Hauptkategorie von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten Einstufungen von Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert in verschiedene Ebenen vorzunehmen sind (Ebenen 1, 2 und 3). Die für die Bewertung von Wertpapieren verwendeten Parameter bzw. der verwendete Ansatz liefern nicht unbedingt einen Hinweis auf das mit einer Anlage in diesen Wertpapieren verbundene Risiko. Die Ebenen 1, 2 und 3 der Zeitwerthierarchie sind wie folgt definiert:

- Ebene 1 — Der nicht angepasste notierte Preis für einen identischen Vermögenswert oder eine identische Verbindlichkeit an einem aktiven Markt, zu dem das Rechtssubjekt am Bewertungsstichtag Zugang hat.
- Ebene 2 — Andere zur Bewertung herangezogene Bewertungsdaten als die in Ebene 1 enthaltenen notierten Preise, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit direkt oder indirekt beobachtbar sind (das heißt aus Marktdaten abgeleitet sind).
- Ebene 3 — Für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit sind keine Bewertungsdaten beobachtbar (d.h. es sind keine Marktdaten verfügbar).

Eine Analyse der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten jedes Fonds zum 30. September 2018 und zum 31. März 2018 ist Aufstellung des Wertpapierbestands zu entnehmen. Die von den Fonds zur Einstufung der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten anhand einer Zeitwerthierarchie angewandten Methode entspricht derjenigen, die auch im geprüften Jahresabschluss angewandt wird.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Anmerkungen zum Abschluss (Fortsetzung)

4. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT

Soweit gemäß den Anlagezielen und der Anlagepolitik der Fonds zulässig und vorbehaltlich der von Zentralbank von Zeit zu Zeit festgelegten Grenzen sowie vorbehaltlich der Bestimmungen des Verkaufsprospekts, dürfen derivative Finanzinstrumente und Anlagetechniken für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements von allen Fonds eingesetzt werden. Die Fonds können diese derivativen Finanzinstrumente und Anlagetechniken zur Absicherung gegen Veränderungen der Zinsen, Wechselkurse der nicht funktionalen Währungen, Wertpapierkurse oder im Rahmen der übergeordneten Anlagestrategien anwenden.

Der Gesamtzinsertrag/(-aufwand) aus Pensionsgeschäften belief sich im Berichtszeitraum zum 30. September 2018 auf €848.099/(€246.028) (30. September 2017: €787.594/(€220.409)).

Der Gesamtzinsertrag/(-aufwand) aus umgekehrten Pensionsgeschäften belief sich im Berichtszeitraum zum 30. September 2018 auf €5.025/(€1.242.801) (30. September 2017: €7.311/(€240.978)).

Der Gesamtzinsertrag/(-aufwand) aus Sale-Buyback-Finanzierungsgeschäften belief sich im Berichtszeitraum zum 30. September 2018 auf €0/(€526.055) (30. September 2017: €0/(€147.459)).

5. AUSSCHÜTTUNGSPOLITIK

Nach der aktuellen Ausschüttungspolitik der Gesellschaft wird den Inhabern von Anteilen ausschüttender Klassen ein etwaiger Nettoanlageertrag der Fonds ausgezahlt (dieser besteht aus Erträgen abzüglich Aufwendungen). Dividenden auf Anteile ausschüttender Anteilklassen der Fonds werden monatlich beschlossen und nach Beschluss in bar ausgezahlt. Im Falle des PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF werden für ausschüttende Anteilklassen gezahlte Dividenden jährlich festgesetzt und nach der Festsetzung in bar ausgezahlt. Im Falle des PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF und des PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF werden auf etwaige ausschüttende Anteilklassen gezahlte Dividenden quartalsmäßig festgesetzt und nach Festsetzung in bar ausbezahlt.

Die Nettoanlageerträge, die den Anteilen thesaurierender Klassen der Fonds zugewiesen werden, werden weder ausgewiesen noch ausgeschüttet. Der NIW je Anteil der thesaurierenden Klassen wird jedoch erhöht, um die Nettoanlageerträge zu berücksichtigen.

Jede Dividendenausschüttung, die nicht innerhalb eines Zeitraums von sechs Jahren ab dem Datum des Dividendenbeschlusses in Anspruch genommen wird, verjährt und fällt wieder dem jeweiligen Fonds zu.

6. VERRECHNUNGSPROVISIONEN (SOFT COMMISSIONS)

Die Gesellschaft bzw. ihr Anlageberater kann Transaktionen im Namen der Fonds über oder mit Unterstützung von Ausführungsmaklern durchführen, die zusätzlich zur routinemäßigen Order-Ausführung gelegentlich Güter, Dienstleistungen oder andere Vorteile wie etwa Research- und Beratungsdienste für die Gesellschaft oder ihre Beauftragten bereitstellen oder beschaffen können. Die Gesellschaft bzw. ihr Anlageberater kann diesen Maklern Full-Service-Maklergebühren zahlen, die teilweise für die Bereitstellung zulässiger Güter oder Dienstleistungen verwendet werden. Diese Anlageberater, bei denen es sich um MiFID-Investmentgesellschaften handelt, müssen Research-Leistungen Dritter, die sie im Zusammenhang mit der Verwaltung des Vermögens der einzelnen Fonds kaufen, direkt aus ihren eigenen Mitteln bezahlen.

7. GETRENNTE HAFTUNG

Die Gesellschaft ist eine offene Umbrella-Investmentgesellschaft mit veränderlichem Kapital und getrennter Haftung zwischen ihren Teilfonds. Daher müssen Verbindlichkeiten, die in einem Fonds der Gesellschaft aufgelaufen sind oder die einem Fonds der Gesellschaft zuzuweisen sind, ausschließlich aus dem Vermögen dieses Teilfonds getilgt werden. Es ist den Fonds und den Verwaltungsratsmitgliedern, sowie Insolvenzverwaltern, Prüfern, Abwicklern oder sonstigen Personen untersagt, das Vermögen eines Fonds einzusetzen, um Verbindlichkeiten zu tilgen, die einem anderen Fonds entstanden sind oder die einem anderen Fonds zugewiesen werden. Sie dürfen auch nicht verpflichtet werden, das Vermögen eines Fonds einzusetzen, um Verbindlichkeiten zu tilgen, die einem anderen Fonds entstanden sind oder die einem anderen Fonds der Gesellschaft zugewiesen werden, unabhängig davon, wann eine solche Verbindlichkeit entstanden ist.

8. ÄNDERUNGEN IM VERKAUFSPROSPEKT, IN DER GRÜNDUNGSURKUNDE UND DER SATZUNG

Der Verkaufsprospekt der Gesellschaft wurde konsolidiert und am 12. Juli 2017 neu herausgegeben. Seit dem 8. September 2016 hat es keine weitere Aktualisierungen der Gründungsurkunde und der Satzung gegeben.

9. GEBÜHREN UND AUFWENDUNGEN

(a) An die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende Gebühren:

Die im Verkaufsprospekt beschriebenen, an PIMCO Global Advisors (Ireland), Ltd. (die „Verwaltungsgesellschaft“) zu zahlenden Gebühren dürfen 2,50 % p.a. des Nettoinventarwerts der jeweiligen Klasse jedes Fonds nicht übersteigen.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Anmerkungen zum Abschluss (Fortsetzung)

(b) Managementgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt oder beschafft für jeden Fonds, wie im Verkaufsprospekt beschrieben, Anlageberatungs-, Administrations-, Verwahr- und andere Dienstleistungen, wofür jeder Fonds eine einzelne Managementgebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlt. Die Managementgebühr für jeden Fonds (wie im Verkaufsprospekt definiert) fällt an jedem Handelstag (wie im Nachtrag des jeweiligen Fonds definiert) an

und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Managementgebühr vollständig oder teilweise an die Anlageberater zahlen, um die von den Anlageberatern erbrachten Anlageberatungs- und sonstigen Dienstleistungen zu vergüten, und damit die Anlageberater die von der Verwaltungsgesellschaft für die Fonds beschafften Administrations-, Verwahr- und sonstigen Dienstleistungen bezahlen können.

Die Managementgebühr für jede Klasse der einzelnen Fonds (ausgedrückt als jährlicher Prozentsatz vom Nettoinventarwert) stellt sich wie folgt dar:

Fonds	(Abgesicherte)	Ausschüttende / thesaurierende EUR-Klasse	(Abgesicherte)	Ausschüttende / thesaurierende GBP-Klasse	(Abgesicherte)	Ausschüttende / thesaurierende USD-Klasse
	ausschüttende / thesaurierende CHF-Klasse		ausschüttende / thesaurierende EUR-Klasse		ausschüttende / thesaurierende GBP-Klasse	
PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF	-	0,43 %	-	-	-	-
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF	-	-	-	-	-	0,60 %
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	-	0,44 % **	-	-	-	-
PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF	-	0,35 %	-	-	-	-
PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF	-	0,49 % *	-	-	-	-
PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF	0,54 % *	-	-	-	-	0,49 % *
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	0,60 %	-	0,60 %	-	0,60 %	0,55 %
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF	-	-	-	0,35 %	-	-
PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF	-	-	-	-	-	0,35 %

* Bis zum 31. Dezember 2017 galt ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,10 % p.a. Dieser Gebührenverzicht war auf den 1. Januar 2018 befristet. In dieser Zahl ist der Gebührenverzicht nicht berücksichtigt.

** In dieser Zahl ist ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,06 % p. a. bis zum 31. Dezember 2018 berücksichtigt. Der Gebührenverzicht ist bis zum 1. Januar 2019 befristet.

Angesichts des Fixcharakters der Managementgebühr trägt die Verwaltungsgesellschaft, nicht die Anteilhaber, das Risiko von Preissteigerungen bei den von der Managementgebühr abgedeckten Dienstleistungen sowie das Risiko, dass die Aufwendungen in Bezug auf solche Dienstleistungen infolge eines Rückgangs des Nettovermögens die Höhe der Managementgebühr übersteigen. Umgekehrt würde die Verwaltungsgesellschaft, und nicht die Anteilhaber, von einem Preisrückgang bei den von der Managementgebühr abgedeckten Kosten profitieren, zum Beispiel bei einem Rückgang der Aufwendungen (gemessen als Prozentsatz des Nettovermögens) infolge eines Anstiegs des Nettovermögens.

(c) Anlageberatungsdienstleistungen

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt und/oder beschafft im Auftrag der Gesellschaft Anlageberatungsdienstleistungen. Solche Dienstleistungen beinhalten die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte der einzelnen Fonds. Die Gebühren der Anlageberater (sowie die gegebenenfalls darauf anfallende Mehrwertsteuer) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Managementgebühr gezahlt.

(d) Administrations-, Verwahr- und Sonstige Dienstleistungen

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt und/oder beschafft im Auftrag der Gesellschaft Administrations-, Verwahr- und andere Dienstleistungen. Zu diesen Dienstleistungen gehören Administrations- und Transferstellenfunktionen, Fondsbuchhaltung sowie die Funktion als Verwahrstelle und Unterverwahrstelle in Bezug auf die einzelnen Fonds. Die Gebühren und Aufwendungen des Administrators und der Depotbank (sowie die gegebenenfalls darauf anfallende Mehrwertsteuer) werden von der aus der Managementgebühr oder von den Anlageberatern gezahlt.

