

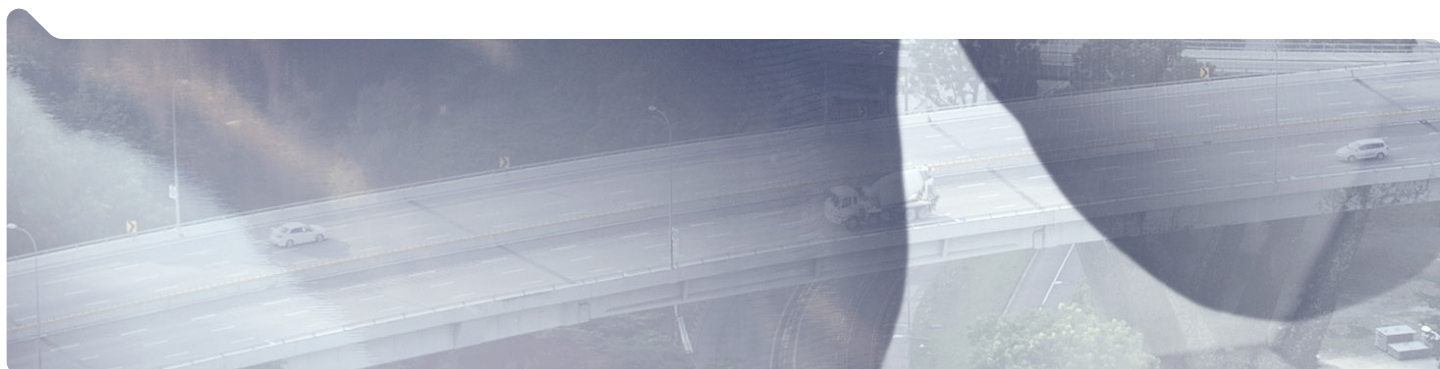


Achmea IM Fondsen

Bijlagen jaarverslagen 2019



Achmea Investment Management



Inhoudsopgave

1.	Toelichting spreiding beleggingsportefeuilles	03
2.	Portefeuille overzichten	21
3.	Kosten vermogensbeheer overzichten	125
4.	Verklaringen van de Bewaarder	161

1. Toelichting spreiding beleggingsportefeuilles

Deze bijlagen zijn geen onderdeel van de Controleverklaring van de onafhankelijke accountant.

1.1. Achmea IM Euro Investment Grade Credit Fund

Onderstaande tabellen zijn gedeeltelijk gebaseerd op informatie van andere fondsen (look through).

TABEL 1.1.1 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31-12-2019

(in euro's)		31-12-2019	
Duitsland		86.658.736	18%
Frankrijk		76.407.585	16%
Nederland		56.456.195	11%
Verenigde Staten		45.495.503	9%
Luxemburg		41.363.991	8%
Verenigd Koninkrijk		34.144.855	7%
België		21.010.969	4%
Spanje		20.875.272	4%
Italië		14.793.451	3%
Noorwegen		13.363.574	3%
Overige landen ¹		81.561.368	17%
Totaal		492.131.499	100%

¹ De categorie 'Overige' bestaat uit de volgende landen: (2019) Australië, Canada, Ierland, Zwitserland, Denemarken, Oostenrijk, Zweden, Japan, Mexico, Finland, Cayman Eilanden, Roemenië, Nieuw zeeland, Griekenland, IJsland, Polen, Verenigde Arabische Emiraten, Chili, Zuid Korea, Singapore, Indonesië, Virgin eilanden, Portugal, Bermuda en China.

TABEL 1.1.2 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31-12-2018

(in euro's)		31-12-2018	
Frankrijk		45.041.925	13%
Duitsland		39.290.126	11%
Nederland		39.018.705	11%
Luxemburg		38.713.666	11%
Verenigde Staten		35.411.769	10%
Verenigd Koninkrijk		28.228.569	8%
Spanje		23.389.359	7%
Italië		19.055.615	5%
Canada		11.978.027	3%
Australië		11.826.704	3%
Overige landen ¹		62.168.152	18%
Totaal		354.122.617	100%

¹ De categorie 'Overige' bestaat uit de volgende landen: (2018) Zwitserland, Australië, Oostenrijk, Ierland, Griekenland, Noorwegen, Nieuw Zeeland, Mexico, Singapore, Cayman eilanden, Zweden, Polen, Denemarken, IJsland, Finland, Tsjechië, Zuid Korea, Indonesië, Virgin eilanden, Roemenië, Japan, Chili, Rusland, Jersey en Portugal.

1.2. Achmea IM Emerging Markets Equity Fund

Onderstaande tabellen zijn gedeeltelijk gebaseerd op informatie van andere fondsen (look through).

TABEL 1.2.1 BELEGGINGEN NAAR SECTOR

(in euro's)		31-12-2019		31-12-2018	
Cyclische Consumentengoederen		10.166.235	14%	5.352.185	10%
Defensieve Consumentengoederen		4.446.125	6%	3.552.986	6%
Energie		5.209.001	7%	4.232.416	8%
Financiële waarden		17.456.819	24%	13.140.708	24%
Gezondheidszorg		1.996.469	3%	1.432.264	3%
Industrie		3.800.630	5%	2.980.807	5%
Informatie Technologie		11.172.182	16%	7.332.137	13%
Basismaterialen		5.259.733	7%	4.001.985	7%
Telecommunicatie		7.916.162	11%	7.559.542	14%
Nutsbedrijven		1.846.059	3%	1.426.779	3%
Vastgoed		2.081.285	3%	1.542.835	3%
Overig		606.945	1%	2.368.591	4%
Totaal		71.957.645	100%	54.923.235	100%

TABEL 1.2.2 BELEGGINGEN NAAR SOORT

(in euro's)		31-12-2019		31-12-2018	
Aandelenfondsen		71.955.158	100%	54.923.235	100%
Totaal		71.955.158	100%	54.923.235	100%

TABEL 1.2.3 BELEGGINGEN NAAR LAND PER 31-12-2019

(in euro's)		31-12-2019	
China		20.443.332	28%
Zuid-Korea		8.395.166	12%
Taiwan		8.315.398	12%
India		6.108.048	8%
Brazilië		5.185.068	7%
Hong Kong		3.370.806	5%
Zuid Afrika		3.369.003	5%
Rusland		2.707.199	4%
Thailand		1.885.552	3%
Saoedi-Arabië		1.689.364	2%
Overige landen ¹		10.488.709	15%
Totaal		71.957.645	100%

¹ De categorie 'Overige' bestaat uit de volgende landen: (2019) Mexico, Indonesië, Maleisië, Verenigde Staten, Filipijnen, Qatar, Polen, Chili, Verenigde Arabische Emiraten, Turkije, Colombia, Griekenland, Hongarije, Peru, Ierland, Nederland, Egypte, Tsjechië, Argentinië, Verenigd Koninkrijk, Luxemburg, Suriname, Duitsland, Singapore en Pakistan

TABEL 1.2.4 BELEGGINGEN NAAR LAND PER 31-12-2018

(in euro's)		31-12-2018	
China		13.051.135	24%
Zuid-Korea		7.034.675	13%
Taiwan		6.132.848	11%
India		4.964.368	9%
Brazilië		3.952.205	7%
Zuid Afrika		3.325.019	6%
Hong Kong		2.567.736	5%
Rusland		1.937.672	4%
Nederland		1.613.985	3%
Mexico		1.486.604	3%
Overige landen ¹		8.856.988	16%
Totaal		54.923.235	100%

¹ De categorie 'Overige' bestaat uit de volgende landen: (2018) Maleisië, Thailand, Indonesië, Polen, Ierland, Filipijnen, Chili, Qatar, Verenigde Staten, Turkije, Verenigde Arabische Emiraten, Colombia, Peru, Hongarije, Griekenland, Tsjechië, Egypte, Pakistan, Singapore, Verenigd Koninkrijk, Bermuda en Malta

TABEL 1.2.5 BELEGGINGEN NAAR VALUTA PER 31-12-2019

(in euro's)		31-12-2019	
Hong Kongse Dollar		15.068.271	21%
Amerikaanse Dollar		8.475.998	12%
Koreaanse Won		8.427.544	12%
Taiwanese Dollar		8.335.395	12%
Indische Roepies		5.793.096	8%
Braziliaanse Reais		5.185.068	7%
Zuidafrikaanse Rand		3.369.540	5%
Chinese Yuan Renminbi		2.854.988	4%
Russische Roebels		2.182.947	3%
Thaise Baht		1.885.552	3%
Overig ¹		10.376.758	14%
Totaal		71.955.158	100%

¹ De categorie 'Overig' 2019 bestaat uit de volgende valuta: Saoedi-Arabische Riyal, Mexicaanse Peso's, Indonesische Roepia, Maleisische Ringgit, Filippijnse Peso's, Qatarese Rial, Poolse Zloty, Chileense Peso's, Euro, Arabische Emiraten Dirhams, Turkse Lires, Columbiaanse Peso's, Hongaarse Forint, Egyptische Ponden, Tsjechische Koruny en Pakistaanse Roepies

TABEL 1.2.6 BELEGGINGEN NAAR VALUTA PER 31-12-2018

(in euro's)		31-12-2018	
Hong Kongse Dollar		12.039.309	22%
Koreaanse Won		7.062.860	13%
Taiwanese Dollar		6.138.505	11%
Indische Roepies		4.814.273	9%
Amerikaanse Dollar		4.621.581	8%
Braziliaanse Reais		3.944.951	7%
Zuidafrikaanse Rand		3.327.735	6%
Euro		2.193.529	4%
Russische Roebels		1.537.813	3%
Mexicaanse Peso's		1.486.916	3%
Overig ¹		7.755.763	14%
Totaal		54.923.235	100%

¹ De categorie 'Overig' 2018 bestaat uit de volgende valuta: Maleisische Ringgit, Thaise Baht, Indonesische Roepia, Poolse Zloty, Filippijnse Peso's, Qatarese Rial, Chileense Peso's, Turkse Lires, Chinese Yuan Renminbi, Arabische Emiraten Dirhams, Columbiaanse Peso's, Hongaarse Forint, Tsjechische Koruny, Egyptische Ponden en Pakistaanse Roepies

1.3. Achmea IM Global Real Estate Equity Fund

Onderstaande tabellen zijn gedeeltelijk gebaseerd op informatie van andere fondsen (look through).

TABEL 1.3.1 BELEGGINGEN NAAR SOORT

(in euro's)		31-12-2019		31-12-2018	
Participaties in vastgoedfondsen		69.927.121	100%	49.922.201	100%
Totaal		69.927.121	100%	49.922.201	100%

TABEL 1.3.2 BELEGGINGEN NAAR LAND PER 31-12-2019

(in euro's)		31-12-2019	
Verenigde Staten		33.936.955	49%
Nederland		7.644.815	11%
Japan		7.337.198	10%
Hong Kong		3.819.632	5%
Verenigd Koninkrijk		3.154.068	5%
Duitsland		2.793.820	4%
Australië		2.203.809	3%
Singapore		1.873.829	3%
Canada		1.812.599	3%
Frankrijk		1.807.321	3%
Overige Landen ¹		3.543.075	5%
Totaal		69.927.121	100%

¹ De categorie 'Overige' 2019 bestaat uit de volgende landen: (2019) Zweden, Zwitserland, België, Spanje, Guernsey, Ierland, Oostenrijk, Israël, Finland, Noorwegen, Nieuw Zeeland en Italië

TABEL 1.3.3 BELEGGINGEN NAAR LAND PER 31-12-2018

(in euro's)		31-12-2018	
Verenigde Staten		22.781.488	46%
Nederland		6.827.532	14%
Japan		5.021.866	10%
Hong Kong		3.454.640	7%
Duitsland		2.082.721	4%
Australië		2.023.511	4%
Verenigd Koninkrijk		1.882.263	4%
Frankrijk		1.291.961	3%
Canada		1.215.362	2%
Singapore		1.117.274	2%
Overige Landen ¹		2.223.583	4%
Totaal		49.922.201	100%

¹ De categorie 'Overige' 2018 bestaat uit de volgende landen: Zweden, Zwitserland, België, Spanje, Guernsey, Ierland, Oostenrijk, Israël, Finland, Noorwegen, Nieuw Zeeland, Italië en Jersey

TABEL 1.3.4 BELEGGINGEN NAAR VALUTA PER 31-12-2019

(in euro's)		31-12-2019	
Amerikaanse Dollar		34.718.568	50%
Euro		12.938.555	19%
Japanse Yen		7.338.915	10%
Hong Kongse Dollar		3.635.286	5%
Brits Pond Sterling		3.224.093	5%
Australische Dollar		2.205.387	3%
Singaporese Dollar		1.812.763	3%
Canadese Dollar		1.812.599	3%
Zweedse Kronen		1.274.320	2%
Zwitserse Frank		716.706	1%
Overig ¹		249.929	0%
Totaal		69.927.121	100%

¹ De categorie 'Overig' 2019 bestaat uit de volgende valuta: Israël Shekel, Noorse kroon en Nieuw Zeeland dollar

TABEL 1.3.5 BELEGGINGEN NAAR VALUTA PER 31-12-2018

(in euro's)		31-12-2018	
Amerikaanse Dollar		23.025.020	46%
Euro		10.981.216	22%
Japanse Yen		5.023.492	10%
Hong Kongse Dollar		3.275.256	7%
Australische Dollar		2.024.497	4%
Brits Pond Sterling		2.006.545	4%
Canadese Dollar		1.215.362	2%
Singaporese Dollar		1.068.523	2%
Zweedse Kronen		721.147	1%
Zwitserse Frank		437.398	1%
Overig ¹		143.745	0%
Totaal		49.922.201	100%

¹ De categorie 'Overig' 2018 bestaat uit de volgende valuta: Israël Shekel, Noorse kroon en Nieuw Zeeland dollar

1.4. Achmea IM (LC) Emerging Markets Debt Fund

Onderstaande tabellen zijn gedeeltelijk gebaseerd op informatie van andere fondsen (look through).

TABEL 1.4.1 BELEGGINGEN NAAR SECTOR

(in euro's)		31-12-2019		31-12-2018	
Buitenlandse overheidsinstellingen		74.576.580	86%	89.460.744	77%
Financiële instellingen		4.380.267	5%	2.637.024	2%
Handel- en industriële bedrijven		394.997	0%	3.313.688	3%
Andere instellingen		7.553.781	9%	21.189.022	18%
Totaal		86.905.625	100%	116.600.478	100%

TABEL 1.4.2 BELEGGINGEN NAAR LOOPTIJD

(in euro's)		31-12-2019		31-12-2018	
Resterende looptijd < 1 jaar		8.563.368	10%	24.097.071	21%
Resterende looptijd 1 < > 5 jaar		27.429.697	32%	23.921.091	20%
Resterende looptijd > 5 jaar		50.912.560	58%	68.582.316	59%
Totaal		86.905.625	100%	116.600.478	100%

TABEL 1.4.3 BELEGGINGEN NAAR KREDIETWAARDIGHEID

(in euro's)		31-12-2019		31-12-2018	
AAA		912.077	1%	1.134.076	1%
AA		3.732.844	4%	1.490.876	1%
A		18.260.346	21%	16.272.351	14%
BBB		28.290.868	33%	36.614.453	31%
BB		14.695.927	17%	21.671.472	19%
B		221.655	0%	14.981.388	13%
CCC		-	-	267.643	0%
C		-	-	79.288	0%
D		-	-	321.723	0%
Not rated ¹		20.791.908	24%	23.767.209	20%
Totaal		86.905.625	100%	116.600.478	100%

¹ De categorie Not rated bestaat uit staatsobligaties uit diverse landen, bedrijfsobligaties uit diverse sectoren zoals financiële dienstverlening, technologie, consumenten goederen, en telecommunicatie.

TABEL 1.4.4 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31012-2019

(in euro's)		31-12-2019	
Russische Federatie		8.827.568	10%
Brazilië		7.935.431	9%
Mexico		7.050.094	8%
Thailand		6.912.407	8%
Malaysië		5.621.218	6%
Luxemburg		5.426.434	6%
Indonesië		5.031.452	6%
Polen		4.685.284	5%
Zuid Afrika		4.564.969	5%
Colombia		4.498.305	5%
Overige ¹		26.352.462	30%
Totaal		86.905.625	100%

¹ De categorie 'Overige' 2019 bestaat uit de volgende landen: (2019) Colombia, Hongarije, Tsjechië, Peru, Turkije, Chili, Nederland, Roemenië, Verenigde Staten, China, Egypte, Ierland, Verenigd Koninkrijk, Servië, Filipijnen, Cayman eilanden, Maagdeneilanden, Dominicaanse Republiek, Uruguay, Zuid-Korea, Singapore, India, Hong Kong, Oostenrijk, Israël, Saudi Arabië, Verenigde Arabische Emiraten, Kazachstan, Panama, Bahamas, Morokko en Taiwan.

TABEL 1.4.5 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31012-2018

(in euro's)		31-12-2018	
Nederland		11.327.255	10%
Mexico		8.425.492	7%
Luxemburg		7.567.922	6%
Zuid Afrika		7.030.167	6%
Rusland		6.985.391	6%
Colombia		5.952.002	5%
Indonesië		5.811.424	5%
Polen		5.433.202	5%
Turkije		5.045.651	4%
Brazilië		4.961.373	4%
Overige landen		48.060.599	41%
Totaal		116.600.478	100%

TABEL 1.4.6 BELEGGINGEN NAAR VALUTA PER 31-12-2019

(in euro's)		31-12-2019	
Indonesische Roepia		9.672.820	11%
Russische Roebels		8.780.064	10%
Braziliaanse Reais		7.887.190	9%
Mexicaanse Peso's		6.965.977	8%
Thaise Baht		6.858.712	8%
Maleisische Ringgit		5.626.987	6%
Euro		5.422.056	6%
Zuidafrikaanse Rand		5.306.898	6%
Poolse Zloty		4.633.354	5%
Columbiaanse Peso's		4.310.489	5%
Overig ¹		21.441.077	25%
Totaal		86.905.625	100%

¹ De categorie 'Overige' 2019 bestaat uit de volgende valuta: Hongaarse Forint, Tsjechische Koruny, Peruaanse Sol, Chileense Peso's, Turkse Lires, Roemeense Leu, Amerikaanse Dollar, Chinese Yuan Renminbi, Egyptische Ponden, Filipijnse Peso's, Dominicaanse Peso's, Uruguayan Peso's, Indische Roepies, Brits Pond Sterling, Singaporese Dollar, Zwitserse Frank, Hong Kongse Dollar, Australische Dollar

TABEL 1.4.7 BELEGGINGEN NAAR VALUTA PER 31-12-2018

(in euro's)		31-12-2018	
Amerikaanse Dollar		47.598.059	41%
Euro		11.293.765	10%
Mexicaanse Peso's		6.543.018	6%
Zuidafrikaanse Rand		6.014.289	5%
Indonesische Roepia		6.003.503	5%
Russische Roebels		5.970.203	5%
Braziliaanse Reais		5.059.931	4%
Columbiaanse Peso's		4.685.129	4%
Poolse Zloty		4.457.841	4%
Thaise Bath		4.367.193	4%
Overig		14.607.547	13%
Totaal		116.600.478	100%

1.5. Achmea IM Global Multi Factor Equity Fund EUR hedged

Onderstaande tabellen zijn gedeeltelijk gebaseerd op informatie van andere fondsen (look through).

TABEL 1.5.1 BELEGGINGEN NAAR SECTOR

(in euro's)		31-12-2019		31-12-2018	
Cyclische Consumentengoederen		21.213.443	9%	16.877.579	9%
Defensieve Consumentengoederen		26.236.413	11%	12.992.012	7%
Energie		3.863.035	2%	11.194.889	6%
Financiële waarden		21.334.337	9%	22.829.417	13%
Gezondheidszorg		35.314.848	15%	28.982.305	16%
Industrie		24.381.446	10%	17.539.101	10%
Informatie Technologie		55.568.201	23%	38.702.500	21%
Basismaterialen		10.038.707	4%	8.135.696	4%
Vastgoed		9.432.275	4%	5.249.915	3%
Telecommunicatie		16.396.931	7%	9.669.823	5%
Nutsbedrijven		14.260.412	6%	9.176.305	5%
Totaal		238.040.050	100%	181.349.542	100%

TABEL 1.5.2 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31-12-2019

(in euro's)		31-12-2019	
Verenigde Staten		135.450.547	57%
Japan		20.339.303	9%
Zwitserland		14.890.114	6%
Verenigd Koninkrijk		11.168.627	5%
Frankrijk		8.816.691	4%
Nederland		7.869.332	3%
Canada		7.233.358	3%
Australië		6.144.562	3%
Duitsland		5.114.189	2%
Spanje		4.056.802	2%
Overige landen ¹		16.956.524	7%
Totaal		238.040.050	100%

¹ De categorie 'Overige' bestaat uit de volgende landen: (2019) Italië, Zweden, Hongkong, Denemarken, Finland, België, Noorwegen, Singapore, Ierland, Portugal, Oostenrijk, Jersey en Israël

TABEL 1.5.3 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31-12-2018

(in euro's)		31-12-2018	
Verenigde Staten		99.865.875	54%
Japan		16.750.423	9%
Frankrijk		9.466.107	5%
Verenigd Koninkrijk		8.639.337	5%
Zwitserland		7.998.816	4%
Nederland		7.733.670	4%
Canada		6.278.704	3%
Duitsland		4.736.404	3%
Hong Kong		3.751.741	2%
Australië		3.267.571	2%
Overige landen ¹		15.477.541	8%
Totaal		183.966.190	100%

¹ De categorie 'Overige' bestaat uit de volgende landen: (2018) Spanje, Italië, Finland, Noorwegen, Singapore, Zweden, Denemarken, België, Ierland, Portugal, Oostenrijk

1.6. Achmea IM Global Real Estate Equity Fund EUR hedged

Onderstaande tabellen zijn gedeeltelijk gebaseerd op informatie van andere fondsen (look through).

TABEL 1.6.1 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31-12-2019

(in euro's)		31-12-2019	
Verenigde Staten		24.447.066	49%
Nederland		5.507.073	11%
Japan		5.285.476	10%
Hong Kong		2.751.537	5%
Verenigd Koninkrijk		2.272.087	4%
Duitsland		2.012.576	4%
Australië		1.587.551	3%
Singapore		1.349.845	3%
Canada		1.305.737	3%
Frankrijk		1.301.934	3%
Overige Landen ¹		2.552.314	5%
Totaal		50.373.196	99%

¹ De categorie 'Overige' 2019 bestaat uit de volgende landen: (2019) Zweden, Zwitserland, België, Spanje, Guernsey, Ierland, Oostenrijk, Israël, Finland, Noorwegen, Nieuw Zeeland en Italië

TABEL 1.6.2 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31-12-2018

(in euro's)		31-12-2018	
Verenigde Staten		17.128.143	46%
Nederland		5.133.244	14%
Japan		3.775.664	10%
Hong Kong		2.597.353	7%
Duitsland		1.565.883	4%
Australië		1.521.366	4%
Verenigd Koninkrijk		1.415.169	4%
Frankrijk		971.354	3%
Canada		913.764	2%
Singapore		840.017	2%
Overige Landen ¹		1.671.789	4%
Totaal		37.533.746	100%

¹ De categorie 'Overige' 2018 bestaat uit de volgende landen: Zweden, Zwitserland, België, Spanje, Guernsey, Ierland, Oostenrijk, Israël, Finland, Noorwegen, Nieuw Zeeland, Italië en Jersey

1.7. Achmea IM 20 Year Overlay Fund

Onderstaande tabellen zijn gedeeltelijk gebaseerd op informatie van andere fondsen (look through).

TABEL 1.7.1 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31-12-2019

(in euro's)		31-12-2019	
Nederland		81.916.642	39%
Verenigd Koninkrijk		74.398.906	35%
Duitsland		53.557.207	25%
Frankrijk		93.259	0%
Zweden		49.685	0%
Verenigde Staten		48.684	0%
Canada		33.462	0%
Australië		31.520	0%
Totaal		210.129.365	100%

TABEL 1.7.2 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31-12-2018

(in euro's)		31-12-2018	
Nederland		52.658.897	51%
Duitsland		37.959.329	37%
Verenigd Koninkrijk		12.497.677	12%
Verenigde Staten		263.639	0%
Frankrijk		26.296	0%
Canada		26.287	0%
Zweden		21.022	0%
Zwitserland		18.649	0%
Australië		18.410	0%
Nieuw Zeeland		8.808	0%
Totaal		103.499.014	100%

1.8. Achmea IM 30 Year Overlay Fund

Onderstaande tabellen zijn gedeeltelijk gebaseerd op informatie van andere fondsen (look through).

TABEL 1.8.1 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31-12-2019

(in euro's)		31-12-2019	
Nederland		154.501.470	46%
Verenigd Koninkrijk		104.438.991	31%
Duitsland		74.128.019	22%
Frankrijk		372.863	0%
Zweden		198.649	0%
Verenigde Staten		194.645	0%
Canada		133.788	0%
Australië		126.023	0%
Totaal		334.094.448	100%

TABEL 1.8.2 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31-12-2018

(in euro's)		31-12-2018	
Nederland		114.557.642	52%
Duitsland		77.514.619	35%
Verenigd Koninkrijk		27.754.979	13%
Verenigde Staten		599.603	0%
Frankrijk		105.137	0%
Canada		105.098	0%
Zweden		84.048	0%
Zwitserland		74.560	0%
Australië		73.605	0%
Nieuw Zeeland		35.217	0%
Totaal		220.904.507	100%

1.9. Achmea IM 40 Year Overlay Fund

Onderstaande tabellen zijn gedeeltelijk gebaseerd op informatie van andere fondsen (look through).