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt und/oder beschafft im Auftrag der Gesellschaft bestimmte andere Dienstleistungen. Dazu gehören u. a. Listing- Broker-Dienste, Zahlstellen- und andere lokale Vertreterdienstleistungen, Rechnungslegung, Prüfung, Rechtsberatung und andere Fachberatungsleistungen, Sekretärdienstleistungen, Druck-, Veröffentlichungs- und Übersetzungskosten sowie die Bereitstellung und Koordinierung von aufsichtsrechtlichen, administrativen und aktionärsbezogenen Dienstleistungen, die für den Betrieb der Fonds erforderlich sind. Die Gebühren und ordentlichen Aufwendungen in Zusammenhang mit diesen Dienstleistungen (sowie die gegebenenfalls darauf anfallende Mehrwertsteuer) werden von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatern im Auftrag der Verwaltungsgesellschaft aus der Managementgebühr gezahlt.

Die Fonds übernehmen sonstige Aufwendungen im Zusammenhang mit ihrem Betrieb, die nicht von der Managementgebühr abgedeckt werden und die variieren und die Gesamthöhe der Aufwendungen der Fonds beeinflussen können. Hierzu zählen unter anderem Steuern und staatliche Abgaben, Maklergebühren, Provisionen und sonstige Transaktionskosten, Fremdfinanzierungskosten einschließlich Zinsaufwand, Gründungskosten, außerordentliche Aufwendungen (wie Prozesskosten und Schadenersatzleistungen) sowie die Gebühren und Aufwendungen der unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sowie ihrer Berater.

Die Gesellschaft hat im Zeitraum zum 30. September 2018 den Verwaltungsratsmitgliedern ein Honorar von €23.350 gezahlt (per 30. September 2017: €9.832). Darüber hinaus erhält jedes unabhängige Verwaltungsratsmitglied eine Erstattung für sämtliche angemessenen Spesen. Das Honorar der Verwaltungsratsmitglieder wird unter der Position „Sonstige Kosten“ in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Anmerkungen zum Abschluss (Fortsetzung)

(e) Transaktionsgebühren

Der Verwaltungsrat kann Anteilsinhabern nach eigenem Ermessen die folgenden Gebühren berechnen:

Fonds	Zeichnungs-/		Transaktionsgebühr für	
	Rücknahmegebühr	Umtauschgebühr	Sachübertragungen	Mischgebühren
PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	€	Bis zu EUR 1.000 Transaktionsgebühr Bis zu für Sachübertragungen zzgl. eines 1.000 Höchstbetrages von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	\$	Bis zu USD 500 zzgl. eines Höchstbetrages 1.000 von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	\$	Bis zu USD 500 zzgl. eines Höchstbetrages 1.000 von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	€	Bis zu EUR 500 zzgl. eines Höchstbetrages 1.000 von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	€	Bis zu EUR 1.000 Transaktionsgebühr Bis zu für Sachübertragungen zzgl. eines 1.000 Höchstbetrages von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	\$	Bis zu USD 1.000 Transaktionsgebühr Bis zu für Sachübertragungen zzgl. eines 1.000 Höchstbetrages von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	\$	Bis zu USD 500 zzgl. eines Höchstbetrages 1.000 von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	£	Bis zu GBP 500 zzgl. eines Höchstbetrages 1.000 von 3 % auf etwaige Baranteile
PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF	bis zu 3 %	bis zu 1 %	\$	Bis zu USD 500 zzgl. eines Höchstbetrages 1.000 von 3 % auf etwaige Baranteile

(f) Aufwandsbegrenzung (einschließlich Verzicht auf Managementgebühr und Rückerstattung)

Die Verwaltungsgesellschaft hat im Rahmen des Managementvertrags zwischen der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft vom 09. Dezember 2010 in der jeweils geltenden Fassung mit der Gesellschaft vereinbart, die gesamten jährlichen Fondsbetriebskosten für sämtliche Klassen eines Fonds zu kontrollieren, indem sie ihre Managementgebühr gänzlich oder teilweise erlässt, bzw. insoweit (und so lange) reduziert oder rückerstattet, wie diese Betriebskosten und anteiligen Verwaltungsrats Honoraren die Summe der Managementgebühr der Klasse des entsprechenden Fonds (vor Anwendung eines möglichen Verzichts auf die Managementgebühr) und der sonstigen von der Anteilsklasse des entsprechenden Fonds getragenen Aufwendungen, die nicht wie oben beschrieben von der Managementgebühr abgedeckt sind (außer anteilige Verwaltungsrats Honorare), zuzüglich 0,0049 % pro Jahr (täglich auf Grundlage des NIW des Fonds berechnet), übersteigen.

In jedem Geltungsmonat des Verwaltungsvertrags kann die Verwaltungsgesellschaft gemäß dem Verwaltungsvertrag von einem Fonds einen Teil der Verwaltungsgebühren, auf die sie in den vorangegangenen 36 Monaten verzichtet, die sie gemindert oder zurückerstattet hat, zurückerlangen

(den „Rückerstattungsbetrag“), sofern ein solcher an die Verwaltungsgesellschaft gezahlter Betrag nicht: 1) höher ist als 0,0049 % per annum der Klasse des jeweiligen durchschnittlichen Nettovermögens des Fonds (auf Tagesbasis berechnet); 2) höher ist als der gesamte Rückerstattungsbetrag; 3) Beträge enthält, die der Verwaltungsgesellschaft bereits zuvor erstattet wurden; bzw. 4) bewirkt, dass eine Klasse eines Fonds eine negative Nettoendite aufweist.

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN UNTERNEHMEN UND PERSONEN

Die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageberater, die Vertriebsstelle und die Verwaltungsratsmitglieder sind nahe stehende Unternehmen bzw. Personen. Die an diese Unternehmen bzw. Personen zu zahlenden Gebühren sind in Anmerkung 9 angegeben.

Der PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF legt zum 30. September 2018 und zum 31. März 2018 in Anteile des PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF an.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Anmerkungen zum Abschluss (Fortsetzung)

In den Berichtszeiträumen zum 30. September 2018 und zum 30. September 2017 führten die nachstehenden Fonds Wertpapierkäufe und -verkäufe mit verbundenen Fonds durch (Beträge in Tausend):

Fonds	30. September 2018		30. September 2017	
	Käufe	Verkäufe	Käufe	Verkäufe
PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF	€ 4.682	€ 4.504	€ 221	€ 4.101
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF	–	–	6.184	–
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	100	–	–	–
PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF	76.787	131.268	67.878	–
PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF	55.167	54.792	70.831	57.444
PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF	2.085	3.065	9.755	17.921
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	5.529	12.979	41.462	3.536
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF	9.735	–	35.068	–
PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF	63.978	102.081	164.099	337.484

In der folgenden Tabelle sind die im Umlauf befindlichen Anteile angegeben, die von PIMCO-Fonds gehalten werden: Global Investor Series plc, PIMCO Select Funds plc und PIMCO Cayman Trust, der Gesellschaft zum 30. September 2018 bzw. zum 31. März 2018 nahe stehende Unternehmen:

	30. September 2018 % im Besitz	31. März 2018 % im Besitz
PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF	28,04	28,62
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF	23,46	21,67
PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF	72,33	74,39

11. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN

Transaktionen, die mit der Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle eines OGAW, den Beauftragten oder Unterbeauftragten einer solchen Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle (unter Ausschluss von konzernfremden, von einer Verwahrstelle bestellten Unterverwahrstellen) oder angeschlossenen Unternehmen oder Konzerngesellschaften einer solchen Verwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle oder von entsprechenden Beauftragten oder Unterbeauftragten („verbundene Parteien“) durchgeführt werden, müssen zu üblichen Konditionen nach dem Fremdvergleichsgrundsatz und nur dann durchgeführt werden, wenn sie im besten Interesse der Anteilhaber liegen. Der Verwaltungsrat hat sich vergewissert, dass (durch schriftliche Verfahren belegte) Vorkehrungen getroffen wurden, um sicherzustellen, dass Transaktionen mit verbundenen Personen wie vorstehend beschrieben ausgeführt werden und dass die entsprechenden Vorgaben im Berichtszeitraum eingehalten wurden.

12. WECHSELKURSE

Für die Zwecke der Zusammenfassung der Abschlüsse der Fonds zur Ermittlung der Zahlen der Gesellschaft (wie nach irischem Unternehmensrecht erforderlich) sind die Beträge in der Vermögensaufstellung zu dem am 30. September 2018 gültigen Wechselkurs von US-Dollar in Euro (USD/EUR 0,86096) (31. März 2018: USD/EUR 0,81311) und von GBP in Euro (GBP/EUR 1,12273) (31. März 2018: GBP/EUR 1,14063) umgerechnet worden. Die Beträge in der Gewinn- und Verlustrechnung und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens wurden zu einem durchschnittlichen Wechselkurs für den Berichtszeitraum zum 30. September 2018 von US-Dollar in Euro (USD/EUR 0,84988) (30. September 2017: USD/EUR 0,87922) und von britischen Pfund in Euro (GBP/EUR 1,13114) (30. September 2017: GBP/EUR 1,14014) umgerechnet.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Anmerkungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Die folgenden Tabellen geben die zum 30. September 2018 und zum 31. März 2018 verwendeten Wechselkurse zur Umrechnung der Eurosalen an. Sie wurden ebenfalls zur Umrechnung der Anlagen und sonstigen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten herangezogen, die auf andere Währungen als den Euro lauten:

Fremdwährungen	30. September 2018 Darstellungswährung		
	EUR	GBP	USD
ARS	-	-	40,77500
AUD	1,60528	-	1,38207
BRL	-	-	3,99355
CAD	-	1,68561	-
CHF	1,13455	1,27380	0,97680
CLP	-	-	659,60000
CNH	-	-	6,87540
CNY	-	-	6,88060
COP	-	-	2.969,39000
CZK	25,78151	-	-
DKK	7,45723	-	-
EGP	-	-	17,92000
EUR (oder €)	1,00000	1,12273	0,86096
GBP (oder £)	0,89069	1,00000	0,76684
IDR	-	-	14.901,50000
INR	-	-	72,49000
JPY (oder ¥)	131,92893	148,12047	113,58500
MXN	21,71917	-	18,69925
MYR	-	-	4,13850
PEN	-	-	3,29865
PHP	-	-	54,03000
PLN	-	-	3,68610
RUB	-	-	65,49505
SEK	10,32945	11,59717	-
SGD	-	-	1,36635
THB	-	-	32,34000
TRY	-	-	6,00730
USD (oder \$)	1,16150	1,30405	1,00000
ZAR	-	-	14,15125

13. FINANZRISIKEN

Durch ihre Aktivitäten sind die Fonds verschiedenen finanziellen Risiken ausgesetzt, z. B. dem Marktrisiko (einschließlich Preisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), dem Kreditrisiko und dem Liquiditätsrisiko. Der allgemeine Risikomanagementprozess für die Fonds konzentriert sich auf die Unvorhersehbarkeit der Finanzmärkte und versucht, potenziell nachteilige Effekte auf die finanzielle Entwicklung der Fonds zu minimieren.

Die Zielsetzungen und Richtlinien des Finanzrisikomanagements der Gesellschaft entsprechen auch weiterhin denjenigen, die im geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft angegeben sind.

Fremdwährungen	31. März 2018 Darstellungswährung		
	EUR	GBP	USD
ARS	-	-	20,13200
AUD	1,60335	-	1,30370
BRL	-	-	3,32360
CAD	-	1,80856	-
CHF	1,17770	1,34332	0,95760
CLP	-	-	603,56500
CNH	-	-	6,28405
CNY	-	-	6,29170
COP	-	-	2.793,10000
CZK	25,38497	-	-
DKK	7,45400	-	-
EGP	-	-	-
EUR (oder €)	1,00000	1,14063	0,81311
GBP (oder £)	0,87671	1,00000	0,71286
IDR	-	-	13.767,50000
INR	-	-	65,22170
JPY (oder ¥)	130,79459	149,18778	106,35000
MXN	22,44907	-	18,25350
MYR	-	-	3,86800
PEN	-	-	-
PHP	-	-	52,17750
PLN	-	-	3,42530
RUB	-	-	57,50000
SEK	10,29975	11,74817	-
SGD	-	-	1,31130
THB	-	-	31,27000
TRY	-	-	3,96140
USD (oder \$)	1,22985	1,40280	1,00000
ZAR	-	-	11,84875

14. GRUNDKAPITAL

(a) Genehmigtes Kapital

Das genehmigte Grundkapital der Gesellschaft wird repräsentiert durch 2 rückkaufbare, nicht gewinnberechtignte Anteile ohne Nennwert sowie 500.000.000.000 gewinnberechtignte Anteile ohne Nennwert, die als nicht klassifizierte Anteile ausgewiesen werden

(b) Zeichneranteile

Die Zeichneranteile zählen nicht zum Nettoinventarwert der Gesellschaft und werden daher nur in dieser Anmerkung im Anhang des Abschlusses angegeben. Diese Offenlegung spiegelt nach Ansicht des Verwaltungsrats das Wesen der Geschäftstätigkeit der Gesellschaft als Investmentfonds wider.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Anmerkungen zum Abschluss (Fortsetzung)

(c) Rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile

Das Kapital aus ausgegebenen rückkaufbaren, gewinnberechtigten Anteilen entspricht zu jedem Zeitpunkt dem Nettoinventarwert der Fonds. Rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile sind auf Wunsch der Anteilsinhaber zurückzunehmen und werden als finanzielle Verbindlichkeiten ausgewiesen.

15. NETTOINVENTARWERT

Das den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen jedes Fonds, die ausgegebenen und im Umlauf befindlichen Anteile und der Nettoinventarwert je Anteil für die letzten drei Berichtszeiträume stellt sich wie folgt dar (Beträge in Tsd., außer Angaben je Anteil). Das Nettovermögen geteilt durch die

	PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF		
	30. September 2018	31. März 2018	31. März 2017
Nettovermögen	€ 112.340	€ 170.619	€ 212.827
Ausschüttende EUR-Klasse	€ 112.340	€ 170.619	€ 212.827
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	1.025	1.550	1.959
NIW je Anteil	€ 109,64	€ 110,11	€ 108,66

	PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF		
	30. September 2018	31. März 2018	31. März 2017
Nettovermögen	\$ 254.395	\$ 328.255	\$ 175.446
Thesaurierende USD-Klasse	\$ 161.280	\$ 219.047	\$ 124.153
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	1.730	2.069	1.282
NIW je Anteil	\$ 93,22	\$ 105,90	\$ 96,88
Ausschüttende USD-Klasse	\$ 93.115	\$ 109.208	\$ 51.293
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	1.280	1.286	625
NIW je Anteil	\$ 72,77	\$ 84,90	\$ 82,10

	PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF		
	30. September 2018	31. März 2018	31. März 2017
Nettovermögen	€ 62.419	€ 24.962	-
Thesaurierende EUR-Klasse	€ 27.800	€ 10.988	-
Ausgegebene Anteile	2.785	1.097	-
NIW je Anteil	€ 9,98	€ 10,01	-
Ausschüttende EUR-Klasse	€ 34.619	€ 13.974	-
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	3.517	1.403	-
NIW je Anteil	€ 9,84	€ 9,96	-

	PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF		
	30. September 2018	31. März 2018	31. März 2017
Nettovermögen	€ 2.687.319	€ 2.833.979	€ 2.307.386
Thesaurierende EUR-Klasse	€ 252.166	€ 166.072	€ 29.648
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	2.554	1.670	297
NIW je Anteil	€ 98,74	€ 99,48	€ 99,86
Ausschüttende EUR-Klasse	€ 2.435.153	€ 2.667.907	€ 2.277.738
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	24.225	26.342	22.400
NIW je Anteil	€ 100,52	€ 101,28	€ 101,69

	PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF		
	30. September 2018	31. März 2018	31. März 2017
Nettovermögen	€ 256.414	€ 272.618	€ 292.366
Ausschüttende EUR-Klasse	€ 256.414	€ 272.618	€ 292.366
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	2.485	2.633	2.828
NIW je Anteil	€ 103,19	€ 103,55	€ 103,38

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Anmerkungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF		
	30. September 2018	31. März 2018	31. März 2017
Nettovermögen	\$ 210.940	\$ 201.836	\$ 195.781
(Abgesicherte) thesaurierende CHF-Klasse	CHF 24.448	CHF 29.442	CHF 12.054
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	244	291	118
NIW je Anteil	CHF 100,17	CHF 101,16	CHF 102,10
Ausschüttende USD-Klasse	\$ 185.911	\$ 171.090	\$ 183.738
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	1.850	1.690	1.803
NIW je Anteil	\$ 100,49	\$ 101,24	\$ 101,91

	PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF		
	30. September 2018	31. März 2018	31. März 2017
Nettovermögen	\$ 1.364.447	\$ 1.161.110	\$ 1.095.014
(Abgesicherte) thesaurierende CHF-Klasse	CHF 41.247	CHF 33.493	CHF 29.428
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	381	314	279
NIW je Anteil	CHF 108,18	CHF 106,43	CHF 105,46
(Abgesicherte) thesaurierende EUR-Klasse	€ 46.020	€ 23.860	€ -
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	454	240	-
NIW je Anteil	€ 101,28	€ 99,44	€ -
(Abgesicherte) ausschüttende EUR-Klasse	€ 652.683	€ 498.910	€ 505.047
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	7.191	5.462	5.329
NIW je Anteil	€ 90,77	€ 91,33	€ 94,77
(Abgesicherte) ausschüttende GBP-Klasse	£ 34.640	£ 28.146	£ 14.765
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	3.380	2.745	1.400
NIW je Anteil	£ 10,25	£ 10,25	£ 10,55
Thesaurierende USD-Klasse	\$ 127.066	\$ 68.710	\$ 70.341
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	1.085	606	642
NIW je Anteil	\$ 117,09	\$ 113,44	\$ 109,55
Ausschüttende USD-Klasse	\$ 338.439	\$ 375.011	\$ 436.636
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	3.336	3.723	4.265
NIW je Anteil	\$ 101,45	\$ 100,73	\$ 102,37

	PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF		
	30. September 2018	31. März 2018	31. März 2017
Nettovermögen	£ 283.805	£ 287.120	£ 190.318
Ausschüttende GBP-Klasse	£ 283.805	£ 287.120	£ 190.318
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	2.788	2.821	1.870
NIW je Anteil	£ 101,80	£ 101,77	£ 101,75

	PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF		
	30. September 2018	31. März 2018	31. März 2017
Nettovermögen	\$ 2.864.325	\$ 3.018.515	\$ 2.103.937
Ausschüttende USD-Klasse	\$ 2.864.325	\$ 3.018.515	\$ 2.103.937
Ausgegebene und im Umlauf befindliche Anteile	28.218	29.745	20.723
NIW je Anteil	\$ 101,51	\$ 101,48	\$ 101,53

16. VERGÜTUNG

Die Vergütungspolitik der Gesellschaft entspricht den geltenden OGAW-Vorschriften und ist im Verkaufsprospekt zusammengefasst.

Einzelheiten zur Vergütungspolitik der Gesellschaft sowie damit verbundene finanzielle Angaben werden im Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. März 2019 enthalten sein.

17. REGULATORISCHE ANGELEGENHEITEN UND RECHTSSTREITIGKEITEN

Die Gesellschaft ist an keinen wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schiedsverfahren als Beklagter benannt, und ihm sind etwaige solche gegen ihn bestehenden oder drohenden wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schadensersatzforderungen nicht bekannt.

Vorgenanntes ist lediglich zum Datum dieses Berichts gültig.

18. VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Die Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTR“) führt Berichts- und Angabepflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions, SFTs) und Total Return Swaps ein. SFTs sind gemäß Artikel 3(11) der SFTR ausdrücklich folgendermaßen definiert:

- Pensionsgeschäfte / umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Ver- oder Entleihe von Wertpapieren oder Rohstoffen
- Buy-Sellback- oder Sale-Buyback-Geschäfte
- Lombardgeschäfte

(a) Globale Daten und Konzentration von SFT-Kontrahenten

Zum 30. September 2018 hielten die Fonds die folgenden Arten von SFTs und Total Return Swaps:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Anmerkungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Der beizulegende Zeitwert der Vermögenswerte/(Verbindlichkeiten) gestaltete sich zum 30. September 2018 über alle SFTs hinweg gruppiert nach Arten von SFTs und den zehn größten Kontrahenten wie folgt. Wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind sämtliche Kontrahenten aufgeführt.

Fonds	Beizulegender Zeitwert (in Tsd.)	% des Nettvermögens
PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF		
Pensionsgeschäfte		
IND	€ 3.200	2,85
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 3.332	1,31
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	€ (196)	(0,31)
PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 2.000	0,07
COM	37.200	1,39
SSB	191	0,01
Insgesamt	39.391	1,47
PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF		
Pensionsgeschäfte		
SSB	€ 115	0,04
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(6.331)	(2,46)
IND	(2.038)	(0,80)
Insgesamt	(8.369)	(3,26)
PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF		
Pensionsgeschäfte		
TDM	\$ 3.100	1,47
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(7.472)	(3,54)
GRE	(31.860)	(15,11)
Insgesamt	(39.332)	(18,65)
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 57.000	4,18
JPS	50.000	3,66
SSB	3.917	0,29
Insgesamt	110.917	8,13
Total Return Swaps		
BNP	274	0,02
GST	85	0,01
JPM	426	0,03
Insgesamt	785	0,06
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF		
Pensionsgeschäfte		
BRC	£ 4.500	1,59
SSB	56	0,02
Insgesamt	4.556	1,61
PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 19.331	0,67
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(12.280)	(0,43)
IND	(17.927)	(0,62)
UBS	(39.771)	(1,39)
Insgesamt	(69.978)	(2,44)

Zum 31. März 2018 hielten die Fonds die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sale-Buyback-Finanzierungsgeschäfte

Der beizulegende Zeitwert der Vermögenswerte/(Verbindlichkeiten) gestaltete sich zum 31. März 2018 über alle SFTs hinweg gruppiert nach Arten von SFTs und den zehn größten Kontrahenten wie folgt. Wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind sämtliche Kontrahenten aufgeführt.