TABEL 1.9.1 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31-12-2019

(in euro's)		31-12-2019	
Nederland		56.986.277	46%
Duitsland		35.988.875	29%
Verenigd Koninkrijk		30.142.470	24%
Frankrijk		305.925	0%
Zweden		162.987	0%
Verenigde Staten		159.702	0%
Canada		109.769	0%
Australië		103.399	0%
Totaal		123.959.404	100%

TABEL 1.9.2 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31-12-2018

(in euro's)		31-12-2018	
Nederland		38.115.687	51%
Duitsland		26.069.043	35%
Verenigd Koninkrijk		8.254.027	11%
Verenigde Staten		473.181	1%
Frankrijk		263.426	0%
Canada		263.330	0%
Zweden		210.587	0%
Zwitserland		186.814	0%
Australië		184.421	0%
Nieuw Zeeland		88.238	0%
Totaal		74.108.753	100%

1.10. Achmea IM 50 Year Overlay Fund

Onderstaande tabellen zijn gedeeltelijk gebaseerd op informatie van andere fondsen (look through).

TABEL 1.10.1 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31-12-2019

(in euro's)		31-12-2019	
Nederland		43.732.866	54%
Duitsland		32.831.046	40%
Verenigd Koninkrijk		4.666.112	6%
Frankrijk		166.636	0%
Zweden		88.778	0%
Verenigde Staten		86.989	0%
Canada		59.791	0%
Australië		56.321	0%
Totaal		81.688.539	100%

TABEL 1.10.2 BELEGGINGEN NAAR LANDEN PER 31-12-2018

(in euro's)		31-12-2018	
Nederland		24.251.220	53%
Duitsland		15.931.753	35%
Verenigd Koninkrijk		4.639.487	10%
Verenigde Staten		337.956	1%
Frankrijk		201.960	0%
Canada		201.886	0%
Zweden		161.450	0%
Zwitserland		143.224	0%
Australië		141.389	0%
Nieuw Zeeland		67.649	0%
Totaal		46.077.974	100%

2. Portefeuille overzichten

Deze bijlagen zijn geen onderdeel van de Controleverklaring van de onafhankelijke accountant.

2.1. Achmea IM Euro Government Bond Fund

TABEL 2.1.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Valuta	Waarde in euro's
Bundesrepublik Deutschland 1.750% 04/07/2022		12.501.392
Netherlands Government 0% 15/01/2024		9.477.630
Bundesrepub. Deutschland 1.000% 15/08/2025		9.304.512
Bundesrepub. Deutschland 2.500% 15/08/2046		8.816.580
Bundesrepub. Deutschland 2.500% 04/07/2044		8.688.224
Bundesrepublik Deutschland 4,75% 04/07/2034		8.391.587
Bundesrepub. deutschland .2500% 15/02/2029		8.036.644
Netherlands Government .5000% 15/07/2026		7.940.335
Bundesrepublik Deutschland 3% 04/07/2020		7.641.600
Bundesschatzanweisungen 0% 12/06/2020		7.523.400
Buoni poliennali del tes 3.000% 01/08/2029		7.487.090
Buoni poliennali del tes 1.000% 15/07/2022		7.261.809
Bundesrepublik Deutschland 4% 04/01/2037		7.255.600
Bundesrepub. Deutschland 1.000% 15/08/2024		7.044.942
Bundesrepublik Deutschland 3,25% 04/07/2042		6.867.934
Netherlands Government Bond 2.250% 15/07/2022		6.759.837
France Government Bond OAT 3,75% 25/04/2021		6.568.752
Bundesrepublik Deutschland 5,5% 04/01/2031		6.369.046
Bundesrepublik Deutschland 4,75% 04/07/2040		5.795.160
Bundesrepublik Deutschland 4,25% 04/07/2039		5.656.140
Bundesrepublik Deutschland 3.250% 04/07/2021		5.431.747
Bundesobligation 0% 07/10/2022		5.285.592
France (Govt of) .5000% 25/05/2025		5.277.677
Netherlands Government .2500% 15/07/2025		5.269.167
Bundesrepublik Deutschland 2.250% 04/09/2021		5.242.600
France Government Bond OAT 4,5% 25/04/2041		5.207.812

Naam	Valuta	Waarde in euro's
Bundesrepublik Deutschland 2.50% 04/01/2021		5.165.300
Bundesrepublik Deutschland 2,25% 04/09/2020		5.099.300
France (govt of) 1.500% 25/05/2031		5.097.030
Bundesschatzanweisungen 0% 12/03/2021		5.040.850
Buoni Poliennali Del Tes 2.200% 01/06/2027		4.864.005
Bundesrepub. deutschland 0% 15/08/2029		4.783.707
Netherlands Government 1.750% 15/07/2023		4.759.524
France (govt of) 2.500% 25/05/2030		4.725.794
Netherlands Government 0% 15/01/2022		4.554.225
France Government Bond OAT 5,75% 25/10/2032		4.532.265
Bundesrepub. Deutschland 0% 15/08/2026		4.513.212
France (govt of) .5000% 25/05/2026		4.493.629
Netherlands Government Bond 3,75% 15/01/2042		4.357.975
Bundesrepub. Deutschland .2500% 15/02/2027		4.332.351
France (govt of) .5000% 25/05/2029		4.314.174
France (govt of) .7500% 25/11/2028		4.255.000
Bundesobligation 0% 08/10/2021		4.246.662
Bundesrepub. Deutschland .5000% 15/02/2026		4.225.680
Bundesrepub. Deutschland .5000% 15/02/2025		4.203.358
Bundesobligation 0% 05/04/2024		4.088.560
France Government Bond OAT 4,75% 25/04/2035		4.065.398
Netherlands Government Bond 4% 15/01/2037		4.060.889
France (Govt Of) .7500% 25/05/2028		4.044.720
France (Govt of) 3.250% 25/05/2045		4.041.905
France Government Bond OAT 5,5% 25/04/2029		3.986.277
France (Govt Of) 2.750% 25/10/2027		3.852.545
Republic of austria .5000% 20/02/2029		3.809.286
France (Govt Of) 1.000% 25/05/2027		3.786.510
Netherlands Government 2.750% 15/01/2047		3.763.159
France Government Bond OAT 3.250% 25/10/2021		3.747.240
France Government Bond OAT 4% 25/10/2038		3.730.789
Bundesrepub. Deutschland 1.250% 15/08/2048		3.700.008
Buoni poliennali del tes 1.750% 01/07/2024		3.685.430
Bundesrepub. Deutschland .5000% 15/02/2028		3.623.278
Netherlands government .2500% 15/07/2029		3.396.360
France (govt of) 2.000% 25/05/2048		3.387.173
Bundesrepub. Deutschland 1.500% 04/09/2022		3.381.312
Bundesrepub. Deutschland .2500% 15/08/2028		3.343.232
Finnish government .5000% 15/09/2029		3.340.160

Naam	Valuta	Waarde in euro's
France (govt of) 0% 25/03/2024		3.259.776
France (Govt of) 1.250% 25/05/2036		3.241.649
Netherlands Government Bond 2.500% 15/01/2033		3.088.605
France Government Bond OAT 4% 25/04/2055		2.939.811
Netherlands Government .7500% 15/07/2027		2.893.401
France (govt of) 1.750% 25/06/2039		2.883.092
France (Govt of) .2500% 25/11/2026		2.877.980
France (Govt Of) 0% 25/05/2022		2.871.236
Buoni Poliennali Del Tes 1.450% 15/11/2024		2.770.629
France (govt of) 1.500% 25/05/2050		2.752.252
Finnish government 0% 15/09/2024		2.644.720
Buoni Poliennali Del Tes 2.500% 15/11/2025		2.631.048
France Government Bond OAT 4% 25/04/2060		2.601.215
France (Govt of) 1.750% 25/05/2023		2.587.080
Irish Tsy 1.35% 2031 1.350% 18/03/2031		2.576.161
France (govt of) 1.250% 25/05/2034		2.576.092
Buoni poliennali del tes .8500% 15/01/2027		2.575.690
France (Govt Of) 0% 25/03/2023		2.543.625
Spain Government Bond 4,7% 30/07/2041		2.510.873
Buoni poliennali del tes 3.350% 01/03/2035		2.446.864
France (govt of) 0% 25/02/2022		2.430.960
France Government Bond OAT 3,5% 25/04/2026		2.411.409
France Government Bond OAT 4,25% 25/10/2023		2.365.260
France Government Bond OAT 2,5% 25/10/2020		2.358.719
Bonos y Oblig del Estado 1.400% 30/07/2028		2.339.910
Netherlands Government .7500% 15/07/2028		2.313.981
Buoni Poliennali Del Tes 3.500% 01/03/2030		2.277.169
Buoni poliennali del tes 1.250% 01/12/2026		2.264.970
Bundesobligation 0% 18/10/2024		2.250.688
Bonos y Oblig del Estado 1.600% 30/04/2025		2.171.240
France (govt of) 1.750% 25/11/2024		2.098.094
Netherlands Government 2.000% 15/07/2024		2.000.628
Spain Government Bond 5.500% 30/04/2021		1.996.169
Bonos Y Oblig Del Estado .4500% 31/10/2022		1.942.123
Buoni Poliennali Del Tes 3.750% 01/09/2024		1.832.832
Bonos y oblig del estado .0500% 31/10/2021		1.814.778
Buoni Poliennali Del Tes 2.450% 01/09/2033		1.796.619
France (govt of) 0% 25/11/2029		1.778.760
Bonos Y Oblig Del Estado 1.450% 30/04/2029		1.638.990

Naam	Valuta	Waarde in euro's
Buoni Poliennali Del Tes 1.600% 01/06/2026		1.569.285
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.00% 01/03/2022		1.551.536
Luxembourg government 0% 13/11/2026		1.515.585
Belgium Kingdom .8000% 22/06/2025		1.481.886
Bonos Y Oblig Del Estado 1.950% 30/04/2026		1.450.150
Buoni Poliennali Del Tes 3.450% 01/03/2048		1.446.045
Bonos y Oblig del Estado .7500% 30/07/2021		1.426.432
Buoni poliennali del tes 2.450% 01/10/2023		1.400.113
Bonos y Oblig Del Estado 2.150% 31/10/2025		1.346.448
Buoni Poliennali Del Tes 1.450% 15/09/2022		1.346.254
Buoni Poliennali Del Tes 1.350% 15/04/2022		1.337.570
Buoni Poliennali Del Tes 1.200% 01/04/2022		1.333.618
Netherlands government .5000% 15/01/2040		1.317.638
Buoni Poliennali Del Tes 1.650% 01/03/2032		1.314.781
Bonos Y Oblig Del Estado .3500% 30/07/2023		1.300.640
France (govt of) 1.000% 25/11/2025		1.288.980
Bundesrepublik Deutschland 4,75% 04/07/2028		1.288.098
Austria Government Bond 3,5% 15/09/2021		1.284.264
Spain Government Bond 6% 31/01/2029		1.275.612
Irish Tsy 3.4% 2024 3.400% 18/03/2024		1.273.657
France (Govt Of) 0% 25/05/2021		1.210.140
Spain Government Bond 5,75% 30/07/2032		1.206.247
France (govt of) 1.750% 25/05/2066		1.182.360
Irish Tsy 1% 2026 1.000% 15/05/2026		1.179.508
Bonos Y Oblig Del Estado 5.400% 31/01/2023		1.163.339
Austria Government Bond 4,15% 15/03/2037		1.155.223
Bonos y Oblig Del Estado 1.950% 30/07/2030		1.088.681
Belgium Kingdom 4.250% 28/09/2021		1.085.100
Netherlands Government Bond 7,5% 15/01/2023		1.084.239
Bonos Y Oblig Del Estado 1.300% 31/10/2026		1.077.030
Buoni Poliennali del Tes 4.750% 01/09/2044		1.071.897
Republic of Austria .5000% 20/04/2027		1.046.420
Ireland Government Bond 5,4% 13/03/2025		1.033.640
Irish Tsy 2028 .9000% 15/05/2028		1.029.782
Netherlands Government Bond 5,5% 15/01/2028		1.018.765
Bonos y oblig del estado .2500% 30/07/2024		1.015.120
Austria Government Bond 4,85% 15/03/2026		1.015.022
Belgium Kingdom 5% 28/03/2035		1.001.844
Belgium Kingdom 4.250% 28/09/2022		997.330

Naam	Valuta	Waarde in euro's
Belgium Kingdom .8000% 22/06/2028		960.129
Bundesrepub. deutschland 0% 15/08/2050		943.383
Bonos Y Oblig Del Estado 1.450% 31/10/2027		927.503
Bonos Y Oblig Del Estado 2.350% 30/07/2033		885.559
Obrigacoes do Tesouro 5.650% 15/02/2024		866.999
Buoni Poliennali Del Tes 2.700% 01/03/2047		861.864
Bonos y oblig del estado 1.850% 30/07/2035		857.738
Luxembourg Government .6250% 01/02/2027		843.640
Portugal Obrigacoes d'Tesouro OT 4,95% 25/10/2023		837.620
Bonos Y Oblig Del Estado 5.150% 31/10/2044		832.388
Belgium Kingdom 1.250% 22/04/2033		817.885
Republic of austria 0% 15/07/2024		813.904
Spain Government Bond 4,2% 31/01/2037		808.928
Slovakia Government Bond 1.625% 21/01/2031		802.193
Obrigacoes Do Tesouro 1.950% 15/06/2029		798.112
Bonos y Oblig del Estado 2.750% 31/10/2024		795.347
Bonos Y Oblig Del Estado 2.900% 31/10/2046		792.529
Irish Tsy 2% 2045 2.000% 18/02/2045		790.953
Finnish Government 2.000% 15/04/2024		773.206
Belgium Kingdom .2000% 22/10/2023		768.540
Bundesrepub. Deutschland .5000% 15/08/2027		766.310
Obrigacoes do tesouro 2.875% 21/07/2026		764.108
Bonos y oblig del estado .6000% 31/10/2029		759.855
Republic Of Austria 1.750% 20/10/2023		759.486
Austria Government Bond 6,25% 15/07/2027		741.485
Belgium Kingdom of 2.600% 22/06/2024		725.984
Bonos y Oblig del Estado 1.500% 30/04/2027		710.320
Buoni Poliennali Del Tes 2.250% 01/09/2036		682.149
Belgium Kingdom 3.750% 22/06/2045		672.804
Bonos y Oblig del Estado 3.450% 30/07/2066		669.870
Belgium Kingdom 5,5% 28/03/2028		656.411
Republic of Austria 2.400% 23/05/2034		647.800
Republic of Austria 1.650% 21/10/2024		647.301
Republic of Austria 3.150% 20/06/2044		639.664
Spain Government Bond 4,9% 30/07/2040		600.467
Belgium Kingdom 4,25% 28/03/2041		594.706
Bonos y Oblig del Estado 3.800% 30/04/2024		584.570
Belgium Kingdom .5000% 22/10/2024		572.072
Bonos y oblig del estado 2.700% 31/10/2048		571.169

Naam	Valuta	Waarde in euro's
Buoni Poliennali Del Tes 2.950% 01/09/2038		566.025
Irish Tsy 1.7% 2037 1.700% 15/05/2037		533.160
Republic of Austria .7500% 20/10/2026		532.175
Finnish Government .5000% 15/09/2027		522.730
Finnish government .5000% 15/09/2028		522.500
Bonos y Oblig del Estado 1.400% 31/01/2020		500.775
Buoni Poliennali Del Tes 3.250% 01/09/2046		496.180
Republika Slovenija 2.250% 03/03/2032		486.732
Finnish Government 1.375% 15/04/2047		483.296
Belgium Kingdom 1.900% 22/06/2038		474.367
Belgium Kingdom 1.600% 22/06/2047		473.792
Obrigacoes Do Tesouro 2.125% 17/10/2028		460.240
Republic of Latvia 2.875% 30/04/2024		454.224
Portugal Obrigacoes d'Tesouro OT 4,1% 15/04/2037		446.568
Finnish Government 1.125% 15/04/2034		446.056
Slovakia Government bond 3.375% 15/11/2024		439.706
Republic Of Austria 2.100% 20/09/2117		428.120
Belgium Kingdom .8000% 22/06/2027		426.164
Obrigacoes do Tesouro 2.875% 15/10/2025		406.308
Slovakia Government Bond 1.875% 09/03/2037		392.766
Belgium Kingdom 4.500% 28/03/2026		388.590
Spain Government Bond 4,65% 30/07/2025		377.034
Finnish Government .5000% 15/04/2026		365.862
Obrigacoes Do Tesouro 2.250% 18/04/2034		358.434
Buoni poliennali del tes 3.100% 01/03/2040		343.350
Republic Of Lithuania 2.125% 29/10/2026		342.711
Republic of Austria 3.800% 26/01/2062		333.302
Republika Slovenija 1.250% 22/03/2027		325.587
Belgium Kingdom .9000% 22/06/2029		322.974
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4% 01/02/2037		321.543
Obrigacoes do tesouro 4.100% 15/02/2045		316.658
Buoni Poliennali Del Tes 2.800% 01/03/2067		312.597
Republic of Austria 1.500% 20/02/2047		304.340
Belgium kingdom 1.700% 22/06/2050		300.658
Belgium Kingdom 4.000% 28/03/2032		290.518
Irish tsy 1.5% 2050 1.500% 15/05/2050		286.365
Belgium Kingdom 2.250% 22/06/2057		274.752
Buoni poliennali del tes 3.850% 01/09/2049		258.686
Slovakia Government Bond 2.000% 17/10/2047		255.728

Naam	Valuta	Waarde in euro's
Republic Of Lithuania 2.100% 26/05/2047		255.674
Belgium Kingdom 1.000% 22/06/2031		250.150
Finnish Government .7500% 15/04/2031		213.550
Belgium Kingdom 2.150% 22/06/2066		206.111
Finnish Government 2.625% 04/07/2042		205.656
Belgium Kingdom 1.450% 22/06/2037		205.396
Republic Of Austria 1.500% 02/11/2086		192.767
Republika Slovenija 1.750% 03/11/2040		116.230
Irish tsy 2.4% 2030 2.400% 15/05/2030		66.245
Totaal waarde in euro's		539.894.758

2.2. Achmea IM Euro Investment Grade Credit Fund

TABEL 2.2.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
Achmea IM Euro Local Government Loans Fund	18.838.633
Efsf .0500% 17/10/2029	9.624.389
Kfw .0100% 05/05/2027	8.038.428
Euro stability mechanism 0% 14/03/2025	7.565.678
Kfw .2500% 15/09/2025	6.448.386
Abn amro bank nv .2500% 03/12/2021	6.063.009
Dnb bank asa .0500% 14/11/2023	5.578.698
Procter & Gamble Co/The 4,125% 07/12/2020	5.209.878
Societe Generale .2500% 18/01/2022	5.027.976
Unicredit Spa 2.625% 31/10/2020	5.018.139
Unicredit bank ag .0100% 10/09/2024	3.617.047
Volkswagen bank gmbh .3750% 05/07/2022	3.609.141
Ing bank nv ZC 08/04/2022	3.504.422
Land schleswig-holstein .3750% 30/10/2024	3.492.140
ING-Diba AG .2500% 09/10/2023	3.459.011
Pfizer Inc .2500% 06/03/2022	3.226.572
Royal Bk Of Scotland Plc .5000% 15/05/2024	3.165.293
Institut Credito Oficial .0500% 30/07/2020	3.106.231
Kommunekredit 0% 27/08/2030	3.099.648
Credit Suisse Guernsey 1.750% 15/01/2021	3.062.925
Agence francaise develop .2500% 29/06/2029	2.980.230
Bpifrance financement sa .0500% 26/09/2029	2.734.474
Efsf 0% 19/04/2024	2.726.798
European Investment Bank .1250% 20/06/2029	2.712.558
Op mortgage bank .0100% 19/11/2026	2.590.860
Euro Stability Mechanism 1.000% 23/09/2025	2.556.972
Muenchener hypotheekbank .0100% 05/09/2023	2.518.583
Daimler intl finance bv .2500% 06/11/2023	2.497.220
Toronto-dominion bank .1000% 19/07/2027	2.490.585
Sumitomo mitsui finl grp .6320% 23/10/2029	2.459.567
Eurofima .2500% 09/02/2024	2.439.024
Efsf .8750% 10/04/2035	2.339.789
Essilorluxottica .3750% 27/11/2027	2.294.137
Carnival plc 1.000% 28/10/2029	2.271.089
Unedic .5000% 20/03/2029	2.261.313
Banco Popular Espanol Sa 1.000% 03/03/2022	2.260.505
Stryker corp .2500% 03/12/2024	2.202.024

Naam	Waarde in euro's
Fomento Economico Mex 1.750% 20/03/2023	2.198.778
Westlake chemical corp 1.625% 17/07/2029	2.190.769
Abbvie inc 1.250% 18/11/2031	2.138.696
Telstra Corp Ltd 4,25% 23/03/2020	2.120.559
Nationwide bldg society .0500% 03/06/2024	2.103.503
Neder waterschapsbank 0% 16/11/2026	2.100.910
Intesa sanpaolo spa 1.000% 19/11/2026	2.093.896
Land nordrhein-westfalen .2500% 13/03/2026	2.041.440
Deutsche Telekom Int Fin .6250% 03/04/2023	2.034.705
Province of quebec 0% 15/10/2029	2.031.251
GE Capital Euro Funding 2.250% 20/07/2020	2.024.220
Telenor Asa 4,125% 26/03/2020	2.019.680
Kfw 0% 30/09/2026	2.012.453
Santander uk plc .1000% 12/05/2024	2.009.161
E.on se 0% 24/10/2022	1.997.926
Orange Sa 1.125% 15/07/2024	1.976.301
Standard Chartered Plc 1.625% 13/06/2021	1.947.007
Land niedersachsen .1250% 07/03/2025	1.926.685
European investment bank .0500% 13/10/2034	1.906.502
Bank of Scotland PLC 4,75% 08/06/2022	1.902.768
Banque fed cred mutuel .1250% 05/02/2024	1.895.503
Bpce sfh - societe de fi .0100% 08/11/2026	1.894.730
Vicinity centres trust 1.125% 07/11/2029	1.870.354
Sparebank 1 boligkreditt .1250% 05/11/2029	1.865.387
Efsf 1.700% 13/02/2043	1.771.441
Bk Nederlandse Gemeenten .5000% 16/04/2025	1.755.375
Deutsche Bank Ag 1.625% 12/02/2021	1.720.475
Becton dickinson euro .1740% 04/06/2021	1.704.624
Royal bank of canada .0500% 19/06/2026	1.697.834
Skandinaviska enskilda .0500% 01/07/2024	1.688.301
Nrw.bank .6250% 02/02/2029	1.673.376
Agence francaise develop .5000% 31/05/2035	1.650.105
Bnp Paribas 1.625% 23/02/2026	1.635.806
OeBB Infrastruktur AG 3.500% 19/10/2026	1.612.489
Volkswagen Leasing Gmbh .5000% 20/06/2022	1.610.106
Snam Spa ZC 25/10/2020	1.602.960
Naturgy finance bv .7500% 28/11/2029	1.596.531
Unedic .8750% 25/05/2028	1.593.087
Wintershall dea finance 1.823% 25/09/2031	1.565.285

Naam	Waarde in euro's
Banco santander sa .1250% 04/06/2030	1.563.096
Ck Hutchison Eur Fin 18 1.250% 13/04/2025	1.544.038
Heineken NV 2.125% 04/08/2020	1.521.315
Bayer ag VAR 12/05/2079	1.519.800
Becton dickinson euro .6320% 04/06/2023	1.514.561
Ing-diba ag .1250% 23/05/2027	1.511.339
Societe Du Grand Paris 1.125% 22/10/2028	1.509.644
Rci Banque SA .5000% 15/09/2023	1.496.817
Bp capital markets plc 1.231% 08/05/2031	1.455.505
European investment bank 1.000% 14/11/2042	1.422.499
Bpifrance Financement Sa .1250% 25/11/2023	1.415.335
Bpce sa .6250% 26/09/2024	1.414.863
Ing Bank Nv .3750% 26/11/2021	1.413.118
Bank of America Corp VAR 07/02/2022	1.412.425
Landbk hessen-thuringen 0% 03/07/2024	1.408.564
Dassault systemes 0% 16/09/2022	1.401.712
Met life glob funding i 0% 23/09/2022	1.396.901
Caisse refinance l'habit .0100% 08/10/2029	1.367.653
Allianz Se 3.000% 13/03/2028	1.354.370
Bpce sfh - societe de fi .6250% 22/09/2027	1.350.549
Societe generale sfh .2500% 11/09/2023	1.320.640
Bank of America Corp 2.500% 27/07/2020	1.320.319
Banco De Sabadell Sa .8750% 05/03/2023	1.314.974
Bank of queensland ltd .1250% 04/06/2024	1.302.470
Telefonica emisiones sau 1.788% 12/03/2029	1.297.233
Berlin hyp ag .0100% 19/07/2027	1.296.059
Rci banque sa .2500% 08/03/2023	1.288.869
Romania 2.000% 08/12/2026	1.284.679
Sumitomo mitsui banking .4090% 07/11/2029	1.283.432
Sabic Capital I BV 2.750% 20/11/2020	1.280.775
Dh europe finance .7500% 18/09/2031	1.266.525
UBS AG/London 4% 08/04/2022	1.260.548
Caisse Des Depots Et Con .7500% 18/09/2028	1.258.944
Unedic .6250% 03/03/2026	1.249.294
Efsf 2.350% 29/07/2044	1.244.913
Pepsico inc .8750% 16/10/2039	1.235.132
ABN AMRO Bank NV 2.500% 29/11/2023	1.216.624
Aib group plc VAR 19/11/2029	1.216.380
Anheuser-busch inbev nv 2.750% 17/03/2036	1.214.502