Fonds	Beizulegender Zeitwert (in Tsd.)	% des Nettvermögens
PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF		
Pensionsgeschäfte		
IND	€ 4.100	2,40
SSB	9	0,01
Insgesamt	4.109	2,41
PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF		
Pensionsgeschäfte		
IND	€ 58.000	2,05
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
JML	(525)	(0,02)
PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF		
Pensionsgeschäfte		
SSB	€ 120	0,05
PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ (11.208)	(5,55)
GRE	(29.868)	(14,80)
Insgesamt	(41.076)	(20,35)
Sale-Buyback-Finanzierungsgeschäfte		
BCY	(2.482)	(1,23)
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 43.300	3,73
JPS	75.500	6,50
SSB	2.371	0,20
Insgesamt	121.171	10,43
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF		
Pensionsgeschäfte		
BRC	£ 19.000	6,62
PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 253	0,01
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(22.832)	(0,76)
RBC	(149.142)	(4,94)
Insgesamt	(171.974)	(5,70)

(b) Sicherheiten

i) Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Die zum 30. September 2018 und zum 31. März 2018 erhaltenen Sicherheiten werden im Depotbanknetz von State Street Bank and Trust im Auftrag der Verwahrstelle gehalten.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Anmerkungen zum Abschluss (Fortsetzung)

ii) Konzentrationsdaten:

Die zehn größten Emittenten für die im Rahmen aller SFTs zum 30. September 2018 erhaltenen Wertpapiersicherheiten gestalteten sich wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind sämtliche Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Fonds	Emittent der Sicherheit	Zeitwert (in Tsd.)
PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF	Regierung Schwedens	€ 3.198
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF	Regierung der USA	\$ 3.403
PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF	FMS Wertmanagement	€ 37.456
	Regierung Deutschlands	2.043
	Regierung der USA	198
PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF	Regierung der USA	118
PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF	Regierung der USA	\$ 3.192
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	Regierung der USA	113.244
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF	Albion Capital Corp.	£ 2.899
	Regierung des Vereinigten Königreichs	1.606
	Regierung der USA	60
PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF	Regierung der USA	\$ 19.721

Die zehn größten Emittenten für die im Rahmen aller SFTs zum 31. März 2018 erhaltenen Wertpapiersicherheiten gestalteten sich wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind sämtliche Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Fonds	Emittent der Sicherheit	Zeitwert (in Tsd.)
PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF	European Investment Bank	\$ 4.087
	Regierung der USA	12
PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF	European Investment Bank	€ 52.025
	UNEDIC	5.775
PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF	Regierung der USA	126
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	Regierung der USA	\$ 123.808
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF	Britischer Gilt	£ 19.643
PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF	Regierung der USA	\$ 261

iii) Aggregierte Transaktionsdaten:

Die aggregierten Transaktionsdaten für im Rahmen sämtlicher SFTs und Total Return Swaps erhaltene Sicherheitenpositionen gestalteten sich zum 30. September 2018 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheit	Art der Sicherheit	Zeitwert (in Tsd.)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abwicklung und Clearing
PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	Sweden Government International Bond	Treasury	€ 3.198	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, bilateral
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 3.403	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral
PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	FMS Wertmanagement	Corporate	€ 37.456	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, bilateral
		Republic of Germany	Treasury	2.043	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	198	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral
PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	118	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral
PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 3.192	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	58.113	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	55.131	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral
	Total Return Swaps	Barsicherheiten	Barmittel	290	-	-	USD	USA	FED, bilateral
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	Albion Capital Corp.	ABCP	£ 2.899	A-1	Weniger als 1 Monat	GBP	Vereinigtes Königreich	FED, bilateral
		Britischer Gilt	Treasury	1.606	AA	Mehr als 1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	FED, bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	60	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral
PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 19.721	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Anmerkungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Die aggregierten Transaktionsdaten für im Rahmen sämtlicher SFTs erhaltene Sicherheitenpositionen gestalteten sich zum 31. März 2018 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheit	Art der Sicherheit	Zeitwert (in Tsd.)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten		Gründungsland des Kontrahenten	Abwicklung und Clearing
PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	European Investment Bank U.S. Treasury Notes	Corporate Treasury	€ 4.087	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, bilateral	
PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	European Investment Bank UNEDIC	Corporate Treasury	52.025	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, bilateral	
PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	5.775	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, bilateral	
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	126	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral	
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds U.S. Treasury Notes	Treasury Treasury	\$ 44.242	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral	
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	79.566	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral	
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	Britischer Gilt	Treasury	£ 19.643	AAA	Mehr als 1 Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	FED, bilateral	
PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 261	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, bilateral	

Der beizulegende Zeitwert der Sicherheiten aus Pensionsgeschäften umfasst keine aufgelaufenen Zinsen.

Rahmenterminverträge decken eine Kombination von Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäften, Sale-Buyback-Finanzierungsgeschäften und sonstigen oben nicht enthaltenen Finanzierungsgeschäften ab. Der Gesamtbetrag der für alle im Rahmen dieser Vereinbarungen abgeschlossenen Geschäfte zum 30. September 2018 und zum 31. März 2018 erhaltenen Sicherheiten ist in den obigen Angaben enthalten. Es ist nicht möglich, die Sicherheiten für die einzelnen SFT jeweils getrennt zu analysieren.

ISDA-Vereinbarungen decken eine Kombination von Swap-Kontrakten ab, und der Gesamtbetrag der Sicherheiten für diese Vereinbarungen ist in den obigen Angaben enthalten.

Ein Teil der angegebenen Sicherheiten bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

(c) Renditen/Kosten

Die nachfolgenden Tabellen enthalten detaillierte Daten über die Renditen und die Kosten für jede Art von SFT während der Berichtszeiträume zum 30. September 2018 und zum 30. September 2017. Die Beträge sind in der Basiswährung des Fonds angegeben.

Berichtszeitraum zum 30. September 2018

An Fonds:

An Fonds:	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte		Sale-Buyback-Finanzierungsgeschäfte	
	Renditen (in Tsd.)	Kosten (in Tsd.)	Renditen (in Tsd.)	Kosten (in Tsd.)	Renditen (in Tsd.)	Kosten (in Tsd.)	Renditen (in Tsd.)	Kosten (in Tsd.)
PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF	€ 2	€ 5	€ -	€ -	€ -	€ -	€ -	€ -
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF	\$ 6	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	€ -	€ -	€ 1	€ -	€ -	€ -	€ -	€ -
PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF	1	239	1	-	-	-	-	-
PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF	1	2	4	-	-	-	-	-
PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF	\$ 8	\$ -	\$ -	\$ 230	\$ 4	\$ -	\$ -	\$ 276
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	712	-	-	-	-	-	-	-
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF	£ 74	£ -	£ -	£ -	£ -	£ -	£ -	£ -
PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF	\$ 169	\$ -	\$ -	\$ 1.232	\$ 3	\$ -	\$ -	\$ 343

iv) Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Als Sicherheiten erhaltene Wertpapiere wurden zum 30. September 2018 bzw. zum 31. März 2018 nicht wiederverwendet.

Barsicherheiten werden in Treuhandkonten für die Fonds empfangen und somit nicht speziell verfolgt, um zu bestimmen, ob sie wiederverwendet werden. Somit lässt sich der Umfang der wiederverwendeten Barsicherheiten nicht verlässlich verifizieren.

Die zum 30. September 2018 und zum 31. März 2018 erhaltenen Sicherheiten werden im Depotbanknetz von State Street Bank and Trust gehalten.

v) Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Die von den Fonds zum 30. September 2018 und zum 31. März 2018 verpfändeten Sicherheiten werden von den Kontrahenten in Konten gehalten, bei denen es sich nicht um getrennt geführte Konten oder Sammelkonten handelt.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Anmerkungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Berichtszeitraum zum 30. September 2017

An Fonds:

PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF
PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF
PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF
PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF
PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF
PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF

Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte		Sale-Buyback-Finanzierungsgeschäfte	
Renditen (in Tsd.)	Kosten (in Tsd.)	Renditen (in Tsd.)	Kosten (in Tsd.)	Renditen (in Tsd.)	Kosten (in Tsd.)	Renditen (in Tsd.)	Kosten (in Tsd.)
€ -	€ 2	€ -	€ -	€ -	€ -	€ -	€ -
\$ 1	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
€ -	€ 214	€ -	€ -	€ -	€ -	€ -	€ -
5	4	7	-	-	-	-	-
\$ 2	\$ -	\$ -	\$ 256	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 168
590	-	-	-	-	-	-	-
£ 42	£ -	£ -	£ -	£ -	£ -	£ -	£ -
\$ 243	\$ -	\$ -	\$ 18	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -

Sämtliche Renditen aus SFT-Derivattransaktionen fallen dem Fonds an und fallen nicht unter Ertragsteilungsvereinbarungen mit der Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft oder sonstigen Dritten.

Die Transaktionskosten von Total Return Swaps lassen sich nicht separat identifizieren. Für diese Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und bilden Teil des Bruttoanlageergebnisses jedes Fonds.

Renditen werden als realisierte Gewinne und Veränderungen der nicht realisierten Gewinne auf den Swap-Kontrakt während des Berichtszeitraums identifiziert und sind in der Gewinn- und Verlustrechnung im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten und in der Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus derivativen Finanzinstrumenten ausgewiesen.

19. TRACKING ERROR

In der folgenden Tabelle ist der Tracking Error für jeden passiven Fonds in den Berichtszeiträumen zum 30. September 2018 und 30. September 2017 ausgewiesen. Der Tracking Error wird in den Richtlinien der Europäischen Wertpapieraufsichtsbehörde („ESMA“) als die Volatilität der Differenz zwischen der Jahresrendite des indexabbildenden OGAW und der Jahresrendite des Index oder der Indizes, die abgebildet werden, definiert. Jeder dieser Fonds entwickelte sich innerhalb des angestrebten Tracking Error.

Fonds	Tracking Error: 30. September 2018	Tracking Error: 30. September 2017
PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF	0,76 %	0,23 %
PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	0,25 %	-
PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF	0,42 %	0,29 %

20. WESENTLICHE EREIGNISSE

Michael J. Meagher trat mit Wirkung vom 24. Juli 2018 als Verwaltungsratsmitglied zurück.

Außer den vorstehend aufgeführten gab es keine wesentlichen Ereignisse während des Berichtszeitraums.

21. EREIGNISSE NACH ABLAUF DES BERICHTSZEITRAUMS

Der Verkaufsprospekt der Gesellschaft wurde konsolidiert und am 1. Oktober 2018 neu herausgegeben.

Außer den vorstehend aufgeführten gab es keine weiteren Ereignisse nach dem Ende des Berichtszeitraums.

22. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES

Der Abschluss wurde vom Verwaltungsrat am 30. Oktober 2018 genehmigt.

Wesentliche Veränderungen der Portfoliozusammensetzung

PIMCO Covered Bond Source UCITS ETF

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ERLÖSE (in Tsd.)
KÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018			VERKÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018		
Sveriges Sakerstallda Obligationer AB			Sveriges Sakerstallda Obligationer AB		
2,000 % due 17.06.2026	SEK 328.000	€ 33.199	2,000 % due 17.06.2026	SEK 377.000	€ 38.045
Nordea Hypotek AB			Nordea Hypotek AB		
1,250 % due 20.09.2023	234.000	23.247	1,250 % due 20.09.2023	257.000	25.368
Realkredit Danmark A/S			Nordea Kredit Realkreditaktieselskab		
2,500 % due 01.10.2047	DKK 127.000	17.639	2,000 % due 01.10.2050	DKK 153.300	20.148
Danske Hypotek AB			Nordea Kredit Realkreditaktieselskab		
1,000 % due 20.12.2023	SEK 176.000	17.088	2,000 % due 01.10.2050	133.693	17.810
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			Realkredit Danmark A/S		
2,000 % due 01.10.2050	DKK 121.300	15.983	2,500 % due 01.10.2047	127.669	17.704
ING Bank NV			Danske Hypotek AB		
2,625 % due 05.12.2022	\$ 19.100	15.924	1,000 % due 20.12.2023	SEK 176.000	17.154
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			Spain Government International Bond		
0,650 % due 15.10.2023	€ 17.000	15.819	2,700 % due 31.10.2048	€ 15.600	16.531
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			Stadshypotek AB		
2,000 % due 01.10.2050	DKK 114.000	15.170	1,500 % due 01.06.2023	SEK 158.000	15.885
Spain Government International Bond			Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		
2,700 % due 31.10.2048	€ 13.700	14.524	0,650 % due 15.10.2023	€ 17.000	15.780
ABN AMRO Bank NV			Cajamar Caja Rural SCC		
1,450 % due 12.04.2038	14.600	14.464	1,250 % due 26.01.2022	14.300	14.688
Nykredit Realkredit A/S			Santander UK PLC		
2,000 % due 01.10.2050	DKK 107.101	14.102	5,250 % due 16.02.2029	£ 9.865	14.640
Republic of Germany			ABN AMRO Bank NV		
0,000 % due 14.04.2023	€ 13.500	13.534	1,450 % due 12.04.2038	€ 14.600	14.390
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA			Nykredit Realkredit A/S		
2,125 % due 26.11.2025	11.850	12.532	2,000 % due 01.10.2050	DKK 107.099	14.079
Cie de Financement Foncier S.A.			Republic of Germany		
0,750 % due 29.05.2026	11.500	11.578	0,000 % due 14.04.2023	€ 13.500	13.530
Nykredit Realkredit A/S			ING Bank NV		
2,000 % due 01.10.2050	DKK 86.000	11.452	2,625 % due 05.12.2022	\$ 15.300	12.825
Swedbank Hypotek AB			Banca Monte dei Paschi di Siena SpA		
1,000 % due 15.03.2023	SEK 115.000	11.430	2,125 % due 26.11.2025	€ 11.850	12.480
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			Nationwide Building Society		
1,450 % due 15.05.2025	€ 11.500	11.420	2,250 % due 25.06.2029	11.115	12.403
Banco Popular Espanol S.A.			Cie de Financement Foncier S.A.		
0,750 % due 29.09.2020	10.800	10.990	0,750 % due 29.05.2026	11.500	11.589
Stadshypotek AB			Nykredit Realkredit A/S		
1,500 % due 01.06.2023	SEK 108.000	10.837	2,000 % due 01.10.2050	DKK 86.000	11.486
DNB Boligkreditt A/S			Realkredit Danmark A/S		
0,375 % due 20.11.2024	€ 10.950	10.796	2,000 % due 01.10.2050	83.688	11.182
European Financial Stability Facility			Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		
1,375 % due 31.05.2047	10.800	10.197	1,450 % due 15.05.2025	€ 11.500	11.153
Ireland Government Bond			Banco Popular Espanol S.A.		
0,900 % due 15.05.2028	10.100	10.117	0,750 % due 29.09.2020	10.800	10.997
BRFKredit A/S			DNB Boligkreditt A/S		
2,000 % due 01.10.2050	DKK 74.000	9.822	0,375 % due 20.11.2024	10.950	10.851
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA			Credit Suisse AG		
1,375 % due 10.11.2025	€ 9.500	9.660	0,750 % due 17.09.2021	10.600	10.836
Programa Cedula TDA Fondo de Titulizacion de Activos			Programa Cedula TDA Fondo de Titulizacion de Activos		
4,250 % due 10.04.2031	7.000	9.098	4,250 % due 10.04.2031	8.200	10.631
			European Financial Stability Facility		
			1,375 % due 31.05.2047	10.800	10.298
			Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		
			1,600 % due 01.06.2026	10.100	10.114
			Ireland Government Bond		
			0,900 % due 15.05.2028	10.100	10.092
			BRFKredit A/S		
			2,000 % due 01.10.2050	DKK 75.869	10.038

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

Wesentliche Veränderungen der Portfoliozusammensetzung

PIMCO Emerging Markets Advantage Local Bond Index Source UCITS ETF

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ERLÖSE (in Tsd.)
KÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018			VERKÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018		
U.S. Treasury Bills			U.S. Treasury Bills		
0,000 % due 05.07.2018	\$ 57.107	\$ 56.917	0,000 % due 05.07.2018	\$ 57.107	\$ 56.997
U.S. Treasury Bills			U.S. Treasury Bills		
0,000 % due 03.05.2018	34.800	34.757	0,000 % due 03.05.2018	38.700	38.685
Turkey Government International Bond			U.S. Treasury Bills		
11,100 % due 15.05.2019	TRY 117.200	23.133	0,000 % due 12.04.2018	32.300	32.291
Mexico Government International Bond			Mexico Government International Bond		
5,000 % due 11.12.2019	MXN 435.000	22.306	8,500 % due 13.12.2018	MXN 446.000	23.724
Mexico Government International Bond			U.S. Treasury Bills		
8,500 % due 13.12.2018	403.000	21.113	0,000 % due 04.10.2018	\$ 13.695	13.671
U.S. Treasury Bills			Brazil Notas do Tesouro Nacional		
0,000 % due 19.07.2018	\$ 19.100	19.015	10,000 % due 01.01.2023	BRL 48.791	13.127
Thailand Government International Bond			U.S. Treasury Bills		
5,625 % due 12.01.2019	THB 568.900	18.372	0,000 % due 27.09.2018	\$ 13.000	12.959
Brazil Letras do Tesouro Nacional			Thailand Government International Bond		
0,000 % due 01.04.2019	BRL 74.000	17.513	5,625 % due 12.01.2019	THB 343.800	11.035
Russia Government International Bond			U.S. Treasury Bills		
6,700 % due 15.05.2019	RUB 951.600	14.305	0,000 % due 19.07.2018	\$ 10.200	10.192
U.S. Treasury Bills			South Africa Government International Bond		
0,000 % due 04.10.2018	\$ 14.000	13.963	8,000 % due 21.12.2018	ZAR 131.500	9.175
Brazil Notas do Tesouro Nacional			U.S. Treasury Bills		
10,000 % due 01.01.2023	BRL 53.500	13.380	0,000 % due 18.10.2018	\$ 8.723	8.699
U.S. Treasury Bills			Brazil Government International Bond		
0,000 % due 27.09.2018	\$ 13.000	12.938	10,250 % due 10.01.2028	BRL 28.200	8.690
U.S. Treasury Bills			Russia Government International Bond		
0,000 % due 09.08.2018	11.900	11.846	6,700 % due 15.05.2019	RUB 525.000	7.672
South Africa Government International Bond			Russia Government International Bond		
7,250 % due 15.01.2020	ZAR 148.000	10.234	7,500 % due 18.08.2021	463.900	7.617
Brazil Government International Bond			U.S. Treasury Bills		
8,500 % due 05.01.2024	BRL 33.200	9.922	0,000 % due 11.10.2018	\$ 7.000	6.980
U.S. Treasury Bills			U.S. Treasury Bills		
0,000 % due 18.10.2018	\$ 9.300	9.254	0,000 % due 24.05.2018	6.837	6.831
Brazil Government International Bond			Mexico Government International Bond		
10,250 % due 10.01.2028	BRL 26.200	8.159	8,000 % due 11.06.2020	MXN 118.056	6.238
South Africa Government International Bond			Mexico Government International Bond		
8,000 % due 21.12.2018	ZAR 117.000	8.035	5,000 % due 11.12.2019	119.000	6.028
U.S. Treasury Bills			U.S. Treasury Bills		
0,000 % due 24.05.2018	\$ 7.600	7.589	0,000 % due 25.10.2018	\$ 5.782	5.770
U.S. Treasury Bills			Turkey Government International Bond		
0,000 % due 11.10.2018	7.000	6.973	11,100 % due 15.05.2019	TRY 25.700	5.402
Colombia Government International Bond			Brazil Letras do Tesouro Nacional		
7,750 % due 14.04.2021	COP 18.878.000	6.699	0,000 % due 01.01.2019	BRL 22.100	5.326
U.S. Treasury Bills			U.S. Treasury Bills		
0,000 % due 25.10.2018	\$ 6.000	5.970	0,000 % due 14.06.2018	\$ 5.250	5.247
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos			Brazil Letras do Tesouro Nacional		
6,000 % due 01.01.2020	CLP 3.800.000	5.921	0,000 % due 01.07.2021	BRL 26.600	5.215
U.S. Treasury Bills			Brazil Letras do Tesouro Nacional		
0,000 % due 14.06.2018	\$ 5.700	5.693	0,000 % due 01.07.2020	24.700	5.205
U.S. Treasury Bills			Indonesia Government International Bond		
0,000 % due 14.06.2018	5.250	5.242	7,875 % due 15.04.2019	IDR 71.848.000	4.855
Malaysia Government International Bond			U.S. Treasury Bills		
4,295 % due 31.10.2018	MYR 21.000	5.126	0,000 % due 14.06.2018	\$ 4.507	4.506
			Brazil Notas do Tesouro Nacional		
			10,000 % due 01.01.2021	BRL 13.958	4.314
			U.S. Treasury Bills		
			0,000 % due 09.08.2018	\$ 4.200	4.196
			U.S. Treasury Bills		
			0,000 % due 08.11.2018	4.000	3.990