Naam	Waarde in euro's
Standard Chartered Plc Var 03/10/2023	1.213.545
ING Bank NV 4.500% 21/02/2022	1.207.950
Bank of ireland group VAR 25/11/2025	1.206.308
General Electric Co .8750% 17/05/2025	1.204.327
De Volksbank Nv .1250% 28/09/2020	1.202.544
Toyota finance australia 0% 09/04/2021	1.202.491
Svenska handelsbanken ab .1250% 18/06/2024	1.198.223
Land nordrhein-westfalen 1.100% 13/03/2034	1.197.884
Ing groep nv VAR 13/11/2030	1.194.944
Axa home loan sfh .0500% 05/07/2027	1.193.187
Fairfax Finl Hldgs Ltd 2.750% 29/03/2028	1.186.783
La banque post home loan .0100% 22/10/2029	1.171.453
Transurban finance co 1.450% 16/05/2029	1.148.351
Axa sa VAR 3.941 % 29-11-2049	1.131.398
Emirates Telecom Corp 1.750% 18/06/2021	1.128.996
BASF Se 2.500% 22/01/2024	1.127.236
Innogy Finance Bv .7500% 30/11/2022	1.119.030
Cppib capital inc .7500% 15/07/2049	1.116.305
Mms usa financing inc 1.750% 13/06/2031	1.114.544
Ubs Ag London .2500% 10/01/2022	1.106.813
Abertis infraestructuras 3.000% 27/03/2031	1.104.639
Lloyds bk corp mkts plc .2500% 04/10/2022	1.103.647
Dnb bank asa .2500% 09/04/2024	1.102.787
Shell International Fin 1.875% 15/09/2025	1.101.673
Canadian imperial bank .3750% 03/05/2024	1.096.252
Dover corp .7500% 04/11/2027	1.090.925
Citigroup inc VAR 08/10/2027	1.087.823
Lb baden-wuerttemberg .0100% 18/09/2028	1.087.395
Novartis Finance SA 1.625% 09/11/2026	1.073.658
Lloyds bank plc .1250% 23/09/2029	1.069.056
Hypo Alpe-Adria Intl AG 2.375% 13/12/2022	1.069.009
Tennet holding bv 1.500% 03/06/2039	1.051.503
Telefonica Emisiones SAU 3.961% 26/03/2021	1.051.351
Glencore Finance Europe 1.875% 13/09/2023	1.043.941
Bg Energy Capital Plc 1.250% 21/11/2022	1.032.285
National Bank Greece Sa 2.750% 19/10/2020	1.020.540
Banco Popular Espanol Sa .8750% 28/09/2021	1.019.965
Nibc bank nv .5000% 19/03/2027	1.019.841
Wells Fargo & Company 2.250% 03/09/2020	1.016.810

Naam	Waarde in euro's
Prologis LP 1.375% 13/05/2021	1.016.323
Santan Consumer Finance 1.000% 26/05/2021	1.016.294
AT&T Inc 1.875% 04/12/2020	1.013.680
Fca bank spa ireland .6250% 24/11/2022	1.009.996
Neder waterschapsbank .1250% 28/05/2027	1.008.454
National Grid PLC 4,375% 10/03/2020	1.008.340
European Union 1.250% 04/04/2033	1.008.254
Banque Fed Cred Mutuel .3750% 13/01/2022	1.008.137
Santander Consumer Finance .9000% 18/02/2020	1.001.560
Anheuser-Busch Inbev Nv 1.875% 20/01/2020	1.000.420
Abbey Natl Treasury Serv .8750% 13/01/2020	1.000.390
Unicredit bank ag .0100% 19/11/2027	990.904
Volkswagen fin serv ag 2.250% 16/10/2026	966.888
Deutsche telekom ag 1.750% 09/12/2049	955.035
Land Nordrhein-Westfalen 1.550% 16/06/2048	953.687
Caixabank Sa VAR 14/07/2028	951.068
Unicredit bank ag .8500% 22/05/2034	947.219
Procter & Gamble Co/The 4,875% 11/05/2027	937.354
Unicredit Bank Ag .6250% 20/11/2025	934.899
Bnp Paribas 1.125% 11/06/2026	932.145
Caisse Francaise De Fin .5000% 19/02/2027	927.884
Argenta spaarbank 1.000% 06/02/2024	925.394
Veolia Environnement Sa .8920% 14/01/2024	925.252
Luxottica Group SpA 2.625% 10/02/2024	924.087
Statoil ASA .8750% 17/02/2023	923.204
Caisse d'amort dette soc .1250% 25/10/2023	914.552
Chubb ina holdings inc .3000% 15/12/2024	899.639
Credit Agricole SA 4.250% 04/02/2023	899.336
Hsbc france .1000% 03/09/2027	872.055
Sncf Reseau Epic 2.250% 20/12/2047	871.416
Vattenfall AB 6,25% 17/03/2021	861.728
Banque Fed Cred Mutuel 1.625% 19/01/2026	860.339
Dexia Municipal Agency SA 4,875% 02/06/2021	859.021
Intesa Sanpaolo Spa 5.000% 27/01/2021	843.802
NN Group NV VAR 13/01/2048	842.021
Intl Flavor & Fragrances 1.800% 25/09/2026	837.471
United Mexican States 1.375% 15/01/2025	832.876
Euro Stability Mechanism 1.625% 17/11/2036	831.453
Bnp Paribas 1.125% 28/08/2024	827.030

Naam	Waarde in euro's
Selp finance sarl 1.500% 20/12/2026	818.035
Eurobank Ergasias Sa 2.750% 02/11/2020	817.040
Transurban Finance Co 2.500% 08/10/2020	810.992
Credit Agricole Home Loan .3750% 21/10/2021	810.105
Citigroup Inc .5000% 29/01/2022	808.718
Lloyds Banking Group Plc VAR 15/01/2024	806.731
Aegon Bank .2500% 01/12/2020	804.232
Neder Financierings-Maat VAR 08/12/2025	804.040
Bmw Finance Nv .1250% 29/11/2021	803.390
Nationwide Bldg Society .1250% 25/01/2021	803.161
Medtronic global hldings .2500% 02/07/2025	801.288
Eli lilly & co .6250% 01/11/2031	799.237
Daimler ag .7500% 08/02/2030	777.852
Auckland council .1250% 26/09/2029	775.656
Bayer Capital Corp bv 2.125% 15/12/2029	771.073
EDF SA 5,625% 21/02/2033	768.317
African Development Bank .8750% 24/05/2028	763.948
Total Sa VAR 29/12/2049	755.405
Neder waterschapsbank 0% 02/10/2034	742.736
Euro Stability Mechanism .7500% 15/03/2027	740.221
Wells Fargo & Company 1.375% 26/10/2026	738.118
Unicredit bk austria ag .6250% 16/01/2026	725.645
Ap Moller-Maersk A/S 1.750% 16/03/2026	724.980
BP Capital Markets Plc .8300% 19/09/2024	719.768
British Sky Broadcasting 1.500% 15/09/2021	718.935
Bpce sfh - societe de fi .6250% 29/05/2031	718.823
Telenor asa .7500% 31/05/2026	716.356
Banque Fed Cred Mutuel .7500% 15/06/2023	715.638
Bpce Sa .6250% 26/09/2023	713.226
Berlin Hyp Ag .2500% 30/05/2023	710.727
Morgan stanley VAR 26/07/2024	710.329
Republic of chile .8300% 02/07/2031	709.016
Santander consumer bank .2500% 05/12/2024	708.873
Aust & nz banking group .2500% 29/11/2022	708.761
British Telecommunication .6250% 10/03/2021	705.989
United Overseas Bank Ltd .1250% 02/03/2022	704.547
Psa Banque France .6250% 21/06/2024	704.539
Medtronic global hldings ZC 07/03/2021	701.563
Servicios medio ambiente 1.661% 04/12/2026	700.006

Naam	Waarde in euro's
Mitsubishi ufj fin grp .3390% 19/07/2024	699.413
Efsf 1.450% 05/09/2040	697.050
Danske bank a/s VAR 12/02/2030	696.882
Merck & Co Inc 1.875% 15/10/2026	687.938
Coca-cola hbc finance bv .6250% 21/11/2029	683.301
Nn bank nv netherlands .1250% 24/09/2029	682.534
Belfius bank sa/nv 0% 28/08/2026	678.055
Renault sa 1.125% 04/10/2027	670.491
Abn amro bank nv 1.125% 23/04/2039	655.559
Anheuser-busch inbev sa/ 1.650% 28/03/2031	652.684
Roche Finance Europe BV .8750% 25/02/2025	651.076
Glaxosmithkline Capital 1.000% 12/09/2026	629.797
Council of europe .6250% 30/01/2029	629.459
Argentum Givaudan 1.125% 17/09/2025	627.041
Argenta Spaarbank 3.875% 24/05/2026	625.763
Efsf 1.750% 17/07/2053	622.883
Adif - Alta Velocidad .9500% 30/04/2027	622.296
Land brandenburg .7000% 22/05/2034	620.874
Ageas finance nv VAR	618.498
European investment bank .3750% 16/07/2025	618.011
Westpac banking corp .5000% 04/12/2023	613.901
Fcc Aqualia Sa 1.413% 08/06/2022	613.706
Korea Housing Finance Co .7500% 30/10/2023	613.678
Enexis Holding NV 1.875% 13/11/2020	610.974
Erste Group Bank Ag .2500% 26/06/2024	609.989
Agence Francaise Develop .2500% 21/07/2026	606.170
Societe Generale .5000% 13/01/2023	604.766
Verizon Communications 2.875% 15/01/2038	604.356
Enbw VAR 05/11/2079	604.281
Islandsbanki VAR 19/01/2024	604.242
Berlin hyp ag .0000% 10/10/2022	604.201
LB Baden-Wuerttemberg .0500% 11/11/2021	604.022
Intesa sanpaolo spa .7500% 04/12/2024	603.421
PerkinElmer Inc .6000% 09/04/2021	602.970
Bnp paribas VAR 04/06/2026	602.650
Nordea bank abp .3750% 28/05/2026	601.503
E.on se 0% 29/09/2022	599.906
Santander consumer bank .1250% 11/09/2024	594.553
Dassault systemes .3750% 16/09/2029	587.186

Naam	Waarde in euro's
Apple inc 1.375% 17/01/2024	580.593
BMW US Capital LLC 1.000% 20/04/2027	575.206
Flemish community 1.500% 12/07/2038	562.405
Aviva Plc VAR 03/07/2044	556.921
ABN Amro Bank NV 4.125% 28/03/2022	546.606
Aviva Plc 1.875% 13/11/2027	546.558
Volkswagen Bank Gmbh 2.500% 31/07/2026	545.210
Mastercard Inc 2.100% 01/12/2027	544.791
Wells Fargo & Company 1.625% 02/06/2025	542.689
Nordea Bank Ab 3.250% 05/07/2022	540.690
Ck Hutchison Finance 16 2.000% 06/04/2028	538.100
Neder Waterschapsbank 1.000% 01/03/2028	537.483
Ibm Corp 1.250% 29/01/2027	529.399
Schneider Electric Se 1.500% 08/09/2023	525.422
Anheuser-Busch Inbev NV 1.500% 18/04/2030	519.608
Orange sa 1.000% 12/09/2025	518.534
Capital one financial co 1.650% 12/06/2029	517.330
Societe Generale 1.250% 15/02/2024	516.696
Aroundtown SA 1.625% 31/01/2028	516.063
Deutsche Bank Ag .5000% 22/01/2026	515.781
Societe Generale Sfh .5000% 30/01/2025	514.854
Credit Mutuel Arkea VAR 25/10/2029	512.784
Sinopec Group Oversea 2013 2.625% 17/10/2020	510.200
Fidelity natl info serv .7500% 21/05/2023	510.141
European investment bank .0500% 24/05/2024	507.025
Abn amro bank nv .5000% 15/04/2026	506.350
Nordea Bank Ab .3000% 30/06/2022	504.660
Banco bpi sa .2500% 22/03/2024	504.574
Vodafone Group Plc .3750% 22/11/2021	504.322
Jpmorgan chase & co VAR 04/11/2032	504.033
Diageo finance plc .2500% 22/10/2021	503.289
Bank of ireland group VAR 08/07/2024	503.093
Yorkshire Building Soc .1250% 08/05/2024	502.049
Rci Banque Sa .2500% 12/07/2021	501.853
Fidelity natl info serv .1250% 21/05/2021	501.456
Abbott Ireland Financing 0% 27/09/2020	500.725
Bpce sa .1250% 04/12/2024	498.093
Banco santander sa .2500% 10/07/2029	497.642
Danske bank a/s VAR 27/08/2025	494.077

Naam	Waarde in euro's
Bacardi Ltd 2.750% 03/07/2023	484.547
Allergan Funding Scs 2.625% 15/11/2028	459.513
NN Group NV VAR	458.949
Bg Energy Capital Plc 2.250% 21/11/2029	457.575
Republic Of Indonesia 3.375% 30/07/2025	454.576
Autoroutes Du Dud De La 2.950% 17/01/2024	444.163
Republic Of Poland 1.375% 22/10/2027	438.850
Omv Ag Var	436.323
Vodafone group plc 2.500% 24/05/2039	432.662
Ing Groep Nv 1.375% 11/01/2028	426.030
Agence Francaise Develop 1.000% 31/01/2028	424.969
Credit mutuel arkea 1.625% 15/04/2026	421.803
Siemens financieringsmat .9000% 28/02/2028	418.607
Chubb Ina Holdings Inc 1.400% 15/06/2031	416.878
Wolters Kluwer NV 1.500% 22/03/2027	416.859
Bp Capital Markets Plc 1.077% 26/06/2025	416.707
General Electric Co 1.250% 26/05/2023	416.331
Nationwide Bldg Society Var 25/07/2029	415.358
Sap se .7500% 10/12/2024	412.825
At&T Inc 3.150% 04/09/2036	411.999
Standard Chartered Plc VAR 21/10/2025	411.888
Aib group plc 1.250% 28/05/2024	410.926
Banco Santander Sa .7500% 09/09/2022	410.679
Leaseplan Corporation Nv 1.000% 02/05/2023	407.821
Deutsche Genossen-Hypobk .8750% 21/07/2021	407.392
Efsf .2000% 17/01/2024	407.345
Santander Uk Plc .3750% 20/09/2023	406.710
Hsh Nordbank AG .3750% 12/07/2023	406.672
Asb Finance Ltd .5000% 10/06/2022	405.271
National Australia Bank .2500% 28/03/2022	404.275
Lg chem ltd .5000% 15/04/2023	402.946
Banco de Sabadell SA .6250% 03/11/2020	402.884
Mizuho financial group .5230% 10/06/2024	402.847
Berlin Hyp Ag 0% 29/11/2021	402.304
Westpac sec nz/london .1250% 16/06/2021	402.105
Fidelity National Inform .4000% 15/01/2021	401.848
Sanofi 0.00% 13/01/2020	400.012
Landsbankinn hf VAR 06/09/2028	398.324
British telecommunicatio 1.125% 12/09/2029	395.536

Naam	Waarde in euro's
Medtronic global hldings 1.750% 02/07/2049	390.121
Credit mutuel arkea .3750% 03/10/2028	389.628
Cppib capital inc .8750% 06/02/2029	369.740
Diageo finance plc .1250% 12/10/2023	359.736
Credit mutuel arkea 3.375% 11/03/2031	351.768
Statoil Asa 2.875% 10/09/2025	346.651
NN Group NV VAR 08/04/2044	344.713
Romania 3.625% 24/04/2024	343.900
Delta Lloyd NV VAR	337.049
Orange Sa 2.000% 15/01/2029	334.109
Aviva Plc VAR 04/12/2045	331.972
Telia Co Ab 2.125% 20/02/2034	329.300
Rte reseau de transport 1.500% 27/09/2030	327.495
Allianz Finance II BV Var 08/07/2041	325.516
Compass Group Finance Nv 1.500% 05/09/2028	324.672
BP Capital Markets Plc 1.573% 16/02/2027	323.466
Republic Of Chile 1.440% 01/02/2029	322.956
Apt Pipelines Ltd 2.000% 22/03/2027	322.843
Omv ag VAR	321.989
Siemens Financieringsmat 2.875% 10/03/2028	321.204
Cred Mutuel- Cic Home Lo 1.000% 30/01/2029	321.023
Deutsche Telekom Int Fin 1.500% 03/04/2028	320.929
RTE Reseau de Transport 1.625% 08/10/2024	320.338
Dz Hyp Ag .8750% 30/01/2029	319.236
Landbk Hessen-Thuringen .8750% 20/03/2028	319.016
Bpifrance Financement Sa 1.000% 25/05/2027	318.925
Petroleos Mexicanos 4.750% 26/02/2029	317.967
European union .7500% 04/04/2031	317.559
Credit Agricole Sa 4.000% 29/06/2021	317.499
Siemens Financieringsmat 1.000% 06/09/2027	317.202
Prologis Ip 3.000% 18/01/2022	316.408
United Mexican States 1.625% 06/03/2024	315.350
Selp Finance Sarl 1.500% 20/11/2025	315.056
Republic Of Indonesia 1.750% 24/04/2025	314.949
RWE AG 5,75% 14/02/2033	313.172
Verizon communications 1.250% 08/04/2030	312.612
AT&T 1.3% 05/09/2023	310.542
Ausgrid Finance Pty Ltd 1.250% 30/07/2025	309.572
Engie sa 1.375% 21/06/2039	309.241

Naam	Waarde in euro's
La Banque Post Home Loan .5000% 30/01/2026	309.208
Dexia Credit Local .6250% 03/02/2024	308.953
Sns Bank Nv VAR 05/11/2025	308.787
Intesa Sanpaolo Spa 2.000% 18/06/2021	308.475
Telfonica Deutsch Finan 2.375% 10/02/2021	307.926
Glencore Finance Europe 2.750% 01/04/2021	307.711
Soc Cattolica Assicurazi VAR 14/12/2047	307.398
Landsbankinn hf 1.375% 14/03/2022	306.849
Intesa Sanpaolo Spa 1.125% 04/03/2022	305.963
Bp capital markets plc .8310% 08/11/2027	305.948
Cred Mutuel- Cic Home Lo .2500% 30/04/2024	305.300
Pko Bank Hipoteczny .6250% 24/01/2023	305.255
Wintershall dea finance 1.332% 25/09/2028	305.248
Deutsche Bank Ag 1.500% 20/01/2022	303.976
Bank of nova scotia .2500% 28/09/2022	303.891
Carlsberg breweries a/s .8750% 01/07/2029	303.666
France Telecom SA 3,875% 09/04/2020	303.276
Rci banque sa VAR 18/02/2030	303.135
Glencore Finance Europe 1.250% 17/03/2021	303.097
Mckesson Corp .6250% 17/08/2021	302.931
Commonwealth Bank Aust .3750% 10/02/2021	302.216
Bankinter Sa .6250% 09/10/2020	302.082
Nibc bank nv .8750% 08/07/2025	301.616
Astrazeneca Plc .2500% 12/05/2021	301.435
Unibail-Rodamco Se .1250% 14/05/2021	300.964
Ind & comm bk china/sg .2500% 25/04/2022	300.509
Sanofi ZC 21/03/2020	300.117
Pernod ricard sa .8750% 24/10/2031	299.974
Raiffeisen bank intl VAR 12/03/2030	298.707
GE Capital European Funding 6,025% 01/03/2038	298.521
Kommunekredit .6250% 21/11/2039	296.424
Abertis infraestructuras .6250% 15/07/2025	295.526
Electricite de france sa 2.000% 09/12/2049	292.137
Siemens financieringsmat .1250% 05/09/2029	289.633
Siemens financieringsmat .5000% 05/09/2034	283.818
Atlantia Spa 1.875% 13/07/2027	279.030
Thermo fisher scientific 1.875% 01/10/2049	276.580
Sodexo 2.500% 24/06/2026	274.398
Orange sa 1.375% 04/09/2049	271.286

Naam	Waarde in euro's
Euro Stability Mechanism 1.800% 02/11/2046	255.920
Assicurazioni Generali VAR 27/10/2047	245.494
United Mexican States 3.375% 23/02/2031	242.833
Aviva Plc VAR 05/07/2043	235.023
Credit Mutuel Arkea 3.500% 09/02/2029	233.923
BP Capital Markets Plc 2.972% 27/02/2026	232.220
Republic of Poland 3.375% 09/07/2024	230.782
Illinois Tool Works Inc 2.125% 22/05/2030	228.757
IPIC Gmtn Ltd 3.625% 30/05/2023	224.134
United Mexican States 4.000% 15/03/2115	224.100
At&T Inc 2.350% 05/09/2029	223.127
Ibm Corp 1.750% 31/01/2031	220.921
Vodafone Group PLC 4,65% 20/01/2022	219.591
Societe Generale 2.625% 27/02/2025	218.355
Bp Capital Markets Plc 1.953% 03/03/2025	217.311
Republic of Poland 1.500% 09/09/2025	217.037
Romania 2.500% 08/02/2030	216.186
OMV AG 4.250% 12/10/2021	215.619
Eni Spa 1.500% 02/02/2026	213.873
Petroleos mexicanos 4.875% 21/02/2028	213.803
Aprr Sa 1.250% 18/01/2028	213.093
Dz hyp ag .8750% 17/04/2034	211.795
Oebb Infrastruktur Ag 1.000% 18/11/2024	211.779
Banco Santander Sa .8750% 09/05/2031	210.415
Telia Co AB VAR 04/04/2078	210.313
Danske bank a/s VAR 21/06/2029	210.079
Medtronic global hldings 1.125% 07/03/2027	209.818
Vesteda finance bv 1.500% 24/05/2027	208.465
Danske bank a/s 1.625% 15/03/2024	208.304
Pepsico Inc .8750% 18/07/2028	208.182
Anheuser-Busch Inbev NV 1.950% 30/09/2021	207.596
Credit mutuel arkea 1.125% 23/05/2029	207.484
Glencore Finance Europe 1.750% 17/03/2025	207.302
Ing Groep Nv VAR 26/09/2029	206.874
Dz Hyp Ag .5000% 13/11/2025	206.676
Intesa Sanpaolo Spa 1.750% 20/03/2028	206.627
Eurogrid GMBH 3.875% 22/10/2020	206.512
Cassa Depositi E Prestit 1.500% 21/06/2024	206.157
At&t Inc 1.450% 01/06/2022	205.867

Naam	Waarde in euro's
Intesa Sanpaolo Spa 1.375% 18/01/2024	205.852
Chorus Ltd 1.125% 18/10/2023	205.185
National Australia Bank 1.375% 28/05/2021	204.614
Intesa sanpaolo spa 1.750% 04/07/2029	204.212
Nestle Finance Intl Ltd .3750% 18/01/2024	203.529
Nortegas Energia Distri .9180% 28/09/2022	203.379
Dbs Bank Ltd .3750% 21/11/2024	203.340
Santan Consumer Finance 1.500% 12/11/2020	202.934
Leaseplan Corporation Nv .7500% 03/10/2022	202.602
Veolia Environnement Sa .6720% 30/03/2022	202.538
European Investment Bank .5000% 13/11/2037	202.228
Abbey Natl Treasury Serv .2500% 21/04/2022	201.923
Axa Bank Europe Scf .1250% 14/03/2022	201.669
Banco Popular Espanol Sa .7500% 29/09/2020	201.530
Royal Bank of Canada .5000% 16/12/2020	201.509
Enbw VAR 05/08/2079	201.322
E.On Se .3750% 23/08/2021	201.290
Rci Banque Sa .7500% 10/04/2023	201.063
Yorkshire Building Soc .5000% 19/06/2020	200.688
Leaseplan Corporation NV 1.000% 08/04/2020	200.600
Deutsche telekom ag .5000% 05/07/2027	199.427
Omv ag 0% 03/07/2025	197.925
Unibail-rodamco se 1.750% 01/07/2049	196.437
Abertis infraestructuras 1.875% 26/03/2032	195.765
Vonovia finance bv 1.625% 07/10/2039	191.843
Prologis euro finance 1.500% 10/09/2049	179.531
Abbott ireland financing 1.500% 27/09/2026	161.014
Fiserv inc 1.625% 01/07/2030	155.426
Chubb Ina Holdings inc 1.550% 15/03/2028	155.254
Richemont International 2.000% 26/03/2038	136.635
Assicurazioni Generali VAR 08/06/2048	119.567
Telefonica Emisiones Sau 2.932% 17/10/2029	119.299
Chubb Ina Holdings Inc 2.500% 15/03/2038	116.847
Romania 2.875% 28/10/2024	111.800
Apple Inc 1.625% 10/11/2026	111.165
Telenor asa 1.750% 31/05/2034	109.555
Total capital intl sa 1.491% 04/09/2030	109.534
AT&T Inc 2.450% 15/03/2035	108.586
Fcc Aqualia Sa 2.629% 08/06/2027	106.943

Naam	Waarde in euro's
Electricite de France SA 6,25% 25/01/2021	106.873
Becton Dickinson and Co 1.900% 15/12/2026	106.786
Statoil ASA 1.250% 17/02/2027	106.702
Republic of indonesia 2.150% 18/07/2024	106.629
Lb baden-wuerttemberg 2.200% 09/05/2029	106.014
Bayerische landesbank .7500% 05/02/2029	105.418
Commonwealth Bank Aust .8750% 19/02/2029	105.095
SnCF Réseau .8750% 22/01/2029	104.479
European Union .5000% 04/04/2025	103.573
Credit agricole SA 1.000% 03/07/2029	103.528
CaixaBank SA Var 17/04/2030	103.271
Oversea-Chinese Banking .6250% 18/04/2025	102.983
Stockland trust 1.625% 27/04/2026	102.895
Total SA VAR 29/12/2049	102.149
Zf europe finance BV 2.000% 23/02/2026	102.147
CK Hutchison Finance 16 .8750% 03/10/2024	101.465
Fonterra Cooperative Grp .7500% 08/11/2024	101.343
Unicredit Bank AG .1250% 09/04/2021	100.542
Royal Bank Of Canada .1250% 11/03/2021	100.489
Pko Bank Hipoteczny .1250% 24/06/2022	100.377
Merck Fin Services GmbH .8750% 05/07/2031	100.293
Autostrade Per L'Italia 1.750% 26/06/2026	94.500
Hutchison Whampoa Fin 1.375% 31/10/2021	51.141
Lehman Brothers Holdings 4,250 09/16 *Default*	9
Totaal waarde in euro's	492.131.499

2.3. Achmea IM Global Multi Factor Equity Fund

TABEL 2.3.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
Microsoft Corp	10.410.026
Apple Inc	9.326.167
Visa Inc	4.283.953
Procter & Gamble Co	4.279.425
Nestle SA	4.050.754
Intel Corp	4.046.766
Roche Holding AG	3.973.963
Merck & Co Inc	3.610.452
Amazoncom Inc	3.397.721
Alphabet Inc	3.391.133
Novartis AG	2.815.589
Accenture PLC	2.804.098
BHP Billiton Ltd	2.784.272
Amgen Inc	2.718.668
Texas Instruments Inc	2.643.974
PepsiCo Inc /NC	2.553.568
Starbucks Corp	2.546.821
Enel SpA	2.545.885
Rio Tinto PLC	2.514.315
AT&T Inc	2.508.814
Oracle Corp	2.414.566
Iberdrola SA	2.321.668
Applied Materials Inc	2.289.068
Zurich Insurance Group AG	2.276.293
Sanofi	2.248.835
Gilead Sciences Inc	2.243.532
International Business Machine	2.147.386
Novo Nordisk A/S-B	2.136.316
Comcast Corp	2.015.417
Cisco Systems Inc	1.959.716
Mastercard Inc	1.940.769
Medtronic PLC	1.934.563
Unilever NV	1.880.039
GlaxoSmithKline PLC	1.849.984
Lam Research Corp	1.626.499
HP Inc	1.591.916
Schneider Electric SA	1.557.513

Naam	Waarde in euro's
Astellas Pharma Inc	1.542.814
Micron Technology Inc	1.480.543
Allianz SE	1.391.208
Honda Motor Co Ltd	1.374.621
RELX PLC	1.342.097
KDDI Corp	1.324.558
Canon Inc	1.313.678
TE Connectivity Ltd	1.312.901
Diageo PLC	1.312.645
PACCAR Inc	1.277.650
Estee Lauder Cos Inc / The	1.271.624
Waste Management Inc	1.270.362
Sumitomo Mitsui Financial Grou	1.252.833
Southern Co	1.241.086
Target Corp	1.183.187
Woolworths Ltd	1.172.265
NXP Semiconductor NV	1.168.298
Alimentation Couche-Tard -B	1.160.312
Nippon Telegraph & Telephone C	1.152.000
Groupe Danone SA	1.151.066
General Mills Inc	1.149.262
CDW Corp/DE	1.148.446
Danaher Corp	1.143.751
Hitachi Ltd	1.142.206
McKesson Corp	1.113.091
KLA-Tencor Corp	1.112.670
Paychex Inc	1.087.556
Vinci SA	1.083.258
Verizon Communications Inc	1.075.772
NTT DoCoMo Inc	1.063.905
Johnson Controls International	1.041.559
L'Oreal SA	1.038.840
Tyson Foods Inc	1.032.787
Cummins Inc	1.020.670
Baxter International Inc	975.952
Air Products & Chemicals Inc	957.545
Koninklijke Ahold Delhaize NV	944.617
Hershey Co	940.672
Magna International Inc	929.376

Naam	Waarde in euro's
Motorola Inc	913.581
Bristol-Myers Squibb Co	911.755
Facebook Inc	905.660
Best Buy Co Inc	903.577
Automatic Data Processing Inc	889.790
Koninklijke Philips NV	887.155
Home Depot Inc	885.971
Xcel Energy Inc	873.815
Bridgestone Corp	862.860
HCA Healthcare Inc	855.915
American Tower Corp	855.401
Atlas Copco AB	827.074
Republic Services Inc	812.619
Ford Motor Co	812.377
Merck KGaA	801.081
ITOCHU Corp	788.870
Ingersoll-Rand PLC	786.034
Swiss Life Holding AG	776.297
Western Union Co	774.819
CGI Inc	758.137
Agilent Technologies Inc	757.644
Essity AB	753.886
Henkel AG & Co KGaA	753.366
Intuit Inc	726.404
Munich Re	720.883
Zoetis Inc	712.627
CK Asset Holdings Ltd	704.136
FUJIFILM Holdings Corp	693.045
Mitsui & Co Ltd	685.954
Kimberly-Clark Corp	682.787
VMware Inc	679.641
AbbVie Inc	678.268
Sysco Corp	678.224
Nippon Post Holdings Co Ltd	674.108
Eaton Corp PLC	670.255
Dover Corp	668.867
Assicurazioni Generali SpA	656.444
Omnicom Group Inc	653.862
Annaly Capital Management Inc	647.206

Naam	Waarde in euro's
Anglo American PLC	630.935
Seagate Technology	624.101
Thomson Reuters Corp	622.330
Schindler Holding AG	618.105
Volvo AB	616.745
Genuine Parts Co	603.216
Compagnie Generale des Etablis	600.705
CVS Health Corp	598.092
WEC Energy Group Inc	595.366
Avery Dennison Corp	584.465
3i Group PLC	581.920
Peugeot SA	579.381
FirstEnergy Corp	578.264
Daiwa House Industry Co Ltd	575.247
Deutsche Telekom AG	575.078
Hewlett Packard Enterprise Co	571.878
CBRE Group Inc	570.857
NN Group NV	563.407
Cadence Design Systems Inc	560.812
Cardinal Health Inc	559.377
Subaru Corp	557.414
Koninklijke DSM NV	557.280
Universal Health Services Inc	556.459
AmerisourceBergen Corp	552.081
Discovery Inc - A	550.149
Tokyo Electron Ltd	549.154
Persimmon PLC	544.216
Entergy Corp	541.208
Hannover Rueck SE	540.850
Johnson & Johnson	540.206
Swiss Re AG	536.600
Wolters Kluwer NV	534.269
Metro Inc	533.691
Smith & Nephew PLC	533.411
Barratt Developments PLC	532.678
Broadridge Financial Solutions	526.627
Vornado Realty Trust	524.535
Fortescue Metals Group Ltd	523.739
Swisscom AG	522.975

Naam	Waarde in euro's
Stryker Corp	521.437
Seven & I Holdings Co Ltd	520.114
BT Group PLC	520.021
Pinnacle West Capital Corp	518.189
Ageas	515.843
Thermo Fisher Scientific Inc	513.714
Emera Inc	512.558
Goodman Group	509.205
Coca-Cola European Partners PL	506.080
AutoZone Inc	505.179
Mondelez International Inc	504.184
Public Storage	501.049
Humana Inc	500.557
Yum! Brands Inc	498.939
Chocoladefabriken Lindt & Spru	497.774
Kohl's Corp	497.744
Allstate Corp	494.680
Carlsberg A/S	487.557
Legrand SA	485.816
Telenor ASA	485.100
Next PLC	484.431
Ameren Corp	482.078
WP Carey Inc	481.167
eBay Inc	478.743
ORIX Corp	477.172
RWE AG	476.628
Liberty Media Corp-Liberty For	470.542
Synopsys Inc	469.250
Sun Life Financial Inc	469.092
Open Text Corp	468.500
United Overseas Bank Ltd	468.446
Snap-on Inc	466.623
Delta Air Lines Inc	465.235
Equity Residential	464.542
Eastman Chemical Co	464.404
Globe Life Inc	461.600
AES Corp	459.889
JX Holdings, Inc.	459.698
Royal Dutch Shell PLC	458.777

Naam	Waarde in euro's
MTU Aero Engines Holding AG	455.734
HEICO Corp	455.278
Aflac Inc	454.445
JPMorgan Chase & Co	449.309
Mitsubishi Corp	449.308
Evergy Inc	448.005
Mettler-Toledo International I	447.346
ACS Actividades de Construccio	447.122
Canadian Pacific Railway Ltd	435.961
ResMed Inc	434.330
Terna Rete Elettrica Nazionale	433.588
CenturyLink Inc	431.970
Secom Co Ltd	431.434
STERIS PLC	430.171
PayPal Holdings Inc	428.922
VEREIT Inc	426.983
LafargeHolcim Ltd	425.055
Costco Wholesale Corp	423.664
Manulife Financial Corp	422.655
NEC Corp	422.070
Endesa SA	419.370
RenaissanceRe Holdings Ltd	418.758
Red Electrica Corp SA	418.136
AvalonBay Communities Inc	417.158
Keysight Technologies Inc	414.451
IDEX Corp	413.413
Intesa Sanpaolo SpA	412.108
Rockwell Automation Inc /DE	410.937
BNP Paribas	409.063
Zebra Technologies Corp	407.566
Rogers Communications Inc	406.344
Cooper Cos Inc / The	406.156
IQVIA Holdings Inc	405.511
Unibail-Rodamco SE & WFD Uniba	404.228
Aena SA	403.915
Sekisui House Ltd	399.930
Xilinx Inc	399.180
Healthpeak Properties Inc	398.102
Duke Realty Corp	397.632

Naam	Waarde in euro's
Truist Financial Corp	397.025
Intertek Group PLC	396.418
OMV AG	396.283
Woodside Petroleum Ltd	395.849
Mowi ASA	395.612
Jack Henry & Associates Inc	393.341
Oversea-Chinese Banking Corp L	393.166
Baloise Holding AG	392.341
Berkeley Group Holdings PLC	392.000
Welltower Inc	391.815
Eiffage SA	391.782
Garmin Ltd	391.544
Deutsche Post AG	391.489
Marubeni Corp	391.167
Taisei Corp	391.058
Quest Diagnostics Inc /DE	389.296
Tractor Supply Co	384.498
Compass Group PLC	383.866
Essex Property Trust Inc	381.670
Tesco PLC	381.594
Lear Corp	380.493
Royal Bank of Canada	379.842
VeriSign Inc	377.121
Mondi PLC	375.230
Fiat Chrysler Automobiles NV	373.060
Colgate-Palmolive Co	372.625
Stora Enso OYJ	371.227
National Grid PLC	368.448
Halma Plc	368.062
SSE PLC	367.676
Darden Restaurants Inc	366.798
Orsted A/S	366.514
Kuehne + Nagel International A	366.036
Vertex Pharmaceuticals Inc	364.754
Denso Corp	364.509
Xylem Inc/NY	360.223
Hormel Foods Corp	359.835
Sonova Holding AG	359.454
Packaging Corp of America	358.268

Naam	Waarde in euro's
HollyFrontier Corp	355.128
Swiss Prime Site AG	354.024
Elanco Animal Health Inc	352.298
TELUS Corp	352.057
Ally Financial Inc	351.719
Teleperformance	349.797
Veolia Environnement	348.727
Tiffany & Co	348.264
Taylor Wimpey PLC	346.906
Sumitomo Corp	346.626
Interpublic Group of Cos Inc	344.946
Ventas Inc	344.280
Swedbank AB	342.701
Osaka Gas Co Ltd	342.684
FLIR Systems Inc	342.294
Sandvik AB	341.999
Bunzl PLC	339.524
Macquarie Group Ltd	339.435
NVR Inc	339.279
Sage Group PLC/The	338.325
Liberty Property Trust	337.082
UCB SA	336.775
Sampo Oyj	336.105
Manpower Group Inc	335.806
Whirlpool Corp	335.409
Skandinaviska Enskilda Banken	334.474
Shionogi & Co Ltd	332.837
Alcon Inc	332.531
CH Robinson Worldwide Inc	330.983
Mitsubishi Chemical Holdings C	329.821
Xerox Holdings Corp	326.427
Dell Technologies Inc	326.103
MTR Corporation	325.077
Mid-America Apartment Communit	324.687
ProLogis Inc	324.319
Naturgy Energy Group SA	322.918
Elisa OYJ	321.997
Legal & General Group PLC	321.480
Host Hotels & Resorts Inc	319.424

Naam	Waarde in euro's
Sonic Healthcare Ltd	319.286
UGI Corp	318.031
Arkema SA	317.529
Telstra Corp Ltd	316.508
Kingfisher PLC	315.240
Marks & Spencer Group PLC	314.796
Fiserv Inc	314.596
Telia Co AB	314.504
Parker Hannifin Corp	312.443
NextEra Energy Inc	311.950
Zillow Group Inc	311.001
Bank of Montreal	310.507
United Continental Holdings Inc	309.512
George Weston Ltd	308.933
Power Corp Of Canada	307.521
Boliden AB	306.281
Oneok Inc	306.051
Kroger Co	304.595
Ramsay Health Care Ltd	304.455
WH Group Ltd	302.738
Coles Group Ltd	301.586
NiSource Inc	299.258
Power Financial Corp	299.184
Leggett & Platt Inc	299.003
Hang Seng Bank Ltd	298.169
Mitsubishi UFJ Financial Group	296.630
Telefonica SA	295.764
Fujitsu Ltd	294.577
Resona Holdings Inc	294.147
Uniper SE	293.595
Experian PLC	292.832
Dexus	292.381
Pulte Homes Inc	292.218
FNF Group	292.058
Sun Hung Kai Properties Ltd	291.215
Poste Italiane SpA	290.596
Kellogg Co	290.441
VF Corp	289.436
EDP - Energias de Portugal SA	289.112

Naam	Waarde in euro's
Solvay SA	288.414
ANSYS Inc	288.253
T Rowe Price Group Inc	288.074
Intact Financial Corp	287.670
Siemens Gamesa Renewable Energ	286.496
Brown-Forman Corp	286.178
AGNC Investment Corp	285.526
Henry Schein Inc	284.117
Lonza Group AG	283.990
Geberit AG	282.844
Tokyo Gas Co Ltd	282.478
NetApp Inc	282.108
Union Pacific Corp	281.533
Marsh & McLennan Cos Inc	280.584
Waters Corp	279.756
OGE Energy Corp	278.230
Zimmer Biomet Holdings Inc	277.891
Wix.com Ltd	277.685
Fortum OYJ	277.574
National Bank of Canada	276.762
Wheelock and Company Limited	276.758
Valero Energy Corp	275.235
BOC Hong Kong Holdings Ltd	274.357
Mitsui OSK Lines Ltd	272.773
Partners Group Holding AG	272.669
Link Reit	272.488
Public Service Enterprise Group Inc	272.393
Ingredion Inc.	270.942
Galp Energia SGPS SA	270.316
Marathon Petroleum Corp	269.448
Liberty SiriusXM Group	269.283
Kone OYJ	269.254
Sika AG	269.178
Sumitomo Electric Industries L	268.748
Global Payments Inc	268.676
GPT Group	267.486
Enagas	267.445
Sony Financial Holdings Inc	267.135
Norfolk Southern Corp	266.680

Naam	Waarde in euro's
Engie	265.234
Hennes & Mauritz AB	264.010
Phillips-Van Heusen Corp	263.976
Marui Group Co Ltd	262.453
Jazz Pharmaceuticals Plc	260.924
Orkla ASA	260.330
Pargesa Holding SA	260.149
General Motors Co	259.346
Kinder Morgan Inc/Delaware	258.906
Wayfair Inc	258.511
LyondellBasell Industries NV	258.147
Corning Inc	256.894
Sun Communities Inc	256.741
ViacomCBS Inc	256.456
Exelon Corp	256.401
SGS SA	256.076
Taiyo Nippon Sanso Corp	254.767
Reinsurance Group of America Inc	254.650
Fresenius Medical Care AG & Co	254.606
Mirvac Group	254.221
Daiwa Securities Group Inc	253.862
Abbott Laboratories	252.648
Fidelity National Information	251.167
Hologic Inc	250.608
Centerpoint Energy Inc	250.447
Roper Industries Inc	249.618
Obayashi Corp	249.321
Nordea Bank Abp	248.521
McCormick & Co Inc / MD	247.375
Ralph Lauren Corp	246.762
Daito Trust Construction Co Lt	245.648
West Japan Railway Co	244.562
Pernod-Ricard SA	242.926
Williams Cos Inc	242.419
Mizuho Financial Group Inc	241.775
Varian Medical Systems Inc	240.753
PNC Financial Services Group Inc	239.907
Maxim Integrated Products Inc	238.314
Repsol YPF SA	237.869

Naam	Waarde in euro's
Takeda Pharmaceutical Co Ltd	237.609
Perrigo Co Plc	237.337
MonotaRO Co Ltd	237.218
Stanley Black & Decker Inc.	236.244
Newmont Corp	236.004
Snam SpA	228.995
Toronto-Dominion Bank	228.657
Shimizu Corp	228.584
Singapore Telecommunications L	227.964
Progressive Corp	227.779
Juniper Networks Inc	227.737
M&T Bank Corp	225.476
Robert Half International Inc	224.415
Laboratory Corp of America Hol	223.952
Randstad NV	222.768
Travelers Cos Inc	222.414
Scentre Group	221.988
Kajima Corp	221.770
Micro Focus International PLC	220.581
HKT Trust / HKT Ltd	219.693
Insurance Australia Group Ltd	218.635
Prudential Financial Inc	218.379
TechnipFMC PLC	216.081
Sprint Corp	213.988
KBC Groep NV	213.787
People's United Financial Inc	212.872
Mitsubishi Heavy Industries Lt	208.939
Owens Corning	208.500
Teck Resources Ltd	208.011
MongoDB Inc	203.658
JM Smucker Co	203.343
National Oilwell Varco Inc	201.203
Nissan Motor Co Ltd	201.195
Regions Financial Corp	199.560
Wharf Real Estate Investment C	195.690
Principal Financial Group Inc	195.599
Sekisui Chemical Co Ltd	194.618
News Corp class A	193.476
TOYOTA TSUSHO CORP	193.019

Naam	Waarde in euro's
Sumitomo Chemical Co Ltd	192.664
Mazda Motor Corp	192.163
Southwest Airlines Co	191.298
WM Morrison Supermarkets PLC	189.734
TUI AG	188.171
Franklin Resources Inc	187.820
Nucor Corp	183.556
Pearson PLC	181.707
Plains GP Holdings LP	176.720
Spirit Aerosystems Holdings In	173.873
Targa Resources Corp	171.868
State Street Corp	170.743
Marathon Oil Corp	166.299
Nikon Corp	165.263
Renault SA	164.671
Natixis	157.200
PPL Corp	148.794
Noble Energy Inc	144.636
Pioneer Natural Resources Co	143.077
Nordstrom Inc	141.003
Tapestry Inc	130.321
Bristol-Myers Squibb Co	21.466
Repsol SA	7.223
Totaal waarde in euro's	317.532.875

2.4. Achmea IM Global High Yield Fund EUR hedged

TABEL 2.4.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
U S TREASURY NOTE 2.625% 11/15/2020 DD 11/15/10	27.237.986
U S TREASURY NOTE 2.250% 11/15/2024 DD 11/15/14	25.629.217
ONE CALL CORP 144A 7.500% 07/01/2024 DD 02/19/19	15.848.842
SPECIALTY STL HOLDCO INC 144A VAR RT 11/15/2022 DD 11/15/17	12.463.251
U S TREASURY NOTE 1.500% 08/15/2026 DD 08/15/16	11.619.449
ASURION 7/17 2ND LIEN TLB2	9.840.160
U S TREASURY NOTE 1.625% 05/15/2026 DD 05/15/16	8.618.373
POLARIS INTERMEDIATE CORP 144A 8.500% 12/01/2022 DD 11/21/17	8.569.988
SPRINT CORP 7.125% 06/15/2024 DD 06/15/14	8.197.538
INTERNET BRANDS 8/17 2ND LIEN COV-LITE TL	7.716.686
GTT COMMUNICATIONS INC 144A 7.875% 12/31/2024 DD 12/22/16	7.610.973
PACKAGING COORDINATORS 6/16 COV-LITE 2ND LIEN TL	7.438.752
BAFFINLAND IRON MINES COR 144A 8.750% 07/15/2026 DD 06/27/18	7.306.057
EPIC HEALTH 3/17 2ND LIEN TL	7.034.498
MSC 2L FRN VAR RT 01/09/2024 DD 07/09/18	6.731.557
EAGLE HOLDING CO II LLC 144A 7.750% 05/15/2022 DD 05/14/19	6.730.001
ENVISION HEALTHCARE CORP 144A 8.750% 10/15/2026 DD 10/11/18	6.710.913
DEXKO GLOBAL 7/17 2ND LIEN COV-LITE TL	6.613.719
TECTUM HOLDINGS/TRUCK HERO 5/17 2ND LIEN COV-LITE TL	6.465.924
PATTERSON COMPANIES 8/15 2ND LIEN COV-LITE TL	6.436.525
TEN-X 9/17 2ND LIEN TL	6.432.071
SPORTSNET	6.364.721
PARFUMS 6/17 2ND LIEN TL	5.929.189
TRANSDIGM INC 6.500% 05/15/2025 DD 11/15/15	5.623.875
SRS DISTRIBUTION INC 144A 8.250% 07/01/2026 DD 05/23/18	5.592.516
ALTICE LUXEMBOURG SA REGS 8.000% 05/15/2027	5.432.660
PRIME SECURITY SERVICES B 144A 5.750% 04/15/2026 DD 04/04/19	5.315.787
DURAVANT 7/17 2ND LIEN TL	5.266.171
IRON MOUNTAIN INC 144A 5.250% 03/15/2028 DD 12/27/17	5.193.051
ALTICE FRANCE SA/FRANCE REGS 5.875% 02/01/2027	5.046.774
JPW INDUSTRIES HOLDING CO 144A 9.000% 10/01/2024 DD 09/22/17	5.041.247
IQVIA INC REGS 3.250% 03/15/2025	4.915.545
CIRCA RESORT & CASINO 7/19 TLB	4.897.416
OPTIMAS OE SOLUTIONS HOLD 144A 8.625% 06/01/2021 DD 05/08/15	4.860.711
POST HOLDINGS INC 144A 5.000% 08/15/2026 DD 08/03/16	4.841.340
TITAN ACQUISITION LTD / T 144A 7.750% 04/15/2026 DD 03/28/18	4.762.584
ASSUREDPARTNERS INC 144A 7.000% 08/15/2025 DD 08/02/17	4.757.505