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

Wesentliche Veränderungen der Portfoliozusammensetzung

PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF (Fortsetzung) 30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ERLÖSE (in Tsd.)
KÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018			VERKÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018		
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 5,000 % due 15.11.2020	€ 1.224	€ 1.315	Tesco Corporate Treasury Services PLC 1,375 % due 01.07.2019	€ 800	€ 809
Loxam S.A.S. 3,500 % due 15.04.2022	900	929	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT 0,000 % due 28.09.2018	740	740
Tesco Corporate Treasury Services PLC 1,375 % due 01.07.2019	900	911	Loxam S.A.S. 3,500 % due 15.04.2022	700	726
Merlin Entertainments PLC 2,750 % due 15.03.2022	800	835	METRO AG 1,125 % due 06.03.2023	700	697
Ball Corp. 3,500 % due 15.12.2020	750	808	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 5,000 % due 15.11.2020	600	642
Norddeutsche Landesbank Girozentrale 6,000 % due 29.06.2020	750	807	Iccrea Banca SpA 0,681 % due 01.02.2021	650	630
Bausch Health Cos., Inc. 4,500 % due 15.05.2023	796	766	Ball Corp. 3,500 % due 15.12.2020	550	592
Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT 0,000 % due 28.09.2018	740	741	Casino Guichard Perrachon S.A. 5,976 % due 26.05.2021	500	524
Iccrea Banca SpA 0,681 % due 01.02.2021	750	737	Barry Callebaut Services NV 5,625 % due 15.06.2021	450	516
Unione di Banche Italiane SpA 1,750 % due 12.04.2023	750	710	Stora Enso OYJ 5,500 % due 07.03.2019	500	515
METRO AG 1,125 % due 06.03.2023	700	697	CaixaBank S.A. 2,750 % due 14.07.2028	500	508
Bank of Ireland 10,000 % due 19.12.2022	500	685	Royal Bank of Scotland Group PLC 3,625 % due 25.03.2024	480	489
OTE PLC 4,375 % due 02.12.2019	650	682	Norddeutsche Landesbank Girozentrale 6,000 % due 29.06.2020	450	485
Phoenix PIB Dutch Finance BV 3,125 % due 27.05.2020	650	682	CNH Industrial Finance Europe S.A. 2,750 % due 18.03.2019	440	449
Banca IFIS SpA 2,000 % due 24.04.2023	700	672	K+S AG 4,125 % due 06.12.2021	400	440
Huntsman International LLC 5,125 % due 15.04.2021	600	669	Worldpay Finance PLC 3,750 % due 15.11.2022	400	434
thyssenkrupp AG 2,750 % due 08.03.2021	630	660	ArcelorMittal 3,125 % fällig am 14.01.2022	400	429
MPT Operating Partnership LP 4,000 % due 19.08.2022	600	656	CaixaBank S.A. 3,500 % due 15.02.2027	400	421
Federal-Mogul LLC 4,875 % due 15.04.2022	610	636	Telecom Italia SpA 4,000 % due 21.01.2020	400	421
DKT Finance ApS 7,000 % due 17.06.2023	600	635	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT 0,000 % due 31.10.2018	420	420
			Merlin Entertainments PLC 2,750 % due 15.03.2022	400	418
			Buzzi Unicem SpA 2,125 % due 28.04.2023	400	412
			Banco BPM SpA 2,750 % due 27.07.2020	400	404
			Synlab Bondco PLC 6,625 % due 13.09.2023	400	402
			Huntsman International LLC 5,125 % due 15.04.2021	350	390
			MPT Operating Partnership LP 4,000 % due 19.08.2022	350	384
			Banca IFIS SpA 2,000 % due 24.04.2023	400	378
			Phoenix PIB Dutch Finance BV 3,125 % due 27.05.2020	350	367
			Intesa Sanpaolo SpA 6,625 % due 13.09.2023	300	345
			ContourGlobal Power Holdings S.A. 5,125 % due 15.06.2021	310	318
			Smurfit Kappa Acquisitions ULC 4,125 % due 30.01.2020	300	318
			ArcelorMittal 2,875 % due 06.07.2020	300	315
			thyssenkrupp AG 2,750 % due 08.03.2021	300	314
			Orano S.A. 3,250 % due 04.09.2020	300	314
			Federal-Mogul LLC 4,875 % due 15.04.2022	300	312
			thyssenkrupp AG 3,125 % due 25.10.2019	300	308
			Autostrada Brescia Verona Vicenza Padova SpA 2,375 % due 20.03.2020	300	308
			IPD 3 BV 4,500 % due 15.07.2022	300	307
			Intrum AB 2,750 % due 15.07.2022	300	293

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

Wesentliche Veränderungen der Portfoliozusammensetzung

PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ERLÖSE (in Tsd.)
KÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018			VERKÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018		
European Stability Mechanism Treasury Bills	€ 52.500	€ 52.635	Italy Certificati Di Credito Del Tesoro	€ 64.400	€ 62.970
0,000 % due 24.01.2019			0,532 % due 15.12.2020		
Netherlands Treasury Bills			Netherlands Treasury Bills		
0,000 % due 31.10.2018	52.150	52.277	0,000 % due 31.10.2018	52.150	52.240
Netherlands Government International Bond			Spain Treasury Bills		
1,250 % due 15.01.2019	44.400	44.891	0,000 % due 18.01.2019	48.100	48.214
France Treasury Bills			Italy Treasury Bills		
0,000 % due 04.01.2019	44.400	44.560	0,000 % due 14.01.2019	44.000	43.856
Lansforsakringar Hypotek AB			Telefonica Emisiones S.A.U.		
3,250 % due 16.09.2020	SEK 386.700	39.249	4,710 % due 20.01.2020	13.700	14.632
UBS AG			Thales S.A.		
0,179 % due 23.04.2021	€ 36.000	36.274	0,000 % due 19.04.2020	14.400	14.432
European Stability Mechanism Treasury Bills			AT&T, Inc.		
0,000 % due 04.10.2018	26.200	26.204	0,259 % due 04.06.2019	14.100	14.155
Natwest Markets PLC			Volkswagen Leasing GmbH		
0,081 % due 02.03.2020	25.000	25.070	0,029 % due 06.07.2019	11.300	11.314
Goldman Sachs Group, Inc.			Autonomous Community of Andalusia		
0,131 % due 16.12.2020	25.000	25.041	5,200 % due 15.07.2019	10.093	10.583
AT&T, Inc.			Republic of Germany		
0,081 % due 03.08.2020	20.600	20.641	3,750 % due 04.01.2019	9.200	9.416
Agence Francaise de Developpement			Italy Treasury Bills		
0,000 % due 19.09.2018	17.400	17.402	0,000 % due 14.09.2018	8.020	8.020
Volkswagen Financial Services AG			Europäische Union Bond		
0,029 % due 11.10.2019	16.900	16.939	2,375 % due 04.10.2018	7.500	7.530
QNB Finance Ltd.			Slovenia Government International Bond		
3,663 % due 31.05.2021	\$ 18.300	15.519	4,125 % due 18.02.2019	\$ 9.098	7.526
Bank of China Ltd.			Kingdom of Belgium Treasury Bills		
0,179 % due 17.04.2021	€ 14.500	14.500	0,000 % due 13.09.2018	€ 7.100	7.103
Thales S.A.			Asset-Backed European Securitisation Transaction		
0,000 % due 19.04.2020	14.400	14.467	Fifteen SRL		
Toyota Motor Finance Netherlands BV			0,030 % due 15.04.2031	7.000	6.980
0,029 % due 27.04.2020	14.200	14.269	Madrilena Red de Gas Finance BV		
Deutsche Telekom International Finance BV			3,779 % due 11.09.2018	6.300	6.313
0,029 % due 03.04.2020	14.000	14.063	FCE Bank PLC		
CVS Health Corp.			1,875 % due 18.04.2019	6.200	6.288
2,957 % due 09.03.2020	\$ 16.300	14.047	Intesa Sanpaolo SpA		
Volvo Treasury AB			2,750 % due 20.03.2020	5.600	5.782
0,031 % due 10.08.2020	€ 13.900	13.927	Sunrise SPV SRL		
AbbVie, Inc.			0,029 % due 27.11.2041	5.400	5.402
0,375 % due 18.11.2019	12.200	12.267	Autonomous Community of Madrid		
AP Moller - Maersk A/S			2,875 % due 06.04.2019	4.330	4.414
3,375 % due 28.08.2019	11.617	12.056	Netherlands Government International Bond		
Deutsche Bank AG			1,250 % due 15.01.2019	4.200	4.242
0,000 % due 07.12.2020	12.000	11.845	Abanca Corp. Bancaria S.A.		
INEOS Grangemouth PLC			4,375 % due 23.01.2019	4.000	4.067
0,750 % due 30.07.2019	11.310	11.455	Niederländischer Schatzwechsel		
United Technologies Corp.			0,000 % due 27.09.2018	4.000	4.002
0,000 % due 18.05.2020	11.000	11.028			
Driver Italia One SRL					
0,029 % due 21.04.2029	10.900	10.920			
Mylan NV					
0,181 % due 24.05.2020	10.800	10.832			
Autonomous Community of Andalusia					
5,200 % due 15.07.2019	10.093	10.621			
Cars Alliance Auto Loans France					
0,029 % due 21.10.2029	9.600	9.656			
Philip Morris International, Inc.					
1,750 % due 19.03.2020	9.100	9.375			
BAT Capital Corp.					
0,181 % due 16.08.2021	9.300	9.343			
GE Capital European Funding Unlimited Co.					
0,059 % due 21.01.2020	8.900	8.932			

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

Wesentliche Veränderungen der Portfoliozusammensetzung PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF

30. September 2018

BESCHREIBUNG	ANTEILE	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG	ANTEILE	ERLÖSE (in Tsd.)
KÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018			VERKÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018		
PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)	529.000	€ 53.405	PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)	507.300	51.215
	NENNWERT (in Tsd.)			NENNWERT (in Tsd.)	
BAT Capital Corp. 0,181 % due 16.08.2021	€ 4.100	4.107	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,750 % due 01.08.2021	€ 7.200	8.019
Philip Morris International, Inc. 1,750 % due 19.03.2020	3.500	3.619	AT&T, Inc. 0,259 % due 04.06.2019	3.600	3.614
AT&T, Inc. 0,081 % due 03.08.2020	3.600	3.607	Dexia Credit Local S.A. 0,200 % due 16.03.2021	3.500	3.530
Citigroup, Inc. 0,750 % due 26.10.2023	2.900	2.867	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,950 % due 15.03.2023	3.200	3.233
Barclays PLC 1,875 % due 08.12.2023	2.700	2.795	Euroclear Bank S.A. 0,029 % due 10.07.2020	2.500	2.511
RCI Banque S.A. 1,125 % due 30.09.2019	2.700	2.743	Akelius Residential Property AB 3,375 % due 23.09.2020	2.300	2.438
Sampo Oyj 1,125 % due 24.05.2019	2.700	2.733	BNP Paribas S.A. 0,000 % due 10.10.2023	2.100	2.106
Hammerson PLC 2,750 % due 26.09.2019	2.600	2.701	Davide Campari-Milano SpA 2,750 % due 30.09.2020	1.900	2.000
thyssenkrupp AG 3,125 % due 25.10.2019	2.600	2.693	Fromageries Bel S.A. 1,500 % due 18.04.2024	1.900	1.923
Euroclear Bank S.A. 0,029 % due 10.07.2020	2.500	2.509	Citigroup, Inc. 0,177 % due 21.03.2023	1.900	1.896
Morgan Stanley 0,081 % due 21.05.2021	2.500	2.500	Goldman Sachs Group, Inc. 2,625 % due 19.08.2020	1.600	1.685
HSBC France S.A. 0,200 % due 04.09.2021	2.500	2.497	Caisse Centrale du Credit Immobilier de France S.A. 0,375 % due 31.07.2020	1.500	1.516
Euroclear Bank S.A. 0,250 % due 07.09.2022	2.500	2.483	thyssenkrupp AG 3,125 % due 25.10.2019	1.300	1.332
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 1,250 % due 14.04.2022	2.300	2.343	Sanofi 0,000 % due 21.03.2020	1.300	1.303
BNP Paribas S.A. 0,000 % due 10.10.2023	2.100	2.122	Altarea S.C.A. 2,250 % due 05.07.2024	1.300	1.298
Natwest Markets PLC 5,500 % due 23.03.2020	1.900	2.099	Vonovia Finance BV 0,750 % due 25.01.2022	1.200	1.211
BNP Paribas S.A. 1,125 % due 22.11.2023	2.100	2.098	Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 2,500 % due 08.10.2020	1.100	1.147
Daimler International Finance BV 0,250 % due 09.08.2021	2.100	2.097	FCE Bank PLC 1,114 % due 13.05.2020	1.100	1.123
Goldman Sachs Group, Inc. 2,000 % due 27.07.2023	2.000	2.095	Citigroup, Inc. 0,223 % due 11.11.2019	1.100	1.105
Bacardi Ltd. 2,750 % due 03.07.2023	1.900	2.030			
Nationwide Building Society 6,750 % due 22.07.2020	1.400	1.586			

(a) Der PIMCO Low Duration Euro Corporate Bond Source UCITS ETF legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

Wesentliche Veränderungen der Portfoliozusammensetzung PIMCO Low Duration US Corporate Bond Source UCITS ETF

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ERLÖSE (in Tsd.)
KÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018			VERKÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018		
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
2,500 % due 31.05.2020	\$ 49.200	\$ 49.218	2,500 % due 31.05.2020	\$ 26.900	\$ 26.768
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
2,500 % due 31.03.2023	11.500	11.402	1,875 % due 31.07.2022	17.600	16.985
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
2,625 % due 15.05.2021	11.100	11.125	1,750 % due 30.06.2022	12.200	11.723
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
2,500 % due 30.06.2020	7.500	7.492	2,500 % due 31.03.2023	11.500	11.379
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
1,875 % due 31.07.2022	7.300	7.049	2,625 % due 15.05.2021	8.500	8.456
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
1,750 % due 30.06.2022	6.100	5.867	2,000 % due 31.01.2020	7.400	7.347
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
2,750 % due 31.07.2023	5.200	5.179	2,375 % due 15.03.2021	5.500	5.447
Walt Disney Co.			U.S. Treasury Notes		
2,125 % due 13.09.2022	5.000	4.732	2,750 % due 31.07.2023	5.200	5.149
U.S. Treasury Notes			Walt Disney Co.		
1,875 % due 31.08.2022	3.579	3.431	2,125 % due 13.09.2022	5.000	4.736
ZF North America Capital, Inc.			U.S. Treasury Notes		
4,000 % due 29.04.2020	3.113	3.141	1,625 % due 31.08.2022	4.500	4.270
Pacific National Finance Pty Ltd.			U.S. Treasury Notes		
4,625 % due 23.09.2020	3.039	3.092	2,375 % due 31.01.2023	3.700	3.626
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
3,500 % due 15.05.2020	3.000	3.033	1,875 % due 31.08.2022	3.579	3.456
HSBC Holdings PLC			AutoNation, Inc.		
2,984 % due 11.09.2021	3.000	3.000	5,500 % due 01.02.2020	2.845	2.933
Sands China Ltd.			Sands China Ltd.		
4,600 % due 08.08.2023	2.700	2.699	4,600 % due 08.08.2023	2.700	2.723
Telstra Corp. Ltd.			LeasePlan Corp. NV		
4,800 % due 12.10.2021	2.500	2.600	2,500 % due 16.05.2018	2.700	2.700
Equifax, Inc.			Ford Motor Credit Co. LLC		
3,184 % due 15.08.2021	2.500	2.502	3,589 % due 15.02.2023	2.500	2.514
Ford Motor Credit Co. LLC			U.S. Treasury Notes		
3,589 % due 15.02.2023	2.500	2.500	1,875 % due 31.03.2022	2.500	2.410
WestJet Airlines Ltd.			Ford Motor Credit Co. LLC		
3,500 % due 16.06.2021	2.500	2.474	3,085 % due 12.10.2021	2.300	2.298
IPALCO Enterprises, Inc.			U.S. Treasury Notes		
3,450 % due 15.07.2020	2.436	2.426	1,875 % due 30.04.2022	2.300	2.222
U.S. Treasury Notes			AT&T, Inc.		
2,750 % due 31.08.2023	2.400	2.393	3,071 % due 01.06.2021	2.200	2.219

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

Wesentliche Veränderungen der Portfoliozusammensetzung

PIMCO Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ERLÖSE (in Tsd.)
KÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018			VERKÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018		
Community Health Systems, Inc.			First Quantum Minerals Ltd.		
6,250 % due 31.03.2023	\$ 8.450	\$ 7.874	7,000 % due 15.02.2021	\$ 3.819	\$ 3.805
Fiat Chrysler Automobiles NV			Frontier Communications Corp.		
4,500 % due 15.04.2020	5.850	5.935	8,125 % due 01.10.2018	3.110	3.149
Centene Corp.			Community Health Systems, Inc.		
4,750 % due 15.05.2022	4.913	5.006	8,125 % due 30.06.2024	3.273	2.663
Sirius XM Radio, Inc.			Hexion, Inc.		
3,875 % due 01.08.2022	5.090	4.995	10,000 % due 15.04.2020	2.380	2.297
HCA, Inc.			United States Steel Corp.		
6,500 % due 15.02.2020	4.729	4.958	7,375 % due 01.04.2020	2.120	2.258
Intelsat Jackson Holdings S.A.			Icahn Enterprises LP		
7,250 % due 15.10.2020	4.988	4.932	6,000 % due 01.08.2020	2.175	2.217
Bausch Health Cos., Inc.			Kindred Healthcare LLC		
7,500 % due 15.07.2021	4.820	4.918	8,000 % due 15.01.2020	2.000	2.138
Intelsat Jackson Holdings S.A.			Zachry Holdings, Inc.		
7,500 % due 01.04.2021	4.887	4.763	7,500 % due 01.02.2020	2.000	2.016
ArcelorMittal			Claire's Stores, Inc.		
6,250 % due 25.02.2022	4.284	4.612	9,000 % due 15.03.2019	2.675	1.715
Scientific Games International, Inc.			Genworth Holdings, Inc.		
10,000 % due 01.12.2022	4.242	4.584	7,200 % due 15.02.2021	1.700	1.611
Sabre Global, Inc.			Consolidated Communications, Inc.		
5,375 % due 15.04.2023	4.430	4.500	6,500 % due 01.10.2022	1.665	1.534
Arconic, Inc.			Tenet Healthcare Corp.		
5,400 % due 15.04.2021	4.248	4.387	8,125 % due 01.04.2022	1.305	1.378
DISH DBS Corp.			Bombardier, Inc.		
5,875 % due 15.07.2022	4.622	4.337	8,750 % due 01.12.2021	1.230	1.367
BMC Software Finance, Inc.			Community Health Systems, Inc.		
8,125 % due 15.07.2021	4.250	4.303	7,125 % due 15.07.2020	1.560	1.304
LifePoint Health, Inc.			CenturyLink, Inc.		
5,500 % due 01.12.2021	4.204	4.248	5,800 % due 15.03.2022	1.275	1.287
CenturyLink, Inc.			HCA, Inc.		
5,800 % due 15.03.2022	4.186	4.236	6,500 % due 15.02.2020	1.230	1.284
Tenet Healthcare Corp.			NXP BV		
5,500 % due 01.03.2019	4.100	4.164	4,125 % due 01.06.2021	1.255	1.258
Springleaf Finance Corp.			Xerium Technologies, Inc.		
5,625 % due 15.03.2023	4.150	4.093	9,500 % due 15.08.2021	1.200	1.257
Endo Finance LLC			Calfrac Holdings LP		
5,750 % due 15.01.2022	4.450	3.927	7,500 % due 01.12.2020	1.215	1.233
DJO Finance LLC			Altice Luxembourg S.A.		
8,125 % due 15.06.2021	3.854	3.906	7,750 % due 15.05.2022	1.230	1.217

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

Wesentliche Veränderungen der Portfoliozusammensetzung PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ERLÖSE (in Tsd.)
KÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018			VERKÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018		
United Kingdom Treasury Bills			United Kingdom Treasury Bills		
0,000 % due 17.09.2018	£ 20.000	£ 19.976	0,000 % due 24.09.2018	7.700	7.698
United Kingdom Treasury Bills			United Kingdom Treasury Bills		
0,000 % due 24.09.2018	17.000	16.977	0,000 % due 01.10.2018	5.500	5.499
United Kingdom Treasury Bills			Swedbank Hypotek AB		
0,000 % due 31.07.2018	16.500	16.492	1,000 % due 15.06.2022	SEK 44.000	3.837
United Kingdom Treasury Bills			BAT International Finance PLC		
0,000 % due 19.11.2018	14.800	14.773	6,000 % due 29.06.2022	£ 3.050	3.480
United Kingdom Treasury Bills			Wells Fargo & Co.		
0,000 % due 01.10.2018	7.700	7.690	2,125 % due 22.04.2022	2.500	2.506
United Kingdom Treasury Bills			CRH Finance DAC		
0,000 % due 22.10.2018	7.000	6.989	3,125 % due 03.04.2023	€ 2.500	2.481
United Kingdom Treasury Bills			Wells Fargo & Co.		
0,000 % due 03.12.2018	6.060	6.043	2,125 % due 20.12.2023	£ 1.500	1.493
Nordea Eiendoms kreditt A/S			Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.		
1,130 % due 18.06.2023	3.200	3.200	3,000 % due 27.05.2022	1.400	1.449
Royal Bank of Canada			Barclays PLC		
1,072 % due 08.06.2021	3.100	3.100	1,500 % due 01.04.2022	€ 1.500	1.358
United Kingdom Treasury Bills			Kreditanstalt fuer Wiederaufbau		
0,000 % due 05.11.2018	2.980	2.973	0,875 % due 15.03.2022	£ 1.300	1.285
Santander UK PLC			Bank Nederlandse Gemeenten NV		
0,957 % due 13.04.2021	2.900	2.900	5,375 % due 07.06.2021	1.000	1.116
Finsbury Square PLC			United Kingdom Treasury Bills		
1,501 % due 12.03.2059	2.644	2.647	0,000 % due 17.09.2018	1.100	1.098
Lansforsakringar Hypotek AB			Landes Kreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank		
2,250 % due 21.09.2022	SEK 26.000	2.386	1,125 % due 17.05.2021	1.000	999
Nordea Hypotek AB			Deutsche Bank AG		
1,000 % due 08.04.2022	26.200	2.295	1,750 % due 16.12.2021	1.000	976
Royal Bank of Canada			JAB Holdings BV		
2,200 % due 23.09.2019	\$ 3.000	2.253	2,125 % due 16.09.2022	€ 1.000	945
Deutsche Pfandbriefbank AG			Engie S.A.		
2,250 % due 04.05.2020	3.000	2.237	6,125 % due 11.02.2021	£ 200	224
Telefonica Emisiones S.A.U.			State of North Rhine-Westphalia		
5,597 % due 12.03.2020	£ 2.000	2.134	1,875 % due 15.09.2022	€ 150	145
Gosforth Funding PLC					
1,327 % due 25.08.2060	2.100	2.100			
Santander UK PLC					
1,132 % due 20.09.2021	2.000	2.000			
Swedbank Hypotek AB					
1,000 % due 15.06.2022	SEK 22.800	1.996			
Skandinaviska Enskilda Banken AB					
1,500 % due 15.12.2021	21.000	1.873			
Sveriges Sakerstallida Obligationer AB					
1,250 % due 15.06.2022	21.000	1.856			