Naam	Waarde in euro's
SPECIALTY STL HOLD	4.747.968
TRANSDIGM INC 144A 6.250% 03/15/2026 DD 02/13/19	4.739.372
NATIONAL MENTOR/CIVITAS 3/19 0.000% 12/30/2020 DD 01/22/19	4.692.027
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.000% 02/01/2028 DD 08/08/17	4.650.661
TELEFONICA EUROPE BV REGS VAR RT 12/31/2049	4.632.027
CASINO GUICHARD PERRACHON REGS STEP 01/25/2023	4.603.065
EQUINIX INC 2.875% 02/01/2026	4.590.938
PLASTIPAK HOLDINGS INC 144A 6.250% 10/15/2025 DD 10/12/17	4.548.564
WESTERN DIGITAL CORP 4.750% 02/15/2026 DD 02/13/18	4.504.343
TRIDENT TPI HOLDINGS INC 144A 6.625% 11/01/2025 DD 10/17/17	4.485.969
INTERXION HOLDING NV REGS 4.750% 06/15/2025	4.477.567
KNOWLEDGE UNIVERSE/KINDER CARE 8/17 2ND LIEN COV-LITE TL	4.454.905
SURGERY CENTER HOLDINGS I 144A 6.750% 07/01/2025 DD 06/30/17	4.454.343
TARGA RESOURCES PARTNERS LP / 5.375% 02/01/2027 DD 10/06/16	4.441.147
DISH DBS CORP 5.875% 11/15/2024 DD 11/20/14	4.427.973
RACKSPACE HOSTING INC 144A 8.625% 11/15/2024 DD 11/03/16	4.406.370
TRANSDIGM INC 6.375% 06/15/2026 DD 12/15/16	4.393.618
STAPLES INC 144A 7.500% 04/15/2026 DD 04/16/19	4.371.826
APEX TOOL GROUP LLC / BC 144A 9.000% 02/15/2023 DD 02/26/18	4.357.572
ALTICE FRANCE SA/FRANCE 144A 7.375% 05/01/2026 DD 04/11/16	4.350.035
MHS 4/17 TLB	4.348.620
CENTURY ALUMINUM CO 144A 7.500% 06/01/2021 DD 06/04/13	4.321.604
SPRINT CORP 7.125% 06/15/2024 DD 06/15/14	4.296.741
PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 4.750% 01/14/2025	4.294.712
RA PARENT INC COMMON STOCK	4.257.335
LEARNING CARE 3/18 2ND LIEN TL 0.000% 12/31/2021 DD 03/31/06	4.195.991
1011778 BC ULC / NEW RED 144A 4.250% 05/15/2024 DD 05/17/17	4.192.227
SIMMONS FOODS INC 144A 5.750% 11/01/2024 DD 10/24/17	4.136.392
INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA 5.500% 08/01/2023 DD 06/05/13	4.132.576
DENTALCORP 5/18 2ND LIEN COV-LITE TL	4.045.301
KAR AUCTION SERVICES INC 144A 5.125% 06/01/2025 DD 05/31/17	4.034.922
TRANSDIGM INC 144A 6.250% 03/15/2026 DD 02/13/19	4.002.522
WYNN LAS VEGAS LLC / WYNN 144A 5.500% 03/01/2025 DD 02/18/15	3.979.733
NORTHWEST ACQUISITIONS UL 144A 7.125% 11/01/2022 DD 10/23/17	3.955.457
CELLNEX TELECOM SA REGS 2.375% 01/16/2024	3.932.111
CROWNROCK LP / CROWNROCK 144A 5.625% 10/15/2025 DD 10/11/17	3.930.067
FRONTIER COMMUNICATIONS C 144A 8.000% 04/01/2027 DD 03/15/19	3.882.094
SIRIUS XM RADIO INC 144A 5.375% 07/15/2026 DD 05/23/16	3.879.705
AVANTOR INC REGS 4.750% 10/01/2024	3.874.178

Naam	Waarde in euro's
VIASAT INC 144A 5.625% 09/15/2025 DD 09/21/17	3.853.898
ORTHO-CLINICAL DIAGNOSTIC 144A 6.625% 05/15/2022 DD 05/16/14	3.851.058
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 4.750% 03/01/2030 DD 10/01/19	3.812.738
ALTICE FRANCE SA/FRANCE 144A 7.375% 05/01/2026 DD 04/11/16	3.768.500
NETFLIX INC 3.625% 05/15/2027	3.717.180
SS&C TECHNOLOGIES INC 144A 5.500% 09/30/2027 DD 03/28/19	3.699.399
MASERGY COMMUNICATIONS 12/16 2ND LIEN COV-LITE TL	3.681.402
IRON MOUNTAIN INC REGS 3.000% 01/15/2025	3.586.254
COTT FINANCE CORP 5.500% 01-JUL-2024	3.566.733
NETFLIX INC 4.875% 04/15/2028 DD 10/26/17	3.554.251
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 6.125% 04/15/2025 DD 03/27/15	3.543.818
VODAFONE GROUP PLC REGS VAR RT 01/03/2079	3.473.177
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.750% 02/15/2026 DD 11/20/15	3.460.654
CALPINE CORP 5.750% 01/15/2025 DD 07/22/14	3.451.308
CALPINE CORP 144A 4.500% 02/15/2028 DD 12/20/19	3.437.798
DARLING GLOBAL FINANCE BV REGS 3.625% 05/15/2026	3.424.566
NETFLIX INC REGS 3.875% 11/15/2029	3.422.598
TEVA PHARMACEUTICAL FINAN REGS 1.125% 10/15/2024	3.414.936
VODAFONE GROUP PLC REGS VAR RT 10/03/2078	3.404.510
HERTZ CORP/THE 144A 6.000% 01/15/2028 DD 11/25/19	3.403.118
TRIDENT TPI HOLDINGS INC 144A 9.250% 08/01/2024 DD 07/24/19	3.401.158
BASS PRO SHOPS 11/16 COV-LITE 0.000% 09/25/2024 DD 10/26/16	3.395.056
MPH ACQUISITION HOLDINGS 144A 7.125% 06/01/2024 DD 06/07/16	3.391.637
SURGERY CENTER HOLDINGS I 144A 10.000% 04/15/2027 DD 04/11/19	3.373.163
HUB INTERNATIONAL LTD 144A 7.000% 05/01/2026 DD 04/25/18	3.367.984
SKILLSOFT 4/14 COV-LITE TL 0.000% 04/28/2021 DD 04/03/14	3.363.081
HANESBRANDS FINANCE LUXEM REGS 3.500% 06/15/2024	3.359.457
AVIS BUDGET FINANCE PLC REGS 4.750% 01/30/2026	3.357.433
JOSEPH T RYERSON & SON IN 144A 11.000% 05/15/2022 DD 05/24/16	3.355.323
PARSLEY ENERGY LLC / PARS 144A 5.625% 10/15/2027 DD 10/11/17	3.352.911
SPECTRUM BRANDS INC REGS 4.000% 10/01/2026	3.309.599
PEAK 10 7/17 2ND LIEN COV-LITE 0.000% 07/24/2025 DD 07/12/17	3.304.754
NETFLIX INC 6.375% 05/15/2029 DD 10/26/18	3.304.378
SIRIUS XM RADIO INC 144A 5.500% 07/01/2029 DD 06/07/19	3.303.923
CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 5.250% 10/01/2025 DD 04/01/18	3.295.697
ARDAGH PACKAGING FINANCE 144A 6.000% 02/15/2025 DD 01/30/17	3.255.096
COMMSCOPE TECHNOLOGIES LL 144A 6.000% 06/15/2025 DD 06/11/15	3.242.859
IQVIA INC REGS 2.250% 01/15/2028	3.240.521
TELEFONICA EUROPE BV REGS VAR RT 12/31/2049	3.233.413

Naam	Waarde in euro's
CROWNROCK LP / CROWNROCK 144A 5.625% 10/15/2025 DD 10/11/17	3.231.287
TENNET HOLDING BV REGS VAR RT 12/31/2049	3.227.601
ELEMENT SOLUTIONS INC 144A 5.875% 12/01/2025 DD 11/24/17	3.215.646
TEAM HEALTH HOLDINGS INC 144A 6.375% 02/01/2025 DD 02/01/17	3.181.403
IHEARTCOMMUNICATIONS INC 8.375% 05/01/2027 DD 05/01/19	3.171.554
QUALITYTECH LP / QTS FINA 144A 4.750% 11/15/2025 DD 11/08/17	3.166.448
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 9.000% 12/15/2025 DD 12/18/17	3.165.924
IQVIA INC REGS 3.500% 10/15/2024	3.160.509
TENET HEALTHCARE CORP 144A 5.125% 11/01/2027 DD 08/26/19	3.150.401
SILGAN HOLDINGS INC 3.250% 03/15/2025	3.144.841
KIK CUSTOM PRODUCTS 8/15 COV-LITE TL	3.116.793
EIRCOM FINANCE DAC REGS 3.500% 05/15/2026	3.086.653
ASURION 7/17 2ND LIEN TLB2	3.081.808
HCA INC 5.625% 09/01/2028 DD 08/23/18	3.074.128
NIELSEN FINANCE LLC / NIE 144A 5.000% 04/15/2022 DD 04/11/14	3.058.196
NETFLIX INC 4.625% 05/15/2029	3.039.549
AKELIUS RESIDENTIAL PROPE REGS VAR RT 10/05/2078	3.017.013
HOLLY ENERGY PARTNERS LP 144A 6.000% 08/01/2024 DD 07/19/16	3.008.158
CHURCHILL DOWNS INC 144A 5.500% 04/01/2027 DD 03/25/19	3.007.661
ZIGGO BV 144A 5.500% 01/15/2027 DD 09/23/16	3.003.396
ZEST DENTAL 3/18 2ND LIEN 0.000% 03/06/2026 DD 02/26/18	2.989.978
GARDA WORLD SECURITY CORP 144A 8.750% 05/15/2025 DD 05/08/17	2.983.341
UTEX INDUSTRIES 5/14 COV-LITE 2ND LIEN TL	2.973.726
GRAND CITY PROPERTIES SA VAR RT 12/31/2049	2.971.430
CATALENT PHARMA SOLUTIONS REGS 4.750% 12/15/2024	2.932.282
VIRGIN MEDIA FINANCE PLC REGS 4.500% 01/15/2025	2.913.152
ENERGIZER HOLDINGS INC 144A 7.750% 01/15/2027 DD 01/28/19	2.907.123
LKQ ITALIA BONDCO SPA REGS 3.875% 04/01/2024	2.904.238
TEREX CORP 144A 5.625% 02/01/2025 DD 01/31/17	2.865.245
CSC HOLDINGS LLC 144A 5.750% 01/15/2030 DD 07/10/19	2.829.232
NEXTERA ENERGY OPERATING 144A 4.500% 09/15/2027 DD 09/25/17	2.827.984
BERRY GLOBAL INC 5.125% 07/15/2023 DD 06/05/15	2.820.473
ATD COMMON STOCK	2.816.849
CENTURYLINK INC 6.750% 12/01/2023 DD 11/27/13	2.813.248
UTEX INDUSTRIES 5/14 COV-LITE TLB	2.805.242
SMURFIT KAPPA ACQUISITION REGS 2.875% 01/15/2026	2.803.215
CSC HOLDINGS LLC 144A 6.625% 10/15/2025 DD 10/09/15	2.798.444
TRANSDIGM INC 7.500% 03/15/2027 DD 09/15/19	2.782.004
CLEAR CHANNEL WORLDWIDE H 144A 9.250% 02/15/2024 DD 02/12/19	2.779.356

Naam	Waarde in euro's
GTCR AP FINANCE INC 144A 8.000% 05/15/2027 DD 05/13/19	2.760.980
CSC HOLDINGS LLC 144A 5.750% 01/15/2030 DD 07/10/19	2.757.906
TRANSDIGM INC 144A 5.500% 11/15/2027 DD 11/13/19	2.747.663
GATES GLOBAL LLC / GATES 144A 6.250% 01/15/2026 DD 11/22/19	2.734.007
JAGUAR LAND ROVER AUTOMOT REGS 3.875% 03/01/2023	2.718.898
CENTENE CORP 144A 4.625% 12/15/2029 DD 12/06/19	2.715.246
FIAT CHRYSLER FINANCE EUR REGS 4.750% 07/15/2022	2.711.381
UNITED RENTALS NORTH AMERICA I 4.875% 01/15/2028 DD 08/11/17	2.710.445
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.125% 05/01/2027 DD 02/06/17	2.696.477
ARDAGH PACKAGING FINANCE REGS 2.750% 03/15/2024	2.696.442
ARAMARK INTERNATIONAL FIN REGS 3.125% 04/01/2025	2.672.831
NEXSTAR BROADCASTING INC 144A 5.625% 07/15/2027 DD 07/03/19	2.666.184
HUDBAY MINERALS INC 144A 7.625% 01/15/2025 DD 12/12/16	2.664.844
CSC HOLDINGS LLC 144A 5.500% 05/15/2026 DD 05/15/18	2.661.705
HERTZ CORP/THE 144A 6.000% 01/15/2028 DD 11/25/19	2.653.898
SPRINT CORP 7.875% 09/15/2023 DD 09/15/14	2.653.890
ZAYO GROUP LLC / ZAYO CAP 144A 5.750% 01/15/2027 DD 01/27/17	2.653.567
STARFRUIT FINCO BV / STAR 144A 8.000% 10/01/2026 DD 10/01/18	2.634.655
HOWDEN 9/19 TLB 0.000% 12/31/2022 DD 09/05/19	2.634.633
EPIC HEALTH 5/19 2ND LIEN TL 0.000% 06/04/2027 DD 05/15/19	2.630.512
VRX ESCROW CORP 4.500% 15-MAY-2023	2.630.475
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 6.125% 04/15/2025 DD 03/27/15	2.627.948
SCIENTIFIC GAMES INTERNAT 144A 7.000% 05/15/2028 DD 11/26/19	2.627.506
SPRINT CAPITAL CORP 8.750% 03/15/2032 DD 03/14/02	2.622.133
BEACON ROOFING SUPPLY INC 144A 4.875% 11/01/2025 DD 10/25/17	2.617.029
HARSCO CORP 144A 5.750% 07/31/2027 DD 06/28/19	2.612.243
REYNOLDS GROUP ISSUER INC 144A 5.125% 07/15/2023 DD 06/27/16	2.612.045
FREEMPORT-MCMORAN INC 5.450% 03/15/2043 DD 09/15/13	2.609.399
ASCENT RESOURCES UTICA HO 144A 7.000% 11/01/2026 DD 10/11/18	2.586.102
UNITI GROUP LP / UNITI FI 144A 7.125% 12/15/2024 DD 12/15/16	2.582.138
CLEAR CHANNEL WORLDWIDE H 144A 5.125% 08/15/2027 DD 08/23/19	2.579.827
BEACON ROOFING SUPPLY INC 144A 4.875% 11/01/2025 DD 10/25/17	2.560.624
FREEMPORT-MCMORAN INC 5.450% 03/15/2043 DD 09/15/13	2.558.686
SBA COMMUNICATIONS CORP 4.875% 09/01/2024 DD 03/01/17	2.549.154
EG GLOBAL FINANCE PLC REGS 6.250% 10/30/2025	2.543.997
PINNACLE BIDCO PLC REGS 6.375% 02/15/2025	2.523.831
INEOS FINANCE PLC REGS 2.875% 05/01/2026	2.523.348
STARFRUIT FINCO BV / STAR 144A 8.000% 10/01/2026 DD 10/01/18	2.516.615
CSC HOLDINGS LLC 144A 6.500% 02/01/2029 DD 01/31/19	2.512.102

Naam	Waarde in euro's
KFC HOLDING CO/PIZZA HUT 144A 5.250% 06/01/2026 DD 06/16/16	2.509.443
IRON MOUNTAIN INC 144A 4.875% 09/15/2029 DD 09/09/19	2.506.696
THYSSENKRUPP AG REGS 2.750% 03/08/2021	2.499.759
EIRCOM FINANCE DAC REGS 2.625% 02/15/2027	2.498.897
AVANTOR INC 144A 9.000% 10/01/2025 DD 10/02/17	2.498.887
REALOGY GROUP LLC / REALO 144A 9.375% 04/01/2027 DD 03/29/19	2.495.938
BUCKEYE PARTNERS LP 3.950% 12/01/2026 DD 11/07/16	2.495.747
COMMSCOPE TECHNOLOGIES LL 144A 5.000% 03/15/2027 DD 03/13/17	2.495.501
ARAMARK SERVICES INC 5.125% 01/15/2024 DD 12/17/15	2.491.220
LIVE NATION ENTERTAINMENT 144A 4.750% 10/15/2027 DD 10/17/19	2.480.312
BEACON ROOFING SUPPLY INC 144A 4.875% 11/01/2025 DD 10/25/17	2.480.045
HCA INC 5.375% 09/01/2026 DD 08/23/18	2.470.590
TENET HEALTHCARE CORP 6.750% 06/15/2023 DD 06/16/15	2.456.804
ADLER REAL ESTATE AG REGS 2.125% 02/06/2024	2.455.668
IRON MOUNTAIN INC 144A 4.875% 09/15/2027 DD 09/18/17	2.451.325
J2 CLOUD SERVICES LLC / J 144A 6.000% 07/15/2025 DD 06/27/17	2.441.069
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.750% 02/15/2026 DD 11/20/15	2.434.300
ASGN INC 144A 4.625% 05/15/2028 DD 11/22/19	2.431.199
MATADOR RESOURCES CO 5.875% 09/15/2026 DD 08/21/18	2.421.183
GRIFOLS SA REGS 3.200% 05/01/2025	2.418.213
CSC HOLDINGS LLC 144A 10.875% 10/15/2025 DD 10/09/15	2.414.198
TRANSDIGM INC 144A 5.500% 11/15/2027 DD 11/13/19	2.406.232
CROWN EUROPEAN HOLDINGS S REGS 2.625% 09/30/2024	2.403.125
NOVELIS CORP 144A 5.875% 09/30/2026 DD 09/14/16	2.378.476
IHEARTCOMMUNICATIONS INC 8.375% 05/01/2027 DD 05/01/19	2.377.350
SELECT MEDICAL CORP 144A 6.250% 08/15/2026 DD 08/01/19	2.377.204
STAPLES 3/19 (7 YEAR) TL 0.000% 12/31/2022 DD 03/26/19	2.373.315
LOXAM SAS REGS 3.250% 01/14/2025	2.362.733
BOYD GAMING CORP 6.375% 04/01/2026 DD 10/01/16	2.357.957
CALLON PETROLEUM CO 6.375% 07/01/2026 DD 06/07/18	2.356.414
TESCO PLC 5.500% 01/13/2033	2.340.698
THYSSENKRUPP AG REGS 2.875% 02/22/2024	2.331.682
LHC3 PLC REGS 4.125% 08/15/2024	2.331.681
TEVA PHARMACEUTICAL FINAN REGS 1.250% 03/31/2023	2.325.400
VIRGIN MEDIA SECURED FINA 144A 5.500% 08/15/2026 DD 04/26/16	2.324.499
OUTFRONT MEDIA CAPITAL LL 144A 5.000% 08/15/2027 DD 06/14/19	2.322.697
TECHEM VERWALTUNGSGESELLS REGS 6.000% 07/30/2026	2.322.401
LTF MERGER SUB INC 144A 8.500% 06/15/2023 DD 06/10/15	2.317.149
ROSSINI SARL REGS 6.750% 10/30/2025	2.310.490

Naam	Waarde in euro's
CONSTELLIUM SE 144A 6.625% 03/01/2025 DD 02/16/17	2.307.216
GRIFOLS SA REGS 1.625% 02/15/2025	2.303.139
PQ CORP 144A 6.750% 11/15/2022 DD 05/04/16	2.295.892
L BRANDS INC 5.250% 02/01/2028 DD 01/23/18	2.287.506
TARGA RESOURCES PARTNERS 144A 5.500% 03/01/2030 DD 11/27/19	2.287.503
SIRIUS XM RADIO INC 144A 5.375% 04/15/2025 DD 03/06/15	2.287.484
TELECOM ITALIA SPA/MILANO REGS 4.500% 01/25/2021	2.284.374
JAGUAR HOLDING CO II / PH 144A 6.375% 08/01/2023 DD 08/18/15	2.279.548
ESH HOSPITALITY INC 144A 5.250% 05/01/2025 DD 05/15/15	2.279.315
TELEFONICA EUROPE BV REGS VAR RT 12/31/2049	2.279.251
IRB HOLDING CORP 144A 6.750% 02/15/2026 DD 02/05/18	2.272.305
CO-OPERATIVE GROUP HOLDIN REGS STEP 07/08/2026	2.267.968
SPRINT CORP 7.625% 03/01/2026 DD 02/22/18	2.260.617
ZAYO GROUP LLC / ZAYO CAPITAL 6.000% 04/01/2023 DD 10/01/15	2.254.510
REAL ALLOY ASSET 12.330% 11/30/2023 DD 05/31/18	2.251.468
ALTICE FRANCE SA/FRANCE REGS 3.375% 01/15/2028	2.242.950
ALTICE FRANCE SA/FRANCE 144A 5.500% 01/15/2028 DD 09/27/19	2.242.759
SOLERA LLC / SOLERA FINAN 144A 10.500% 03/01/2024 DD 03/03/16	2.240.278
WPX ENERGY INC 8.250% 08/01/2023 DD 07/22/15	2.239.555
ALTICE FRANCE SA/FRANCE 144A 7.375% 05/01/2026 DD 04/11/16	2.238.145
INTERGEN NV REGS 7.500% 06/30/2021	2.237.561
WPX ENERGY INC 5.250% 10/15/2027 DD 09/24/19	2.235.942
ZAYO GROUP LLC / ZAYO CAP 144A 5.750% 01/15/2027 DD 01/27/17	2.231.676
PDC ENERGY INC 5.750% 05/15/2026 DD 05/15/18	2.230.490
BIG RIVER STEEL LLC / BRS 144A 7.250% 09/01/2025 DD 08/23/17	2.227.483
ALTICE FRANCE SA/FRANCE 144A 8.125% 02/01/2027 DD 07/31/18	2.227.416
NETFLIX INC 144A 5.375% 11/15/2029 DD 04/29/19	2.215.348
REYNOLDS GROUP ISSUER INC 144A 7.000% 07/15/2024 DD 06/27/16	2.213.929
DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.125% 05/15/2029 DD 05/10/19	2.207.171
ORANO SA 4.875% 09/23/2024	2.200.127
MPT OPERATING PARTNERSHIP LP / 6.375% 03/01/2024 DD 02/22/16	2.186.485
REPSOL INTERNATIONAL FINA REGS VAR RT 12/31/2049	2.184.708
SUMMIT MIDSTREAM HOLDINGS LLC 5.750% 04/15/2025 DD 02/15/17	2.177.283
OPEN TEXT CORP 144A 5.875% 06/01/2026 DD 05/31/16	2.168.597
HERTZ CORP/THE 144A 7.125% 08/01/2026 DD 08/01/19	2.161.176
EDGEWELL PERSONAL CARE CO 4.700% 05/24/2022 DD 05/24/12	2.158.185
RYMAN HOSPITALITY PROPERT 144A 4.750% 10/15/2027 DD 09/19/19	2.156.982
CIRSA FINANCE INTERNATION REGS 6.250% 12/20/2023	2.152.588
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 5.500% 03/01/2023 DD 01/30/15	2.149.670

Naam	Waarde in euro's
ZIGGO BOND CO BV 144A 6.000% 01/15/2027 DD 09/23/16	2.149.474
FORUM ENERGY TECHNOLOGIES INC 6.250% 10/01/2021 DD 04/01/14	2.146.303
SPRINT CORP 7.875% 09/15/2023 DD 09/15/14	2.142.770
CENTENE CORP 144A 5.375% 06/01/2026 DD 05/23/18	2.137.627
VIKING CRUISES LTD 144A 5.875% 09/15/2027 DD 09/20/17	2.125.122
PARSLEY ENERGY LLC / PARS 144A 5.375% 01/15/2025 DD 12/13/16	2.108.633
ELIS SA REGS 2.875% 02/15/2026	2.100.029
CORE & MAIN LP 144A 6.125% 08/15/2025 DD 08/01/17	2.098.931
SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 5.375% 05/15/2024 DD 05/12/14	2.096.704
TELENET FINANCE LUXEMBOUR 144A 5.500% 03/01/2028	2.092.205
INTERNATIONAL DESIGN GROU REGS 6.500% 11/15/2025	2.089.821
AVANTOR INC 144A 9.000% 10/01/2025 DD 10/02/17	2.086.720
HANSON BUILDING 4/17 COV-LITE TLB	2.078.479
JAMES HARDIE INTERNATIONA REGS 3.625% 10/01/2026	2.071.852
MGM RESORTS INTERNATIONAL 6.000% 03/15/2023 DD 11/25/14	2.067.895
TEGNA INC 144A 5.000% 09/15/2029 DD 09/13/19	2.057.661
REPSOL INTERNATIONAL FINA REGS VAR RT 03/25/2075	2.050.543
CENTENE CORP 144A 4.250% 12/15/2027 DD 12/06/19	2.042.836
ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / 5.375% 09/15/2024 DD 03/15/17	2.040.913
ADLER REAL ESTATE AG REGS 1.875% 04/27/2023	2.039.975
LEVEL 3 FINANCING INC 5.125% 05/01/2023 DD 09/01/15	2.032.222
VALVOLINE INC 5.500% 07/15/2024 DD 07/15/17	2.028.786
DEMIRE DEUTSCHE MITTELSTA REGS 1.875% 10/15/2024	2.025.825
TALLGRASS ENERGY PARTNERS 144A 5.500% 01/15/2028 DD 09/15/17	2.025.479
DCP MIDSTREAM OPERATING L 144A VAR RT 05/21/2043 DD 05/21/13	2.021.559
LENNAR CORP 5.875% 11/15/2024 DD 05/15/18	2.020.410
SIRIUS XM RADIO INC 144A 5.375% 07/15/2026 DD 05/23/16	2.020.285
USA COMPRESSION PARTNERS LP / 6.875% 09/01/2027 DD 09/01/19	2.008.966
BERRY GLOBAL INC REGS 1.000% 01/15/2025	2.008.700
TIERPOINT 4/17 2ND LIEN COV-LITE TL	2.007.164
TRANSDIGM INC 144A 5.500% 11/15/2027 DD 11/13/19	2.004.443
WILLIAM HILL PLC REGS 4.875% 09/07/2023	2.003.555
NUMERICABLE / YPSO / ALTICE 0.000% 08/14/2026 DD 07/09/18	2.001.832
TENET HEALTHCARE CORP 8.125% 04/01/2022 DD 09/27/13	2.000.612
IRON MOUNTAIN INC 5.750% 08/15/2024 DD 08/10/12	1.993.671
MATADOR RESOURCES CO 5.875% 09/15/2026 DD 08/21/18	1.987.138
FRONTIER COMMUNICATIONS 6/17 TLB1	1.979.528
LKQ EUROPEAN HOLDINGS BV REGS 3.625% 04/01/2026	1.979.105
OLIN CORP 5.625% 08/01/2029 DD 07/16/19	1.971.260