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

Wesentliche Veränderungen der Portfoliozusammensetzung

PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF

30. September 2018

BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	KOSTEN (in Tsd.)	BESCHREIBUNG	NENNWERT (in Tsd.)	ERLÖSE (in Tsd.)
KÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018			VERKÄUFE BIS 30. SEPTEMBER 2018		
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
2,625 % due 15.07.2021	\$ 296.900	\$ 296.077	2,625 % due 15.07.2021	\$ 296.900	\$ 296.077
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
1,375 % due 31.07.2019	253.600	250.826	1,375 % due 31.07.2019	253.600	250.869
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
1,625 % due 31.07.2019	148.500	147.328	1,500 % due 31.10.2019	233.000	230.188
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
1,250 % due 31.08.2019	108.000	106.405	1,625 % due 30.04.2019	202.300	201.136
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
2,000 % due 31.01.2020	101.300	100.449	1,625 % due 31.07.2019	148.500	147.275
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
1,375 % due 30.09.2019	100.000	98.725	1,250 % due 31.08.2019	108.000	106.581
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
2,625 % due 15.06.2021	76.900	76.631	2,000 % due 31.01.2020	101.300	100.509
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
2,750 % due 15.08.2021	76.000	76.069	1,375 % due 30.09.2019	100.000	98.718
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
2,625 % due 31.08.2020	65.700	65.653	2,625 % due 15.06.2021	76.900	76.631
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
1,875 % due 31.12.2019	63.200	62.598	2,750 % due 15.08.2021	76.000	76.069
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC			U.S. Treasury Notes		
1,900 % due 23.09.2019	29.955	29.600	2,625 % due 31.08.2020	65.700	65.653
AIA Group Ltd.			U.S. Treasury Notes		
2,858 % due 20.09.2021	19.700	19.724	1,875 % due 31.12.2019	63.200	62.637
Hewlett Packard Enterprise Co.			U.S. Treasury Notes		
2,100 % due 04.10.2019	16.031	15.887	2,750 % due 15.09.2021	14.000	13.941
Crown Point CLO Ltd.			U.S. Treasury Notes		
3,276 % due 17.07.2028	15.600	15.600	2,625 % due 15.05.2021	11.300	11.288
Deutsche Telekom International Finance BV			Bank of America Corp.		
6,000 % due 08.07.2019	15.000	15.437	2,600 % due 15.01.2019	9.000	9.000
Citigroup, Inc.			Development Bank of Japan, Inc.		
3,344 % due 01.06.2024	14.800	14.800	1,875 % due 03.10.2018	8.500	8.500
Halfmoon Parent, Inc.			Eastern Creation Investment Holdings Ltd.		
2,984 % due 17.09.2021	14.000	14.000	2,750 % due 26.09.2020	6.200	6.063
U.S. Treasury Notes			American International Group, Inc.		
2,750 % due 15.09.2021	14.000	13.941	2,300 % due 16.07.2019	5.000	4.980
Dominion Energy Gas Holdings LLC			Morgan Stanley		
2,934 % due 15.06.2021	13.800	13.800	2,891 % due 10.02.2021	4.000	4.015
Schlumberger Holdings Corp.			Tyson Foods, Inc.		
2,350 % due 21.12.2018	12.500	12.490	2,781 % due 21.08.2020	4.000	4.012

Wesentliche Veränderungen des Portfolios sind definiert als Käufe, deren Wert 1 % der Gesamtkosten der Käufe übersteigt, sowie Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse übersteigen. Es sind mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe anzugeben. Wenn weniger Transaktionen durchgeführt wurden, sind alle derartigen Transaktionen anzugeben.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Barmittel des Fonds verwendet werden können und die in der Regel am nächsten Geschäftstag fällig werden, wurden nicht in die Darstellung der wesentlichen Veränderungen der Portfoliozusammensetzung aufgenommen.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Glossar: (Abkürzungen, die in den vorangehenden Aufstellungen genannt sein können)

Kontrahentenkürzel:

AZD	Australia and New Zealand Banking Group	JLN	JP Morgan Chase Bank N.A. London
BNP	BNP Capital Markets Ltd.	JML	JP Morgan Securities
BOA	Bank of America N.A.	JPM	JP Morgan Chase Bank N.A.
BOS	Banc of America Securities LLC	JPS	JP Morgan Securities, Inc.
BPS	BNP Paribas S.A.	MYC	Morgan Stanley Capital Services, Inc.
BRC	Barclays Bank PLC	MYI	Morgan Stanley & Co. International PLC
CBK	Citibank N.A.	NAB	National Australia Bank Ltd.
CKL	Citibank N.A. London	RBC	Royal Bank of Canada
COM	Commerz Bank AG	RYL	Royal Bank of Scotland Group PLC
DUB	Deutsche Bank AG	SCX	Standard Chartered Bank
FBF	Credit Suisse International	SOG	Societe Generale
GLM	Goldman Sachs Bank USA	SSB	State Street Bank and Trust Co.
GRE	RBS Securities, Inc.	TDM	TD Securities (USA) LLC
GST	Goldman Sachs International	TOR	Toronto Dominion Bank
HUS	HSBC Bank USA N.A.	UAG	UBS AG Stamford
IND	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A.	UBS	UBS Securities LLC

Währungskürzel:

ARS	Argentinischer Peso	INR	Indische Rupie
AUD	Australischer Dollar	JPY (oder ¥)	Japanischer Yen
BRL	Brasilianischer Real	MXN	Mexikanischer Peso
CAD	Kanadischer Dollar	MYR	Malaysischer Ringgit
CHF	Schweizer Franken	PEN	Peruanischer Nuevo Sol
CLP	Chilenischer Peso	PHP	Philippinischer Peso
CNH	Chinesischer Renminbi (Ausland)	PLN	Polnischer Zloty
CNY	Chinesischer Renminbi (Festland)	RUB	Russischer Rubel
COP	Kolumbianischer Peso	SEK	Schwedische Krone
CZK	Tschechische Krone	SGD	Singapur-Dollar
DKK	Dänische Krone	THB	Thailändischer Baht
EGP	Ägyptisches Pfund	TRY	Neue Türkische Lira
EUR (oder €)	Euro	USD (oder \$)	US-Dollar
GBP (oder £)	Britisches Pfund	ZAR	Südafrikanischer Rand
IDR	Indonesische Rupiah		

Börsen-Abkürzungen:

FTSE	Financial Times Stock Exchange
ICE	IntercontinentalExchange®
OTC	Over the Counter (im Freiverkehr)

Index-Abkürzungen:

CDX.EM	Credit Derivatives Index – Emerging Markets
CDX.HY	Credit Derivatives Index – High Yield
CDX.IG	Credit Derivatives Index – Investment Grade
CMBX	Commercial Mortgage-Backed Index
CPURNSA	Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index
Eonia®	Euro OverNight Index Average

Abkürzungen für Kommunalanleihen oder Behörden:

AMBAC	American Municipal Bond Assurance Corp.
Radian	Radian Guaranty, Inc.
UNEDIC	Union nationale interprofessionnelle pour l'emploi dans l'industrie et le commerce

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Glossar: (Abkürzungen, die in den vorangehenden Aufstellungen genannt sein können) (Fortsetzung)

Sonstige Abkürzungen:

ABCP	Asset-Backed Commercial Paper
ABS	Asset-Backed Security
BTP	Buoni del Tesoro Poliennali
CLO	Collateralised Loan Obligation
CMBS	Collateralised Mortgage-Backed Security
DAC	Designated Activity Company
EURIBOR	Euro Interbank Offered Rate
LIBID	London Interbank Bid Rate
LIBOR	London Interbank Offered Rate
PIK	Payment-in-Kind
RMBS	Residential Mortgage-Backed Security
TBA	To-Be-Announced
TBD	To-Be-Determined
TIIE	Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio „Gleichgewichts-Interbankenzinssatz“

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Allgemeine Informationen

Verwaltungsgesellschaft

PIMCO Global Advisors (Ireland) Ltd.,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin D02 HD32,
Irland.

Anlageberater

Pacific Investment Management Company LLC,
650 Newport Center Drive,
Newport Beach,
California 92660,
USA.

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
London W1U 3AH,
England.

PIMCO Deutschland GmbH,
Seidlstraße 24-24a,
80335 München,
Deutschland.

Administrator

State Street Fund Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin D02 HD32,
Irland.

Verwahrstelle

State Street Custodial Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin D02 HD32,
Irland.

Vertriebsstelle

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
London W1U 3AH,
England.

Vertreter im Vereinigten Königreich

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
London W1U 3AH,
England.

Co-Promoter

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
London W1U 3AH,
England.

Source UK Services Limited,
110 Cannon Street,
London EC4N 6EU,
England.

Zahlstelle in Österreich

Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG,
Graben 21,
A-1010 Wien,
Österreich.

Internationale Zahlstelle

Citibank, N.A., London Branch,
Citigroup Centre,
Canada Square,
Canary Wharf,
London E14 5LB,
England.

Deutsche Zahl- und Informationsstelle

Marcard, Stein & Co. AG,
Ballindamm 36,
20095 Hamburg,
Deutschland.

Zentralstelle und Finanzvermittler in Frankreich

Société Générale,
29, boulevard Haussmann,
75009 Paris,
Frankreich.

Zahlstelle und Vertretung in Luxemburg

BNP Paribas Securities Services,
23, avenue de la Porte-Neuve,
L-2085, Luxemburg.

Zahlstelle und Vertretung in der Schweiz

BNP Paribas Securities Services,
Paris, Succursale de Zurich,
Selnaustrasse 16,
8002 Zürich,
Schweiz.

Zahlstelle in Schweden

SEB Merchant Banking,
Sergels Torg 2,
SE-106 40,
Stockholm,
Schweden.

Rechtsberater für irisches Recht

Dillon Eustace,
33 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin D02 XK09,
Irland.

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Unabhängige Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers,
Chartered Accountants and Statutory Audit Firm,
One Spencer Dock,
North Wall Quay,
Dublin D01 X9R7,
Irland.

Sekretär

State Street Fund Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin D02 HD32,
Irland.

Eingetragener Sitz

PIMCO Fixed Income Source ETFs plc,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin D02 HD32,
Irland.

Verwaltungsrat der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft

V. Mangala Ananthanarayanan¹
Ryan P. Blute¹
John Bruton (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied)
Craig A. Dawson¹
David M. Kennedy (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied)
Michael J. Meagher (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied)
(zurückgetreten am 24. Juli 2018)
Frances Ruane (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied)

Der Verkaufsprospekt, Nachträge zum Verkaufsprospekt, die Gründungsurkunde und die Satzung, die wesentlichen Anlegerinformationen sowie Jahres- und Halbjahresberichte sind kostenlos in den Geschäftsstellen der Vertretung oder Vertreter in der jeweiligen Rechtsordnung erhältlich.

Anleger können ein Exemplar der Liste mit den Änderungen im Portfolio während des Berichtszeitraums zum 30. September 2018 kostenlos von der Verwahrstelle oder den Zahlstellen, von der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland und der Schweizer Vertretung beziehen.

¹ Angestellter bei PIMCO.