Naam	Waarde in euro's
VICI PROPERTIES 1 LLC / VICI F 8.000% 10/15/2023 DD 10/06/17	1.967.305
FREEMPORT-MCMORAN INC 4.550% 11/14/2024 DD 11/14/14	1.967.252
TELECOM ITALIA SPA/MILANO REGS 2.750% 04/15/2025	1.966.597
ASSURED PARTNERS INC 144A 7.000% 08/15/2025 DD 08/02/17	1.966.436
LANXESS AG REGS VAR RT 12/06/2076	1.960.857
BAUSCH HEALTH AMERICAS IN 144A 9.250% 04/01/2026 DD 03/26/18	1.955.434
AVIS BUDGET CAR RENTAL LL 144A 5.750% 07/15/2027 DD 07/03/19	1.954.922
PETSMART INC 144A 7.125% 03/15/2023 DD 03/04/15	1.946.904
DISH DBS CORP 5.875% 11/15/2024 DD 11/20/14	1.943.611
ARQIVA BROADCAST FINANCE REGS 6.750% 09/30/2023	1.940.249
LEVEL 3 FINANCING INC 5.375% 01/15/2024 DD 01/15/16	1.937.439
WYNN LAS VEGAS LLC / WYNN 144A 5.500% 03/01/2025 DD 02/18/15	1.936.962
EC FINANCE PLC REGS 2.375% 11/15/2022	1.934.533
AVIS BUDGET CAR RENTAL LL 144A 5.250% 03/15/2025 DD 03/11/15	1.929.193
AVANTOR INC 144A 9.000% 10/01/2025 DD 10/02/17	1.926.433
UBER TECHNOLOGIES INC 144A 7.500% 11/01/2023 DD 11/07/18	1.926.151
PAPREC HOLDING SA REGS 4.000% 03/31/2025	1.926.052
SEAWORLD 3/17 B5 TLB	1.911.736
NESTLE SKIN HEALTH/SUNSHINE 0.000% 07/17/2026 DD 06/28/19	1.904.487
CSC HOLDINGS LLC 144A 7.500% 04/01/2028 DD 10/01/18	1.902.628
VICTORIA PLC REGS 5.250% 07/15/2024	1.899.774
TAYLOR MORRISON COMMUNITI 144A 5.625% 03/01/2024 DD 03/05/14	1.898.704
SCIENTIFIC GAMES INTERNAT 144A 5.000% 10/15/2025 DD 10/17/17	1.897.697
CHENIERE ENERGY PARTNERS 144A 4.500% 10/01/2029 DD 09/12/19	1.894.995
ARD FINANCE SA REGS 5.000% 06/30/2027	1.894.147
CENTURYLINK INC 144A 5.125% 12/15/2026 DD 12/16/19	1.892.928
CSC HOLDINGS LLC 144A 5.750% 01/15/2030 DD 07/10/19	1.891.543
PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC 5.500% 05/15/2026 DD 05/25/16	1.889.699
MATCH GROUP INC 6.375% 06/01/2024 DD 06/01/16	1.889.151
CROWN AMERICAS LLC / CROWN AME 4.750% 02/01/2026 DD 02/01/19	1.886.665
NOVELIS CORP 144A 5.875% 09/30/2026 DD 09/14/16	1.872.256
TESCO CORPORATE TREASURY REGS 2.500% 07/01/2024	1.869.696
SIRIUS XM RADIO INC 144A 4.625% 07/15/2024 DD 07/02/19	1.866.147
MATTERHORN TELECOM SA REGS 3.125% 09/15/2026	1.864.770
CEMEX FINANCE LLC REGS 4.625% 06/15/2024	1.855.503
CENTURYLINK INC 5.800% 03/15/2022 DD 03/12/12	1.851.546
PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC 3.750% 08/15/2020 DD 08/15/17	1.849.042
VODAFONE GROUP PLC REGS VAR RT 10/03/2078	1.848.363
CORNERSTONE CHEMICAL CO 144A 6.750% 08/15/2024 DD 08/09/17	1.847.572

Naam	Waarde in euro's
REFINITIV US HOLDINGS INC 144A 6.250% 05/15/2026 DD 10/01/18	1.847.105
CONNECT FINCO SARL / CONN 144A 6.750% 10/01/2026 DD 10/07/19	1.845.367
APX GROUP INC 7.875% 12/01/2022 DD 05/26/16	1.844.058
PRECISION DRILLING CORP 5.250% 11/15/2024 DD 11/15/14	1.843.174
H&E EQUIPMENT SERVICES INC 5.625% 09/01/2025 DD 03/01/18	1.843.040
LEVEL 3 FINANCING INC 144A 4.625% 09/15/2027 DD 09/25/19	1.842.384
CHANGE HEALTHCARE HOLDING 144A 5.750% 03/01/2025 DD 02/15/17	1.841.719
1011778 BC ULC / NEW RED 144A 5.000% 10/15/2025 DD 08/28/17	1.839.644
SM ENERGY CO 5.000% 01/15/2024 DD 01/15/14	1.838.813
INTERNATIONAL GAME TECHNO REGS 3.500% 06/15/2026	1.838.517
TELENET FINANCE LUXEMBOUR REGS 3.500% 03/01/2028	1.836.746
ENEL SPA REGS VAR RT 05/24/2080	1.835.932
SOLVAY FINANCE SA REGS VAR RT 12/31/2049	1.832.565
U S TREASURY NOTE 2.250% 02/15/2027 DD 02/15/17	1.831.779
CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDING 5.250% 09/30/2022 DD 08/22/12	1.828.808
PPF TELECOM GROUP BV REGS 2.125% 01/31/2025	1.825.124
SPCM SA REGS 2.875% 06/15/2023	1.824.865
ALTICE FINCO SA REGS 9.000% 06/15/2023	1.824.572
KAR AUCTION SERVICES INC 144A 5.125% 06/01/2025 DD 05/31/17	1.819.653
TENET HEALTHCARE CORP 144A 4.875% 01/01/2026 DD 08/26/19	1.819.537
NAVIENT CORP 6.750% 06/25/2025 DD 05/26/17	1.819.510
REXEL SA REGS 2.750% 06/15/2026	1.799.074
ARAMARK SERVICES INC 144A 5.000% 02/01/2028 DD 01/18/18	1.788.324
EI GROUP PLC REGS 7.500% 03/15/2024	1.780.154
ATOTECH ALPHA 3 BV / ALPH 144A 6.250% 02/01/2025 DD 01/31/17	1.776.971
CDK GLOBAL INC 4.875% 06/01/2027 DD 12/01/17	1.776.570
SPECTRUM BRANDS INC 6.125% 12/15/2024 DD 12/15/15	1.774.336
NFP CORP 144A 6.875% 07/15/2025 DD 07/12/17	1.772.795
FREEPORT-MCMORAN INC 3.875% 03/15/2023 DD 09/15/13	1.768.863
FREEPORT-MCMORAN INC 5.250% 09/01/2029 DD 08/15/19	1.760.845
ELIS SA REGS 1.750% 04/11/2024	1.758.848
HUB INTERNATIONAL LTD 144A 7.000% 05/01/2026 DD 04/25/18	1.755.120
AMKOR TECHNOLOGY INC 144A 6.625% 09/15/2027 DD 03/15/19	1.746.303
SELECT MEDICAL CORP 144A 6.250% 08/15/2026 DD 08/01/19	1.744.569
CASINO GUICHARD PERRACHON REGS STEP 03/07/2024	1.727.249
INEOS GROUP HOLDINGS SA 144A 5.625% 08/01/2024 DD 08/09/16	1.726.458
RBS GLOBAL INC / REXNORD 144A 4.875% 12/15/2025 DD 12/07/17	1.724.666
BRAND ENERGY 6/17 COV-LITE TL	1.717.400
SPIE SA REGS 3.125% 03/22/2024	1.716.816

Naam	Waarde in euro's
NETFLIX INC 144A 4.875% 06/15/2030 DD 10/25/19	1.714.574
BOMBARDIER INC 144A 8.750% 12/01/2021 DD 11/21/16	1.712.982
CALPINE CORP 144A 5.125% 03/15/2028 DD 12/27/19	1.709.502
PQ CORP 144A 5.750% 12/15/2025 DD 12/11/17	1.702.722
ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / 5.375% 09/15/2024 DD 03/15/17	1.702.138
BIG RIVER STEEL LLC / BRS 144A 7.250% 09/01/2025 DD 08/23/17	1.702.098
OWENS-BROCKWAY GLASS CONT 144A 5.875% 08/15/2023 DD 08/24/15	1.701.343
CSC HOLDINGS LLC 144A 5.500% 04/15/2027 DD 09/23/16	1.699.027
STONEGATE PUB CO FINANCIN REGS VAR RT 03/15/2022	1.697.026
FREEMPORT-MCMORAN INC 3.550% 03/01/2022 DD 02/13/12	1.691.258
SOLVAY FINANCE SA REGS VAR RT 12/31/2049	1.691.149
INTERNATIONAL GAME TECHNO 144A 6.500% 02/15/2025 DD 02/13/15	1.678.000
ROCKPOINT GAS STORAGE CAN 144A 7.000% 03/31/2023 DD 02/14/18	1.673.532
BAUSCH HEALTH AMERICAS IN 144A 8.500% 01/31/2027 DD 06/01/18	1.666.858
IAA INC 144A 5.500% 06/15/2027 DD 06/06/19	1.665.924
CENTENE CORP 144A 4.625% 12/15/2029 DD 12/06/19	1.662.491
RITCHIE BROS AUCTIONEERS 144A 5.375% 01/15/2025 DD 12/21/16	1.662.428
ESH HOSPITALITY INC 144A 4.625% 10/01/2027 DD 09/18/19	1.659.688
ACADIA HEALTHCARE CO INC 6.500% 03/01/2024 DD 02/16/16	1.655.231
SYNLAB UNSECURED BONDCO P REGS 8.250% 07/01/2023	1.654.721
NETFLIX INC 5.875% 11/15/2028 DD 04/26/18	1.654.199
BIG RIVER STEEL LLC / BRS 144A 7.250% 09/01/2025 DD 08/23/17	1.654.165
PERFORMANCE FOOD GROUP IN 144A 5.500% 10/15/2027 DD 09/27/19	1.651.921
WELLCARE HEALTH PLANS INC 5.250% 04/01/2025 DD 03/22/17	1.647.323
SERVICEMASTER CO LLC/THE 144A 5.125% 11/15/2024 DD 11/08/16	1.645.212
SPECTRUM BRANDS INC 5.750% 07/15/2025 DD 01/15/16	1.641.206
NETFLIX INC REGS 3.625% 06/15/2030	1.641.023
REYNOLDS GROUP ISSUER INC 144A 5.125% 07/15/2023 DD 06/27/16	1.637.088
TELECOM ITALIA SPA/MILANO REGS 2.500% 07/19/2023	1.636.048
SPRINT CORP 7.625% 03/01/2026 DD 02/22/18	1.635.779
CALLON PETROLEUM CO 6.250% 04/15/2023 DD 04/28/15	1.635.513
NCR CORP 6.375% 12/15/2023 DD 06/15/14	1.632.695
MERITAGE HOMES CORP 5.125% 06/06/2027 DD 06/06/17	1.631.920
COLFAX CORP REGS 3.250% 05/15/2025	1.628.822
WEST STREET MERGER SUB IN 144A 6.375% 09/01/2025 DD 08/24/17	1.617.327
SCIENTIFIC GAMES INTERNAT 144A 8.250% 03/15/2026 DD 03/19/19	1.615.690
PRESTIGE BRANDS INC 144A 6.375% 03/01/2024 DD 02/19/16	1.611.189
MATCH GROUP INC 144A 5.625% 02/15/2029 DD 02/15/19	1.608.174
FIRST QUANTUM MINERALS LT 144A 6.500% 03/01/2024 DD 02/27/18	1.607.572

Naam	Waarde in euro's
NCR CORP 5.000% 07/15/2022 DD 01/15/13	1.607.096
SIX FLAGS ENTERTAINMENT C 144A 5.500% 04/15/2027 DD 04/13/17	1.605.312
CENTURYLINK INC 5.625% 04/01/2020 DD 03/21/13	1.604.621
CONSTELLUM SE 144A 5.875% 02/15/2026 DD 11/09/17	1.600.617
BEACON ROOFING SUPPLY INC 144A 4.500% 11/15/2026 DD 10/09/19	1.600.285
NABORS INDUSTRIES INC 5.750% 02/01/2025 DD 08/01/18	1.596.347
NETFLIX INC 4.875% 04/15/2028 DD 10/26/17	1.591.594
NIELSEN CO LUXEMBOURG SAR 144A 5.500% 10/01/2021 DD 09/27/13	1.588.116
STAPLES INC 144A 10.750% 04/15/2027 DD 04/16/19	1.586.927
JELD-WEN INC 144A 4.875% 12/15/2027 DD 12/14/17	1.584.989
ENERGY VENTURES GOM LLC / 144A 11.000% 02/15/2023 DD 02/15/18	1.584.900
VIRGIN MEDIA SECURED FINA REGS 5.250% 05/15/2029	1.583.378
ALTICE LUXEMBOURG SA 144A 10.500% 05/15/2027 DD 05/08/19	1.583.375
CSC HOLDINGS LLC 144A 7.750% 07/15/2025 DD 07/15/18	1.581.505
UPCB FINANCE VII LTD REGS 3.625% 06/15/2029	1.577.859
CREDIT AGRICOLE SA REGS VAR RT 12/31/2049	1.577.227
REXEL SA REGS 2.125% 06/15/2025	1.571.262
STANDARD INDUSTRIES INC/N 144A 5.375% 11/15/2024 DD 11/10/14	1.569.855
INTERNATIONAL GAME TECHNO 144A 6.250% 02/15/2022 DD 02/13/15	1.569.577
TENET HEALTHCARE CORP 6.750% 06/15/2023 DD 06/16/15	1.569.026
GOLDEN NUGGET INC 144A 6.750% 10/15/2024 DD 10/04/16	1.567.483
TRANSMONTAIGNE PARTNERS LP / T 6.125% 02/15/2026 DD 02/12/18	1.567.127
PETSMART INC 144A 5.875% 06/01/2025 DD 05/31/17	1.566.470
ALLIANT HOLDINGS INTERMED 144A 6.750% 10/15/2027 DD 10/11/19	1.564.684
STEVENS HOLDING CO INC 144A 6.125% 10/01/2026 DD 10/01/18	1.563.078
SUNOCO LP / SUNOCO FINANCE COR 5.500% 02/15/2026 DD 08/15/18	1.562.027
CLEAR CHANNEL WORLDWIDE H 144A 5.125% 08/15/2027 DD 08/23/19	1.559.399
GFL ENVIRONMENTAL INC 144A 8.500% 05/01/2027 DD 04/23/19	1.556.169
FAURECIA SE REGS 3.125% 06/15/2026	1.554.843
VIRGIN MEDIA SECURED FINA 144A 5.500% 08/15/2026 DD 04/26/16	1.554.655
CORE & MAIN LP 144A 6.125% 08/15/2025 DD 08/01/17	1.551.909
HCA INC 7.690% 06/15/2025 DD 06/30/95	1.551.203
TRANSDIGM INC 6.375% 06/15/2026 DD 12/15/16	1.549.577
SHOP DIRECT FUNDING PLC REGS 7.750% 11/15/2022	1.547.721
BARCLAYS PLC VAR RT 12/31/2049	1.546.465
UGI INTERNATIONAL LLC REGS 3.250% 11/01/2025	1.544.635
PINEWOOD FINANCE CO LTD REGS 3.250% 09/30/2025	1.541.762
CREDIT SUISSE AG REGS VAR RT 09/18/2025	1.540.195
UNITI GROUP LP / UNITI GROUP F 8.250% 10/15/2023 DD 04/24/15	1.539.020

Naam	Waarde in euro's
BERRY GLOBAL INC 144A 5.625% 07/15/2027 DD 06/05/19	1.533.508
MAUSER PACKAGING SOLUTION 144A 5.500% 04/15/2024 DD 04/03/17	1.533.450
ICAHN ENTERPRISES LP / IC 144A 4.750% 09/15/2024 DD 09/06/19	1.533.241
UBS GROUP AG REGS VAR RT 12/31/2049	1.531.238
BERRY GLOBAL INC 5.125% 07/15/2023 DD 06/05/15	1.526.804
VIRGIN MEDIA SECURED FINA REGS 5.000% 04/15/2027	1.526.094
IQVIA INC 144A 5.000% 10/15/2026 DD 09/28/16	1.517.884
CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 5.625% 10/01/2026 DD 04/01/19	1.516.771
KRONOS INTERNATIONAL INC REGS 3.750% 09/15/2025	1.515.395
ELDORADO RESORTS INC 6.000% 04/01/2025 DD 03/29/17	1.515.367
APERGY CORP 6.375% 05/01/2026 DD 11/01/18	1.514.125
PATTERN ENERGY GROUP INC 144A 5.875% 02/01/2024 DD 01/25/17	1.512.194
REALOGY GROUP LLC / REALO 144A 4.875% 06/01/2023 DD 06/01/16	1.509.310
TRUCK HERO INC 144A 8.500% 04/21/2024 DD 05/10/19	1.504.855
TRANSDIGM INC 144A 6.250% 03/15/2026 DD 02/13/19	1.494.918
WR GRACE & CO-CONN 144A 5.125% 10/01/2021 DD 09/16/14	1.494.797
ENERGIZER HOLDINGS INC 144A 6.375% 07/15/2026 DD 07/06/18	1.494.321
TARGA RESOURCES PARTNERS 144A 5.500% 03/01/2030 DD 11/27/19	1.492.049
THYSSENKRUPP AG REGS 1.875% 03/06/2023	1.487.724
VIRGIN MEDIA RECEIVABLES REGS 5.500% 09/15/2024	1.487.139
INEOS GROUP HOLDINGS SA 144A 5.625% 08/01/2024 DD 08/09/16	1.486.748
INTERNATIONAL GAME TECHNO REGS 4.750% 02/15/2023	1.485.392
NEXI SPA REGS 1.750% 10/31/2024	1.481.767
GO DADDY OPERATING CO LLC 144A 5.250% 12/01/2027 DD 06/04/19	1.481.470
PLAYTECH PLC REGS 3.750% 10/12/2023	1.479.015
IHEARTCOMMUNICATIONS INC 6.375% 05/01/2026 DD 05/01/19	1.474.053
PTC INC 6.000% 05/15/2024 DD 05/12/16	1.468.224
ARDAGH PACKAGING FINANCE REGS 2.125% 08/15/2026	1.464.455
CENTENNIAL RESOURCE PRODU 144A 6.875% 04/01/2027 DD 03/15/19	1.463.875
NIELSEN FINANCE LLC / NIELSEN 4.500% 10/01/2020 DD 04/01/13	1.462.851
CLEVELAND-CLIFFS INC 144A 5.875% 06/01/2027 DD 05/13/19	1.462.450
INTERTRUST GROUP BV REGS 3.375% 11/15/2025	1.461.482
TELECOM ITALIA SPA/MILANO REGS 4.000% 04/11/2024	1.461.112
AMERICAN BUILDERS & CONTR 144A 5.875% 05/15/2026 DD 05/11/18	1.456.737
HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG REGS VAR RT 12/31/2049	1.456.298
ALTICE FRANCE SA/FRANCE 144A 5.500% 01/15/2028 DD 09/27/19	1.454.590
PROGROUP AG REGS 3.000% 03/31/2026	1.451.917
ELIS SA REGS 1.875% 02/15/2023	1.449.316
STARWOOD PROPERTY TRUST INC 3.625% 02/01/2021 DD 08/01/18	1.447.745

Naam	Waarde in euro's
TERRAFORM POWER OPERATING 144A 5.000% 01/31/2028 DD 12/12/17	1.447.738
CROWN EUROPEAN HOLDINGS S REGS 2.875% 02/01/2026	1.443.438
GRIFOLS SA REGS 2.250% 11/15/2027	1.441.309
SIGNATURE AVIATION US HOL 144A 5.375% 05/01/2026 DD 04/26/18	1.439.427
CEDAR FAIR LP 144A 5.250% 07/15/2029 DD 06/27/19	1.430.267
MAUSER PACKAGING SOLUTION 144A 7.250% 04/15/2025 DD 04/03/17	1.425.167
AMERICAN BUILDERS & CONTR 144A 4.000% 01/15/2028 DD 10/31/19	1.425.069
CALPINE CORP 144A 5.125% 03/15/2028 DD 12/27/19	1.419.432
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP 10.500% 09/15/2022 DD 03/15/16	1.417.984
LENNAR CORP VAR RT 11/15/2022 DD 05/15/13	1.417.149
VIRGIN MEDIA SECURED FINA REGS 4.875% 01/15/2027	1.416.411
SPRINGLEAF FINANCE CORP 7.125% 03/15/2026 DD 05/11/18	1.416.281
GRAY TELEVISION INC 144A 7.000% 05/15/2027 DD 11/16/18	1.415.668
BERRY GLOBAL INC REGS 1.000% 01/15/2025	1.414.000
RESIDEO FUNDING INC 144A 6.125% 11/01/2026 DD 10/19/18	1.409.154
CRESTWOOD MIDSTREAM PARTNERS L VAR RT 04/01/2023 DD 04/01/16	1.408.463
TRANSOCEAN INC 144A 7.250% 11/01/2025 DD 10/25/18	1.405.612
UNIVAR SOLUTIONS USA INC/ 144A 5.125% 12/01/2027 DD 11/22/19	1.404.105
ZIGGO BOND CO BV REGS 4.625% 01/15/2025	1.403.561
ELIS SA REGS 1.000% 04/03/2025	1.401.910
NIELSEN CO LUXEMBOURG SAR 144A 5.000% 02/01/2025 DD 01/31/17	1.399.332
CENTENNIAL RESOURCE PRODU 144A 6.875% 04/01/2027 DD 03/15/19	1.391.608
MPT OPERATING PARTNERSHIP LP / 5.500% 05/01/2024 DD 04/17/14	1.389.666
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.750% 02/15/2026 DD 11/20/15	1.386.329
TRIDENT TPI HOLDINGS INC 144A 9.250% 08/01/2024 DD 07/24/19	1.385.657
BALL CORP 4.375% 12/15/2023	1.378.520
PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.625% 01/16/2034	1.376.170
CONSTELLIUM SE 144A 6.625% 03/01/2025 DD 02/16/17	1.374.531
BOMBARDIER INC 144A 5.750% 03/15/2022 DD 03/08/12	1.370.949
NOVA CHEMICALS CORP 144A 4.875% 06/01/2024 DD 06/09/17	1.370.535
NUSTAR LOGISTICS LP 5.625% 04/28/2027 DD 04/28/17	1.367.559
RESIDEO FUNDING INC 144A 6.125% 11/01/2026 DD 10/19/18	1.364.276
GTCR AP FINANCE INC 144A 8.000% 05/15/2027 DD 05/13/19	1.361.960
ARCONIC INC 5.125% 10/01/2024 DD 09/22/14	1.359.465
TELEFONICA EUROPE BV REGS VAR RT 12/31/2049	1.358.522
HILL-ROM HOLDINGS INC 144A 5.000% 02/15/2025 DD 02/14/17	1.358.254
ELDORADO RESORTS INC 6.000% 09/15/2026 DD 03/15/19	1.353.875
DRAX FINCO PLC REGS 4.250% 05/01/2022	1.352.763
FREEPORT-MCMORAN INC 5.250% 09/01/2029 DD 08/15/19	1.350.458

Naam	Waarde in euro's
CDK GLOBAL INC 4.875% 06/01/2027 DD 12/01/17	1.350.306
TAYLOR MORRISON COMMUNITI 144A 5.750% 01/15/2028 DD 08/01/19	1.344.900
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 4.750% 03/01/2030 DD 10/01/19	1.342.258
ZIGGO BV REGS 4.250% 01/15/2027	1.336.193
OUTFRONT MEDIA CAPITAL LL 144A 4.625% 03/15/2030 DD 11/18/19	1.335.214
WYNN RESORTS FINANCE LLC 144A 5.125% 10/01/2029 DD 09/20/19	1.334.773
INFOR US INC 6.500% 05/15/2022 DD 11/15/15	1.333.742
FOODCO BONDCO SL REGS 6.250% 05/15/2026	1.332.499
PROVIDENT FUNDING ASSOCIA 144A 6.375% 06/15/2025 DD 06/08/17	1.329.657
UNITED GROUP BV REGS 4.875% 07/01/2024	1.328.782
GW B-CR SECURITY CORP 144A 9.500% 11/01/2027 DD 10/30/19	1.325.697
IRON MOUNTAIN INC 144A 4.875% 09/15/2029 DD 09/09/19	1.324.838
SAFARI VERWALTUNGS GMBH REGS 5.375% 11/30/2022	1.323.833
REFINITIV US HOLDINGS INC REGS 4.500% 05/15/2026	1.323.312
SMURFIT KAPPA ACQUISITION REGS 2.375% 02/01/2024	1.321.599
JAGGED PEAK ENERGY LLC 5.875% 05/01/2026 DD 11/01/18	1.319.919
ARROW GLOBAL FINANCE PLC REGS 5.125% 09/15/2024	1.319.535
SENSATA TECHNOLOGIES UK F 144A 6.250% 02/15/2026 DD 11/27/15	1.318.918
ZAYO GROUP LLC / ZAYO CAPITAL 6.000% 04/01/2023 DD 10/01/15	1.316.269
HCA INC 5.375% 09/01/2026 DD 08/23/18	1.314.671
INTELSAT JACKSON HOLDINGS 144A 8.500% 10/15/2024 DD 09/19/18	1.307.213
B&G FOODS INC 5.250% 04/01/2025 DD 04/03/17	1.306.368
MEDNAX INC 144A 6.250% 01/15/2027 DD 11/13/18	1.305.791
VZ VENDOR FINANCING BV REGS 2.500% 01/31/2024	1.304.796
RADIATE HOLDCO LLC / RADI 144A 6.625% 02/15/2025 DD 02/01/17	1.303.777
ENQUEST PLC 144A 7.000% 10/15/2023	1.299.713
GENESIS ENERGY LP / GENESIS EN 6.250% 05/15/2026 DD 12/11/17	1.297.439
GESTAMP FUNDING LUXEMBOUR REGS 3.500% 05/15/2023	1.297.321
VERSCEND ESCROW CORP 144A 9.750% 08/15/2026 DD 08/27/18	1.296.910
DIAMOND SPORTS GROUP LLC 144A 5.375% 08/15/2026 DD 08/02/19	1.289.560
ARD FINANCE SA 144A 6.500% 06/30/2027 DD 11/20/19	1.289.559
OCI NV REGS 3.125% 11/01/2024	1.287.997
KFC HOLDING CO/PIZZA HUT 144A 5.250% 06/01/2026 DD 06/16/16	1.287.617
RANGE RESOURCES CORP 4.875% 05/15/2025 DD 11/15/15	1.287.261
CALPINE CORP 144A 5.250% 06/01/2026 DD 05/31/16	1.286.605
COLFAX CORP 144A 6.000% 02/15/2024 DD 02/05/19	1.286.359
AXALTA COATING SYSTEMS DU REGS 3.750% 01/15/2025	1.286.261
ARDONAGH MIDCO 3 PLC REGS 8.375% 07/15/2023	1.280.281
GROUP 1 AUTOMOTIVE INC VAR RT 06/01/2022 DD 06/01/15	1.277.912

Naam	Waarde in euro's
SENSATA TECHNOLOGIES UK F 144A 6.250% 02/15/2026 DD 11/27/15	1.276.682
MGM RESORTS INTERNATIONAL 6.000% 03/15/2023 DD 11/25/14	1.275.935
HOUSE OF FINANCE NV/THE REGS 4.375% 07/15/2026	1.274.771
VERTIV INTERMEDIATE HOLDI 144A 12.000% 02/15/2022 DD 02/09/17	1.270.880
FREEPORT-MCMORAN INC 5.450% 03/15/2043 DD 09/15/13	1.267.817
LIVE NATION ENTERTAINMENT 144A 4.875% 11/01/2024 DD 10/31/16	1.266.895
SPRINT COMMUNICATIONS 11/18 TL	1.264.385
ENDEAVOR ENERGY RESOURCES 144A 5.750% 01/30/2028 DD 12/07/17	1.261.500
WPX ENERGY INC 5.750% 06/01/2026 DD 05/23/18	1.259.127
ALTICE FINANCING SA REGS 5.250% 02/15/2023	1.256.986
CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 5.750% 10/15/2025 DD 04/15/19	1.256.437
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 5.500% 11/01/2025 DD 10/17/17	1.253.069
SIRIUS XM RADIO INC 144A 3.875% 08/01/2022 DD 07/05/17	1.250.974
ALBERTSONS COS INC / SAFE 144A 5.875% 02/15/2028 DD 08/15/19	1.248.497
VOLVO CAR AB REGS 2.000% 01/24/2025	1.247.131
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.875% 04/01/2024 DD 02/19/16	1.246.026
HCA INC 7.500% 02/15/2022 DD 08/01/11	1.245.278
TARGA RESOURCES PARTNERS LP / 5.125% 02/01/2025 DD 10/06/16	1.243.151
LOXAM SAS REGS 3.750% 07/15/2026	1.243.041
CINEMARK USA INC 5.125% 12/15/2022 DD 12/18/12	1.242.922
INFORMATICA LLC 144A 7.125% 07/15/2023 DD 06/16/15	1.242.414
DUFRIY ONE BV REGS 2.500% 10/15/2024	1.237.492
HUDBAY MINERALS INC 144A 7.625% 01/15/2025 DD 12/12/16	1.236.510
DUFRIY ONE BV REGS 2.000% 02/15/2027	1.236.144
GENESYS TELECOMMUNICATION 144A 10.000% 11/30/2024 DD 12/01/16	1.234.889
POST HOLDINGS INC 144A 5.625% 01/15/2028 DD 12/01/17	1.233.486
SMURFIT KAPPA TREASURY UL REGS 1.500% 09/15/2027	1.233.220
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP P VAR RT 12/31/2049 DD 08/10/15	1.230.735
TRIMAS CORP 144A 4.875% 10/15/2025 DD 09/20/17	1.229.577
REFINITIV US HOLDINGS INC 144A 8.250% 11/15/2026 DD 10/01/18	1.229.092
BALL CORP 1.500% 03/15/2027	1.227.011
TENET HEALTHCARE CORP 5.125% 05/01/2025 DD 06/14/17	1.225.906
ALTICE LUXEMBOURG SA REGS 6.250% 02/15/2025	1.224.347
POST HOLDINGS INC 144A 5.500% 03/01/2025 DD 02/14/17	1.222.472
KONINKLIJKE KPN NV REGS VAR RT 12/31/2049	1.222.052
HERC HOLDINGS INC 144A 5.500% 07/15/2027 DD 07/09/19	1.221.744
ELEMENT SOLUTIONS INC 144A 5.875% 12/01/2025 DD 11/24/17	1.221.013
ALTICE LUXEMBOURG SA 144A 10.500% 05/15/2027 DD 05/08/19	1.218.762
ORANGE SA REGS VAR RT 12/31/2049	1.216.538

Naam	Waarde in euro's
GLOBAL AIRCRAFT LEASING C 144A 6.500% 09/15/2024 DD 07/31/19	1.215.887
TRI POINTE GROUP INC / TRI POI 5.875% 06/15/2024 DD 06/15/15	1.215.869
DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.600% 04/01/2044 DD 03/13/14	1.215.301
AVIS BUDGET CAR RENTAL LL 144A 5.250% 03/15/2025 DD 03/11/15	1.214.337
BUCKEYE PARTNERS LP 4.125% 12/01/2027 DD 11/20/17	1.214.187
APX GROUP INC 144A 8.500% 11/01/2024 DD 05/10/19	1.212.143
TESLA INC 144A 5.300% 08/15/2025 DD 08/18/17	1.209.800
ADT SECURITY CORP/THE 144A 4.875% 07/15/2032 DD 05/02/16	1.209.710
COMMSCOPE TECHNOLOGIES LL 144A 6.000% 06/15/2025 DD 06/11/15	1.206.707
BOMBARDIER INC 144A 7.500% 12/01/2024 DD 11/27/17	1.205.534
BMC EAST LLC 144A 5.500% 10/01/2024 DD 09/15/16	1.204.454
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES REGS 3.750% 03/29/2024	1.202.800
ADLER REAL ESTATE AG REGS 1.500% 12/06/2021	1.200.268
ATOTECH ALPHA 2 BV 144A 8.750% 06/01/2023 DD 05/30/18	1.199.465
SWISSPORT FINANCING SARL REGS 5.250% 08/15/2024	1.198.857
VOLVO CAR AB REGS 2.125% 04/02/2024	1.196.043
GENESIS ENERGY LP / GENESIS EN 6.500% 10/01/2025 DD 08/14/17	1.193.753
TRANSOCEAN SENTRY LTD 144A 5.375% 05/15/2023 DD 05/24/19	1.190.180
TIVITY HEALTH 3/19 TLB	1.187.931
NOKIA OYJ REGS 2.000% 03/11/2026	1.183.618
PANTHER BF AGGREGATOR 2 L 144A 8.500% 05/15/2027 DD 04/01/19	1.183.185
CENTENNIAL RESOURCE PRODU 144A 5.375% 01/15/2026 DD 11/30/17	1.180.751
ASCEND LEARNING LLC 144A 6.875% 08/01/2025 DD 07/12/17	1.174.878
ARCHROCK PARTNERS LP / AR 144A 6.250% 04/01/2028 DD 12/20/19	1.169.933
MURPHY OIL CORP 5.875% 12/01/2027 DD 11/27/19	1.168.330
TENET HEALTHCARE CORP 4.625% 07/15/2024 DD 06/14/17	1.168.306
CHESAPEAKE ENERGY CORP 6.875% 11/15/2020 DD 05/15/06	1.166.592
REFINITIV US HOLDINGS INC REGS 6.875% 11/15/2026	1.165.495
ARDAGH PACKAGING FINANCE 144A 5.250% 08/15/2027 DD 08/12/19	1.157.069
RITCHIE BROS AUCTIONEERS 144A 5.375% 01/15/2025 DD 12/21/16	1.154.412
LENNAR CORP 8.375% 01/15/2021 DD 01/15/18	1.154.065
INTELSAT JACKSON HOLDINGS 144A 9.750% 07/15/2025 DD 07/05/17	1.153.675
SILGAN HOLDINGS INC 4.750% 03/15/2025 DD 09/15/17	1.149.572
GRAY TELEVISION INC 144A 5.875% 07/15/2026 DD 06/14/16	1.146.670
ASGN INC 144A 4.625% 05/15/2028 DD 11/22/19	1.146.464
FRONTDOOR INC 144A 6.750% 08/15/2026 DD 08/16/18	1.145.835
CROWN EUROPEAN HOLDINGS S REGS 3.375% 05/15/2025	1.145.768
SIRIUS XM RADIO INC 144A 4.625% 05/15/2023 DD 05/16/13	1.143.853
OLIN CORP 5.000% 02/01/2030 DD 01/19/18	1.143.853

Naam	Waarde in euro's
SM ENERGY CO 6.625% 01/15/2027 DD 08/20/18	1.138.273
GARTNER INC 144A 5.125% 04/01/2025 DD 03/30/17	1.138.186
CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS I 6.250% 03/31/2023 DD 03/16/17	1.136.619
MOHEGAN GAMING & ENTERTAI 144A 7.875% 10/15/2024 DD 10/14/16	1.134.933
AXALTA COATING SYSTEMS LL 144A 4.875% 08/15/2024 DD 08/16/16	1.132.276
EMBARQ CORP 7.995% 06/01/2036 DD 05/17/06	1.130.512
TARGA RESOURCES PARTNERS LP / 4.250% 11/15/2023 DD 05/14/13	1.129.220
ARD FINANCE SA 144A 6.500% 06/30/2027 DD 11/20/19	1.128.364
CALPINE CORP 144A 4.500% 02/15/2028 DD 12/20/19	1.127.058
TEGNA INC 144A 5.000% 09/15/2029 DD 09/13/19	1.125.822
PLATIN 1426 GMBH REGS 5.375% 06/15/2023	1.123.721
NETFLIX INC 144A 4.875% 06/15/2030 DD 10/25/19	1.122.842
MASONITE INTERNATIONAL CO 144A 5.750% 09/15/2026 DD 08/27/18	1.121.659
ENERGIZER HOLDINGS INC 144A 7.750% 01/15/2027 DD 01/28/19	1.121.035
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.125% 05/01/2023 DD 04/21/15	1.118.374
PLAYTECH PLC REGS 4.250% 03/07/2026	1.117.696
LPL HOLDINGS INC 144A 4.625% 11/15/2027 DD 11/12/19	1.117.684
COMMSCOPE INC 144A 8.250% 03/01/2027 DD 02/19/19	1.115.791
LIVE NATION ENTERTAINMENT 144A 4.875% 11/01/2024 DD 10/31/16	1.115.679
CSC HOLDINGS LLC 144A 6.500% 02/01/2029 DD 01/31/19	1.112.517
USA COMPRESSION PARTNERS LP / 6.875% 04/01/2026 DD 10/01/18	1.112.205
WPX ENERGY INC 5.250% 09/15/2024 DD 09/08/14	1.112.194
BOYD GAMING CORP 6.375% 04/01/2026 DD 10/01/16	1.111.882
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 4.000% 03/01/2023 DD 10/17/17	1.106.320
VIZIENT INC 144A 6.250% 05/15/2027 DD 05/06/19	1.105.746
TEAM HEALTH 1/17 COV-LITE TL 0.000% 02/06/2024 DD 11/01/16	1.101.975
NXP BV / NXP FUNDING LLC 144A 4.125% 06/01/2021 DD 05/23/16	1.096.076
SAIPEM FINANCE INTERNATIO REGS 2.625% 01/07/2025	1.093.705
MERITAGE HOMES CORP 7.000% 04/01/2022 DD 04/10/12	1.093.399
US CONCRETE INC 6.375% 06/01/2024 DD 06/07/16	1.092.567
SIRIUS XM RADIO INC 144A 5.000% 08/01/2027 DD 07/05/17	1.085.546
REYNOLDS GROUP ISSUER INC 144A 7.000% 07/15/2024 DD 06/27/16	1.082.099
ALTICE FRANCE SA/FRANCE 144A 8.125% 02/01/2027 DD 07/31/18	1.078.591
SIX FLAGS ENTERTAINMENT C 144A 4.875% 07/31/2024 DD 06/16/16	1.075.484
ALCOA NEDERLAND HOLDING B 144A 6.750% 09/30/2024 DD 09/27/16	1.073.179
PRESTIGE BRANDS INC 144A 5.125% 01/15/2028 DD 12/02/19	1.072.229
TALLGRASS ENERGY PARTNERS 144A 5.500% 01/15/2028 DD 09/15/17	1.071.234
WEEKLEY HOMES LLC / WEEKLEY FI 6.000% 02/01/2023 DD 02/04/13	1.070.379
AVANTOR INC 144A 9.000% 10/01/2025 DD 10/02/17	1.070.240

Naam	Waarde in euro's
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.875% 04/01/2024 DD 02/19/16	1.067.364
HOWDEN 9/19 TLB 0.000% 12/31/2022 DD 09/05/19	1.067.249
POST HOLDINGS INC 144A 5.750% 03/01/2027 DD 02/14/17	1.067.245
TRAVIS PERKINS PLC REGS 4.500% 09/07/2023	1.065.818
KORN FERRY 144A 4.625% 12/15/2027 DD 12/16/19	1.065.434
TARGA RESOURCES PARTNERS LP / 5.000% 01/15/2028 DD 10/17/17	1.064.980
NETFLIX INC 5.875% 11/15/2028 DD 04/26/18	1.060.662
SPCM SA 144A 4.875% 09/15/2025 DD 04/20/17	1.059.920
IQVIA INC 144A 5.000% 05/15/2027 DD 05/10/19	1.059.269
CSC HOLDINGS LLC 144A 5.375% 07/15/2023 DD 07/15/18	1.059.243
HERTZ CORP/THE 144A 5.500% 10/15/2024 DD 09/22/16	1.059.243
MGM RESORTS INTERNATIONAL 5.500% 04/15/2027 DD 04/10/19	1.058.085
WESCO DISTRIBUTION INC 5.375% 06/15/2024 DD 12/15/16	1.053.675
ALLIED UNIVERSAL HOLDCO L 144A 6.625% 07/15/2026 DD 07/12/19	1.053.158
PANTHER BF AGGREGATOR 2 L 144A 8.500% 05/15/2027 DD 04/01/19	1.052.561
LENNAR CORP 5.375% 10/01/2022 DD 04/01/18	1.050.857
TELEFONICA EUROPE BV REGS VAR RT 12/31/2049	1.049.490
FELCOR LODGING LP 6.000% 06/01/2025 DD 05/21/15	1.047.327
EMC CORP 2.650% 06/01/2020 DD 06/06/13	1.046.959
CENTENE CORP 4.750% 05/15/2022 DD 04/29/14	1.044.989
EXTRACTION OIL & GAS INC 144A 5.625% 02/01/2026 DD 01/25/18	1.036.971
VIRGIN MEDIA FINANCE PLC 144A 6.000% 10/15/2024 DD 10/07/14	1.036.882
GKN HOLDINGS LTD REGS STEP 05/12/2032	1.035.784
IHO VERWALTUNGS GMBH REGS 3.750% 09/15/2026	1.033.296
LEVEL 3 FINANCING INC 5.625% 02/01/2023 DD 06/15/15	1.027.572
EAGLE HOLDING CO II LLC 144A 7.750% 05/15/2022 DD 05/14/19	1.024.878
PDC ENERGY INC 6.125% 09/15/2024 DD 03/15/17	1.023.775
ENQUEST PLC REGS 7.000% 04/15/2023	1.023.145
CAESARS RESORT COLLECTION 144A 5.250% 10/15/2025 DD 10/16/17	1.022.552
TENET HEALTHCARE CORP 144A 6.250% 02/01/2027 DD 02/05/19	1.022.078
SOLERA LLC / SOLERA FINAN 144A 10.500% 03/01/2024 DD 03/03/16	1.020.886
ENVIVA PARTNERS LP / ENVI 144A 6.500% 01/15/2026 DD 12/09/19	1.020.556
TARGA RESOURCES PARTNERS 144A 6.500% 07/15/2027 DD 01/17/19	1.019.399
TELECOM ITALIA FINANCE SA 7.750% 01/24/2033	1.019.273
GLOBAL PARTNERS LP / GLP 144A 7.000% 08/01/2027	1.017.539
STAPLES INC 144A 10.750% 04/15/2027 DD 04/16/19	1.017.261
LA FINANCIERE ATALIAN SAS REGS 4.000% 05/15/2024	1.014.797
BWAY 3/17 TLB	1.008.819
ALGECO GLOBAL FINANCE PLC REGS 6.500% 02/15/2023	1.008.363

Naam	Waarde in euro's
NOVA CHEMICALS CORP 144A 5.250% 06/01/2027 DD 06/09/17	1.005.989
LENNAR CORP 6.250% 12/15/2021 DD 12/15/17	1.005.568
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC 5.750% 06/15/2025 DD 06/05/15	1.005.345
EDP - ENERGIAS DE PORTUGA REGS VAR RT 04/30/2079	1.005.212
MAUSER PACKAGING SOLUTION 144A 5.500% 04/15/2024 DD 04/03/17	1.000.275
CEDAR FAIR LP / CANADA'S WONDE 5.375% 06/01/2024 DD 12/01/14	999.581
NCR CORP 144A 6.125% 09/01/2029 DD 08/21/19	994.734
POST HOLDINGS INC 144A 5.750% 03/01/2027 DD 02/14/17	993.675
L BRANDS INC 7.500% 06/15/2029 DD 06/20/19	991.920
NOVELIS CORP 144A 6.250% 08/15/2024 DD 08/29/16	988.488
CPI PROPERTY GROUP SA REGS VAR RT 12/31/2049	985.572
MPH ACQUISITION HOLDINGS 144A 7.125% 06/01/2024 DD 06/07/16	984.307
TOLL BROTHERS FINANCE CORP 4.375% 04/15/2023 DD 04/10/13	982.160
GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA REGS 7.500% 08/01/2022	977.643
VIRGIN MEDIA RECEIVABLES REGS 5.750% 04/15/2023	969.440
AMERICAN TIRE DISTRIBUTORS 2/18 FILO EXIT COV-LITE TL	969.051
CEDAR FAIR LP / CANADA'S WONDE 5.375% 04/15/2027 DD 04/15/18	968.232
NETFLIX INC 6.375% 05/15/2029 DD 10/26/18	967.384
BOYD GAMING CORP 144A 4.750% 12/01/2027 DD 12/03/19	967.032
BERRY GLOBAL INC 144A 4.875% 07/15/2026 DD 06/05/19	966.847
INTERNATIONAL GAME TECHNO REGS 3.500% 07/15/2024	966.776
INTERNATIONAL GAME TECHNO REGS 2.375% 04/15/2028	966.491
SUMMER BIDCO BV REGS 9.000% 11/15/2025	964.542
LSF10 WOLVERINE INVESTMEN REGS 5.000% 03/15/2024	962.399
CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDING 5.750% 09/01/2023 DD 03/01/14	962.027
COLFAX CORP 144A 6.000% 02/15/2024 DD 02/05/19	960.746
ZAYO GROUP LLC / ZAYO CAPITAL 6.375% 05/15/2025 DD 11/15/15	959.659
EAGLE HOLDING CO II LLC 144A 7.750% 05/15/2022 DD 05/14/19	958.844
TOLL BROTHERS FINANCE CORP 4.350% 02/15/2028 DD 01/22/18	956.592
WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 4.500% 03/01/2028 DD 03/02/18	956.062
UPC HOLDING BV REGS 3.875% 06/15/2029	949.715
MILLER HOMES GROUP HOLDIN REGS 5.500% 10/15/2024	947.998
DUN & BRADSTREET CORP/THE 144A 10.250% 02/15/2027 DD 02/08/19	947.661
ADLER REAL ESTATE AG REGS 3.000% 04/27/2026	947.625
CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 5.000% 09/15/2026 DD 03/15/17	946.497
ARDAGH PACKAGING FINANCE 144A 4.125% 08/15/2026 DD 08/12/19	946.013
SEDGWICK CMS 12/18 COV-LITE TL 0.000% 11/06/2025 DD 10/29/18	945.787
CENTENE CORP 4.750% 01/15/2025 DD 11/09/16	944.805
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.500% 05/01/2026 DD 04/21/16	943.447

Naam	Waarde in euro's
CPI PROPERTY GROUP SA REGS VAR RT 12/31/2049	941.799
UNITED RENTALS NORTH AMERICA I 6.500% 12/15/2026 DD 10/30/18	939.955
SPIE SA REGS 2.625% 06/18/2026	939.491
COMMSCOPE INC 144A 6.000% 03/01/2026 DD 02/19/19	938.185
ALTICE FRANCE SA/FRANCE REGS 2.500% 01/15/2025	933.451
CEMEX SAB DE CV REGS 3.125% 03/19/2026	932.886
TAYLOR MORRISON COMMUNITI 144A 5.875% 06/15/2027 DD 06/05/19	930.958
LAMAR MEDIA CORP 5.375% 01/15/2024 DD 07/15/14	930.494
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.000% 02/01/2028 DD 08/08/17	930.132
HERTZ CORP/THE 144A 7.125% 08/01/2026 DD 08/01/19	930.078
CLEAR CHANNEL WORLDWIDE H 144A 5.125% 08/15/2027 DD 08/23/19	927.661
PAR PHARMACEUTICAL INC 144A 7.500% 04/01/2027 DD 03/28/19	925.416
TEVA PHARMACEUTICAL FINAN REGS 6.000% 01/31/2025	922.582
JAGUAR LAND ROVER AUTOMOT REGS 2.200% 01/15/2024	918.984
GFL ENVIRONMENTAL INC 144A 7.000% 06/01/2026 DD 05/14/18	916.645
ALTICE FRANCE SA/FRANCE 144A 5.500% 01/15/2028 DD 09/27/19	915.412
JAMES HARDIE INTERNATIONA 144A 5.000% 01/15/2028 DD 12/13/17	909.220
IHEARTCOMMUNICATIONS INC 144A 4.750% 01/15/2028 DD 11/22/19	905.835
DENBURY RESOURCES INC 144A 9.000% 05/15/2021 DD 05/10/16	905.011
TOLL BROTHERS FINANCE CORP 4.875% 03/15/2027 DD 03/10/17	904.410
PRESTIGE BRANDS INC 144A 6.375% 03/01/2024 DD 02/19/16	898.708
IHEARTCOMMUNICATIONS INC 144A 5.250% 08/15/2027 DD 08/07/19	890.171
AMSTED INDUSTRIES INC 144A 4.625% 05/15/2030 DD 12/16/19	888.336
CROWN EUROPEAN HOLDINGS S REGS 4.000% 07/15/2022	887.766
ASCEND LEARNING LLC 144A 6.875% 08/01/2025 DD 02/01/19	885.835
TIVITY HEALTH 3/19 TLA	885.110
MPH ACQUISITION HOLDINGS 144A 7.125% 06/01/2024 DD 06/07/16	883.463
COMMSCOPE INC 144A 6.000% 03/01/2026 DD 02/19/19	881.325
MAUSER PACKAGING SOLUTION 144A 7.250% 04/15/2025 DD 04/03/17	879.733
BOYD GAMING CORP 144A 4.750% 12/01/2027 DD 12/03/19	879.120
ALCOA NEDERLAND HOLDING B 144A 7.000% 09/30/2026 DD 09/27/16	878.873
ICAHN ENTERPRISES LP / ICAHN E 6.250% 05/15/2026 DD 05/10/19	877.617
BALL CORP 0.875% 03/15/2024	874.510
BERRY GLOBAL INC 144A 4.500% 02/15/2026 DD 01/26/18	873.921
INTELSAT CONNECT FINANCE 144A 9.500% 02/15/2023 DD 08/16/18	872.677
INTELSAT JACKSON HOLDINGS 144A 8.500% 10/15/2024 DD 09/19/18	872.287
ENERSYS 144A 4.375% 12/15/2027 DD 12/11/19	871.024
EQUINIX INC 2.875% 10/01/2025	867.135
SPX FLOW INC 144A 5.875% 08/15/2026 DD 08/10/16	866.726

Naam	Waarde in euro's
ALLY FINANCIAL INC 8.000% 11/01/2031 DD 12/31/08	865.630
CALPINE CORP 144A 5.125% 03/15/2028 DD 12/27/19	863.844
VICI PROPERTIES LP / VICI 144A 4.250% 12/01/2026 DD 11/26/19	863.457
ELDORADO RESORTS INC 6.000% 09/15/2026 DD 03/15/19	861.379
ELDORADO RESORTS INC 7.000% 08/01/2023 DD 02/01/16	857.016
FREEPORT-MCMORAN INC 5.000% 09/01/2027 DD 08/15/19	855.902
QEP RESOURCES INC 5.625% 03/01/2026 DD 11/21/17	855.787
SHEA HOMES LP / SHEA HOME 144A 6.125% 04/01/2025 DD 03/23/15	852.895
ENDO DAC / ENDO FINANCE L 144A 6.000% 07/15/2023 DD 07/09/15	851.552
CO-OPERATIVE GROUP LTD REGS 5.125% 05/17/2024	850.945
TEMPO ACQUISITION LLC / T 144A 6.750% 06/01/2025 DD 05/01/17	850.835
MURPHY OIL CORP 6.875% 08/15/2024 DD 08/17/16	850.579
HCA INC 5.375% 02/01/2025 DD 01/16/15	849.199
HCA INC 5.875% 02/01/2029 DD 01/30/19	848.775
INTELSAT JACKSON 11/17 TLB3	847.078
MASONITE INTERNATIONAL CO 144A 5.375% 02/01/2028 DD 07/25/19	846.882
TAYLOR MORRISON COMMUNITI 144A 5.750% 01/15/2028 DD 08/01/19	846.753
FAURECIA SE REGS 2.375% 06/15/2027	845.085
TRIVIUM PACKAGING FINANCE 144A VAR RT 08/15/2026 DD 08/02/19	844.878
AXALTA COATING SYSTEMS LL REGS 4.250% 08/15/2024	844.354
ENDO DAC / ENDO FINANCE L 144A 6.000% 07/15/2023 DD 07/09/15	842.541
KFC HOLDING CO/PIZZA HUT 144A 5.000% 06/01/2024 DD 06/16/16	840.078
RADIATE HOLDCO LLC / RADI 144A 6.625% 02/15/2025 DD 02/01/17	832.294
IRON MOUNTAIN UK PLC REGS 3.875% 11/15/2025	831.780
PRIME SECURITY SERVICES B 144A 9.250% 05/15/2023 DD 05/02/16	831.526
PRECISION DRILLING CORP 7.750% 12/15/2023 DD 06/15/17	826.437
CITIGROUP INC VAR RT 12/31/2049 DD 10/29/12	825.345
CIT GROUP INC 5.000% 08/01/2023 DD 08/01/13	815.924
EAGLECLAW 6/17 TLB	814.164
LIBERTY INTERACTIVE LLC 8.500% 07/15/2029 DD 07/07/99	812.428
CSC HOLDINGS LLC 144A 6.625% 10/15/2025 DD 10/09/15	810.251
1011778 BC ULC / NEW RED 144A 5.000% 10/15/2025 DD 08/28/17	809.443
LENNAR CORP 4.750% 04/01/2021 DD 03/04/16	808.891
CENTENE CORP 6.125% 02/15/2024 DD 02/11/16	808.742
ADT SECURITY CORP/THE 4.125% 06/15/2023 DD 01/14/13	808.463
CPG MERGER SUB LLC 144A 8.000% 10/01/2021 DD 09/30/13	808.252
APX GROUP INC 7.625% 09/01/2023 DD 08/10/17	808.107
ELIS SA REGS 1.625% 04/03/2028	807.601
NETFLIX INC 5.500% 02/15/2022 DD 02/05/15	806.442

Naam	Waarde in euro's
CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 5.000% 09/15/2026 DD 03/15/17	804.844
STARWOOD PROPERTY TRUST INC 4.750% 03/15/2025 DD 03/15/18	803.586
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC 5.750% 06/15/2025 DD 06/05/15	803.452
BOMBARDIER INC 144A 7.875% 04/15/2027 DD 03/07/19	801.921
CENTENE CORP 144A 4.250% 12/15/2027 DD 12/06/19	801.921
HERTZ CORP/THE 144A 6.000% 01/15/2028 DD 11/25/19	801.782
MPT OPERATING PARTNERSHIP LP / 5.250% 08/01/2026 DD 07/22/16	799.977
DELPHI TECHNOLOGIES PLC 144A 5.000% 10/01/2025 DD 09/28/17	796.860
IRON MOUNTAIN US HOLDINGS 144A 5.375% 06/01/2026 DD 05/27/16	795.969
LINCOLN FINANCING SARL REGS 3.625% 04/01/2024	795.816
FAGE INTERNATIONAL SA / F 144A 5.625% 08/15/2026 DD 08/03/16	794.192
GETLINK SE REGS 3.625% 10/01/2023	792.914
ARD FINANCE SA 144A 6.500% 06/30/2027 DD 11/20/19	792.158
JAMES HARDIE INTERNATIONA 144A 4.750% 01/15/2025 DD 12/13/17	792.105
ZIGGO BV REGS 2.875% 01/15/2030	791.319
ALBERTSONS COS INC / SAFE 144A 4.625% 01/15/2027 DD 11/22/19	789.252
CDW LLC / CDW FINANCE CORP 5.000% 09/01/2025 DD 03/02/17	786.659
SCOTTS MIRACLE-GRO CO/THE 5.250% 12/15/2026 DD 12/15/16	786.479
CENTURYLINK INC 6.750% 12/01/2023 DD 11/27/13	785.601
TELECOM ITALIA SPA/MILANO 144A 5.303% 05/30/2024 DD 05/30/14	785.301
CIRSA FINANCE INTERNATION REGS 4.750% 05/22/2025	784.180
POLARIS INTERMEDIATE CORP 144A 8.500% 12/01/2022 DD 11/21/17	783.992
LIONS GATE CAPITAL HOLDIN 144A 5.875% 11/01/2024 DD 11/01/17	783.408
TARGA RESOURCES PARTNERS LP / 4.250% 11/15/2023 DD 05/14/13	782.806
UNITED RENTALS NORTH AMERICA I 5.500% 05/15/2027 DD 11/07/16	782.576
ALTICE LUXEMBOURG SA 144A 7.625% 02/15/2025 DD 02/04/15	781.954
1011778 BC ULC / NEW RED 144A 5.000% 10/15/2025 DD 08/28/17	781.849
NCR CORP 144A 5.750% 09/01/2027 DD 08/21/19	781.791
TAYLOR MORRISON COMMUNITI 144A 5.875% 04/15/2023 DD 04/16/15	781.367
STATION CASINOS LLC 144A 5.000% 10/01/2025 DD 09/21/17	779.555
SOLVAY SA REGS VAR RT 12/31/2049	777.280
HUB INTERNATIONAL LTD 144A 7.000% 05/01/2026 DD 04/25/18	777.227
ARAMARK SERVICES INC 5.125% 01/15/2024 DD 12/17/15	777.078
EVERI PAYMENTS INC 144A 7.500% 12/15/2025 DD 12/05/17	776.882
TRANSOCEAN INC 144A 9.000% 07/15/2023 DD 07/21/16	776.308
EG GLOBAL FINANCE PLC REGS 4.375% 02/07/2025	775.117
AVANTOR INC 144A 6.000% 10/01/2024 DD 10/02/17	775.095
ORTHO-CLINICAL DIAGNOSTIC 144A 6.625% 05/15/2022 DD 05/16/14	774.638
SCIENTIFIC GAMES INTERNAT 144A 7.250% 11/15/2029 DD 11/26/19	773.274

Naam	Waarde in euro's
NEWELL BRANDS INC VAR RT 04/01/2036 DD 03/30/16	771.621
DISTRIBUIDORA INTERNACION REGS 1.000% 04/28/2021	771.469
TRIVIUM PACKAGING FINANCE REGS STEP 08/15/2026	770.149
ARAMARK SERVICES INC 5.125% 01/15/2024 DD 12/17/15	767.936
EXTERRAN ENERGY SOLUTIONS LP / 8.125% 05/01/2025 DD 11/01/17	767.817
LENNAR CORP 6.250% 12/15/2021 DD 12/15/17	767.038
NEWELL BRANDS INC VAR RT 04/01/2026 DD 03/30/16	766.390
DIAMOND SPORTS GROUP LLC 144A 5.375% 08/15/2026 DD 08/02/19	765.986
STARS GROUP HOLDINGS BV / 144A 7.000% 07/15/2026 DD 07/10/18	765.706
NEXTERA ENERGY OPERATING 144A 4.250% 07/15/2024 DD 06/27/19	765.284
DIAMOND SPORTS GROUP LLC 144A 6.625% 08/15/2027 DD 08/02/19	765.004
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.875% 04/01/2024 DD 02/19/16	764.376
TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.000% 09/30/2034 DD 09/30/05	764.365
SCIENTIFIC GAMES INTERNAT 144A 7.000% 05/15/2028 DD 11/26/19	764.365
BERRY GLOBAL INC 6.000% 10/15/2022 DD 04/15/16	764.176
CASINO GUICHARD PERRACHON REGS STEP 08/05/2026	763.329
JAGUAR LAND ROVER AUTOMOT REGS 6.875% 11/15/2026	762.585
SS&C TECHNOLOGIES INC 144A 5.500% 09/30/2027 DD 03/28/19	760.802
GROUPE ECORE HOLDING SAS REGS VAR RT 11/15/2023	759.908
CONSTELLIUM SE REGS 4.250% 02/15/2026	759.693
CONNECT FINCO SARL / CONN 144A 6.750% 10/01/2026 DD 10/07/19	759.020
TRANSDIGM UK HOLDINGS PLC 6.875% 05/15/2026 DD 11/15/18	759.020
CSC HOLDINGS LLC 144A 5.375% 07/15/2023 DD 07/15/18	758.820
MATTEL INC 144A 6.750% 12/31/2025 DD 12/20/17	756.429
CLEARWAY ENERGY OPERATING 144A 4.750% 03/15/2028 DD 12/11/19	755.910
LIVE NATION ENTERTAINMENT 144A 4.750% 10/15/2027 DD 10/17/19	755.158
ZAYO GROUP LLC / ZAYO CAPITAL 6.000% 04/01/2023 DD 10/01/15	755.147
CAMELOT FINANCE SA 144A 4.500% 11/01/2026 DD 10/31/19	754.263
BISON MIDSTREAM 5/18 TLB	754.257
SPECTRUM BRANDS INC 144A 5.000% 10/01/2029 DD 09/24/19	754.254
TELEFLEX INC 4.625% 11/15/2027 DD 11/20/17	753.433
OUTFRONT MEDIA CAPITAL LLC / O 5.625% 02/15/2024 DD 11/15/14	753.341
CATALENT PHARMA SOLUTIONS 144A 4.875% 01/15/2026 DD 10/18/17	750.548
COMMSCOPE INC 144A 5.500% 03/01/2024 DD 02/19/19	749.486
VIRGIN MEDIA FINANCE PLC 144A 6.000% 10/15/2024 DD 10/07/14	747.840
CINEMARK USA INC 5.125% 12/15/2022 DD 12/18/12	747.555
CAESARS RESORT COLLECTION 144A 5.250% 10/15/2025 DD 10/16/17	746.860
ARENA LUXEMBOURG FINANCE REGS 2.875% 11/01/2024	746.533
TWITTER INC 144A 3.875% 12/15/2027 DD 12/09/19	745.269

Naam	Waarde in euro's
PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC 5.750% 10/01/2022 DD 04/01/13	745.072
DELL INTERNATIONAL LLC / 144A 5.875% 06/15/2021 DD 06/22/16	743.740
FOXTROT ESCROW ISSUER LLC 144A 12.250% 11/15/2026 DD 11/07/19	742.094
CODERE FINANCE 2 LUXEMBOU REGS 6.750% 11/01/2021	741.300
CINEMARK USA INC 4.875% 06/01/2023 DD 05/24/13	739.667
GFL ENVIRONMENTAL INC 144A 5.375% 03/01/2023 DD 02/26/18	739.581
STAPLES INC 144A 7.500% 04/15/2026 DD 04/16/19	739.421
BLUE CUBE SPINCO LLC 10.000% 10/15/2025 DD 04/15/16	738.822
COLFAX CORP 144A 6.375% 02/15/2026 DD 02/05/19	737.996
GRIFFON CORP 5.250% 03/01/2022 DD 02/27/14	737.723
ORANGE SA REGS VAR RT 12/31/2049	737.645
EG GLOBAL FINANCE PLC REGS 3.625% 02/07/2024	737.297
TENNECO INC 5.375% 12/15/2024 DD 12/05/14	732.428
UNITED RENTALS NORTH AMERICA I 4.625% 10/15/2025 DD 09/22/17	729.974
WILLIAM CARTER CO/THE 144A 5.625% 03/15/2027 DD 03/14/19	727.840
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 5.250% 01/30/2030 DD 12/30/19	726.131
TESCO PLC REGS 5.125% 04/10/2047	724.043
NETFLIX INC 6.375% 05/15/2029 DD 10/26/18	724.010
ANGLO AMERICAN CAPITAL PL 144A 4.125% 09/27/2022 DD 09/27/12	718.198
XPO LOGISTICS INC 144A 6.500% 06/15/2022 DD 06/09/15	718.066
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 5.000% 01/30/2028 DD 12/30/19	717.787
DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.375% 07/15/2025 DD 07/17/18	716.927
CEMEX SAB DE CV REGS 2.750% 12/05/2024	715.904
TARGA RESOURCES PARTNERS LP / 6.750% 03/15/2024 DD 09/14/15	715.451
FRONTIER COMMUNICATIONS C 144A 8.500% 04/01/2026 DD 03/19/18	714.388
MATCH GROUP INC 6.375% 06/01/2024 DD 06/01/16	711.935
ZIGGO BOND CO BV 144A 5.875% 01/15/2025 DD 01/29/15	711.571
ARCHROCK PARTNERS LP / AR 144A 6.250% 04/01/2028 DD 12/20/19	711.136
CHS/COMMUNITY HEALTH SYST 144A 8.000% 03/15/2026 DD 03/06/19	711.136
POST HOLDINGS INC 144A 5.625% 01/15/2028 DD 12/01/17	706.494
EW SCRIPPS CO/THE 144A 5.125% 05/15/2025 DD 04/28/17	705.958
CLEVELAND-CLIFFS INC 144A 5.875% 06/01/2027 DD 05/13/19	705.568
WESCO DISTRIBUTION INC 5.375% 12/15/2021 DD 06/15/14	705.546
NEXSTAR BROADCASTING INC 144A 5.625% 07/15/2027 DD 07/03/19	704.098
CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 5.750% 10/15/2025 DD 04/15/19	703.229
IHO VERWALTUNGS GMBH REGS 3.625% 05/15/2025	701.237
VICI PROPERTIES LP / VICI 144A 4.625% 12/01/2029 DD 11/26/19	699.334
INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA 5.500% 08/01/2023 DD 06/05/13	697.946
FLEX ACQUISITION CO INC 144A 7.875% 07/15/2026 DD 06/29/18	695.601

Naam	Waarde in euro's
CONSTELLIUM SE 144A 6.625% 03/01/2025 DD 02/16/17	693.274
JBS USA LUX SA / JBS USA 144A 6.500% 04/15/2029 DD 04/15/19	693.003
CITGO HOLDING INC 144A 9.250% 08/01/2024 DD 08/01/19	692.706
EVERI PAYMENTS INC 144A 7.500% 12/15/2025 DD 12/05/17	691.091
DELEK LOGISTICS PARTNERS LP / 6.750% 05/15/2025 DD 05/15/18	685.198
CHESAPEAKE ENERGY CORP 7.500% 10/01/2026 DD 09/27/18	684.499
RANGE RESOURCES CORP 5.000% 03/15/2023 DD 09/15/17	684.231
DISH DBS CORP 7.750% 07/01/2026 DD 06/13/16	683.295
HEATHROW FINANCE PLC REGS 4.125% 09/01/2029	682.402
BALL CORP 4.375% 12/15/2020 DD 12/14/15	682.176
JAGUAR LAND ROVER AUTOMOT REGS 5.875% 11/15/2024	681.615
SCOTTS MIRACLE-GRO CO/THE 144A 4.500% 10/15/2029 DD 10/22/19	680.252
VIRGIN MEDIA SECURED FINA REGS 4.250% 01/15/2030	679.540
AMWINS GROUP INC 144A 7.750% 07/01/2026 DD 07/06/18	679.323
HERTZ CORP/THE 144A 5.500% 10/15/2024 DD 09/22/16	677.550
WEPA HYGIENEPRODUKTE GMBH REGS 2.875% 12/15/2027	677.254
GRANITE US HOLDINGS CORP 144A 11.000% 10/01/2027 DD 09/30/19	676.503
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.500% 05/01/2026 DD 04/21/16	675.902
PARK-OHIO INDUSTRIES INC 6.625% 04/15/2027 DD 04/17/17	675.680
COGENT COMMUNICATIONS GRO 144A 5.375% 03/01/2022 DD 02/20/15	674.944
ASURION 7/18 B7 COV-LITE TLB	674.383
MIDCONTINENT COMMUNICATIO 144A 5.375% 08/15/2027 DD 08/07/19	673.597
JACK OHIO FINANCE LLC / J 144A 10.250% 11/15/2022 DD 11/08/16	672.323
KB HOME 7.000% 12/15/2021 DD 10/29/13	668.820
TEMPO ACQUISITION LLC / T 144A 6.750% 06/01/2025 DD 05/01/17	665.031
NCR CORP 144A 5.750% 09/01/2027 DD 08/21/19	664.143
BERRY GLOBAL INC 5.500% 05/15/2022 DD 05/12/14	663.957
WYNN LAS VEGAS LLC / WYNN 144A 5.250% 05/15/2027 DD 05/11/17	663.530
AIR CANADA 144A 7.750% 04/15/2021 DD 04/15/14	663.269
GARTNER INC 144A 5.125% 04/01/2025 DD 03/30/17	663.246
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 5.000% 01/30/2028 DD 12/30/19	662.925
PRISO ACQUISITION CORP 144A 9.000% 05/15/2023 DD 05/08/15	661.470
SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.875% 03/15/2025 DD 03/12/18	658.686
DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.600% 04/01/2044 DD 03/13/14	657.641
UNITED GROUP BV REGS 4.875% 07/01/2024	657.451
CHESAPEAKE ENERGY CORP 8.000% 06/15/2027 DD 12/15/17	657.283
ALBERTSONS COS INC / SAFE 144A 7.500% 03/15/2026 DD 02/05/19	657.000
PRESTIGE BRANDS INC 144A 5.125% 01/15/2028 DD 12/02/19	653.229
TENET HEALTHCARE CORP 144A 4.875% 01/01/2026 DD 08/26/19	653.167

Naam	Waarde in euro's
B&G FOODS INC 5.250% 09/15/2027 DD 09/26/19	646.940
TELECOM ITALIA SPA/MILANO REGS 3.250% 01/16/2023	643.668
HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 6.625% 08/01/2026 DD 02/01/17	642.762
NABORS INDUSTRIES INC 5.750% 02/01/2025 DD 08/01/18	641.425
SM ENERGY CO 6.625% 01/15/2027 DD 08/20/18	640.935
GFL ENVIRONMENTAL INC 144A 5.125% 12/15/2026 DD 12/16/19	638.789
MGM GROWTH PROPERTIES OPE 144A 5.750% 02/01/2027 DD 01/25/19	638.704
EDP - ENERGIAS DE PORTUGA REGS VAR RT 09/16/2075	636.442
VIKING CRUISES LTD 144A 6.250% 05/15/2025 DD 05/08/15	635.418
DELL INTERNATIONAL LLC / 144A 7.125% 06/15/2024 DD 06/22/16	634.410
BAUSCH HEALTH AMERICAS IN 144A 8.500% 01/31/2027 DD 06/01/18	634.076
HILTON DOMESTIC OPERATING CO I 5.125% 05/01/2026 DD 05/01/19	632.906
DAE FUNDING LLC 144A 5.000% 08/01/2024 DD 08/04/17	631.367
IHEARTCOMMUNICATIONS INC 6.375% 05/01/2026 DD 05/01/19	631.105
LAMAR MEDIA CORP 5.000% 05/01/2023 DD 10/30/12	629.989
TARGA RESOURCES PARTNERS LP / 4.250% 11/15/2023 DD 05/14/13	629.844
HESS MIDSTREAM OPERATIONS 144A 5.625% 02/15/2026 DD 08/15/19	628.300
SCIENTIFIC GAMES INTERNAT 144A 7.250% 11/15/2029 DD 11/26/19	628.285
BALL CORP 3.500% 12/15/2020	628.046
TAYLOR MORRISON COMMUNITI 144A 5.625% 03/01/2024 DD 03/05/14	622.982
ENDO DAC / ENDO FINANCE L 144A 6.000% 07/15/2023 DD 07/09/15	622.412
BALL CORP 5.000% 03/15/2022 DD 03/09/12	621.782
POST HOLDINGS INC 144A 5.750% 03/01/2027 DD 02/14/17	621.047
HUDBAY MINERALS INC 144A 7.625% 01/15/2025 DD 12/12/16	620.606
CALIFORNIA RESOURCES CORP 144A 8.000% 12/15/2022 DD 12/15/15	620.196
ORYX SOUTHERN/ORYX MIDSTREAM 0.000% 12/31/2022 DD 04/02/19	619.826
TRONOX INC 144A 6.500% 04/15/2026 DD 04/06/18	619.497
CSC HOLDINGS LLC 144A 10.875% 10/15/2025 DD 10/09/15	619.229
SIRIUS XM RADIO INC 144A 4.625% 07/15/2024 DD 07/02/19	618.307
REYNOLDS GROUP ISSUER INC / RE 5.750% 10/15/2020 DD 09/28/12	617.201
NUSTAR LOGISTICS LP 6.000% 06/01/2026 DD 05/22/19	616.129
GATEWAY CASINOS & ENTERTA 144A 8.250% 03/01/2024 DD 02/22/17	614.866
LA FINANCIERE ATALIAN SAS REGS 5.125% 05/15/2025	613.662
ENTERPRISE DEVELOPMENT AU 144A 12.000% 07/15/2024 DD 07/26/18	612.027
TESCO CORPORATE TREASURY REGS 2.500% 05/02/2025	609.330
TRI POINTE GROUP INC 4.875% 07/01/2021 DD 05/26/16	606.325
XPO LOGISTICS INC 144A 6.500% 06/15/2022 DD 06/09/15	605.499
NCR CORP 144A 6.125% 09/01/2029 DD 08/21/19	604.187
ANTERO MIDSTREAM PARTNERS 144A 5.750% 03/01/2027 DD 02/25/19	602.440

Naam	Waarde in euro's
XPO LOGISTICS INC 144A 6.125% 09/01/2023 DD 08/25/16	602.367
NOVELIS CORP 144A 6.250% 08/15/2024 DD 08/29/16	597.951
CSC HOLDINGS LLC 144A 6.500% 02/01/2029 DD 01/31/19	595.991
PLANTRONICS INC 144A 5.500% 05/31/2023 DD 05/27/15	593.902
HUNT COS INC 144A 6.250% 02/15/2026 DD 02/02/18	593.820
HCA INC 5.875% 05/01/2023 DD 10/23/12	590.731
BRUIN E&P PARTNERS LLC 144A 8.875% 08/01/2023 DD 07/26/18	590.646
SWISSPORT FINANCING SARL REGS 9.000% 02/15/2025	589.013
XPO LOGISTICS INC 144A 6.750% 08/15/2024 DD 02/22/19	588.419
MERLIN ENTERTAINMENTS LTD 144A 5.750% 06/15/2026 DD 05/09/18	585.301
OTE PLC REGS 3.500% 07/09/2020	585.250
TRANSDIGM INC 7.500% 03/15/2027 DD 09/15/19	584.659
HCA INC 5.625% 09/01/2028 DD 08/23/18	583.759
INTRALOT CAPITAL LUXEMBOU REGS 5.250% 09/15/2024	582.683
DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC 7.875% 08/15/2025 DD 08/15/17	581.292
NAVIENT CORP 7.250% 01/25/2022 DD 01/27/12	580.725
LAMAR MEDIA CORP 5.750% 02/01/2026 DD 08/01/16	580.702
DIAMOND SPORTS GROUP LLC 144A 6.625% 08/15/2027 DD 08/02/19	580.468
COMMSCOPE TECHNOLOGIES LL 144A 6.000% 06/15/2025 DD 06/11/15	579.719
AMERICAN TIRE DISTRIBUTORS 3/15 COV-LITE TL	578.122
HORIZON THERAPEUTICS USA 144A 5.500% 08/01/2027 DD 07/16/19	577.336
MERITAGE HOMES CORP 6.000% 06/01/2025 DD 06/02/15	572.439
CEDAR FAIR LP / CANADA'S WONDE 5.375% 06/01/2024 DD 12/01/14	572.105
SUBURBAN PROPANE PARTNERS LP/S 5.500% 06/01/2024 DD 05/27/14	572.105
ALLIED UNIVERSAL HOLDCO L 144A 9.750% 07/15/2027 DD 07/12/19	571.013
ATOTECH ALPHA 3 BV / ALPH 144A 6.250% 02/01/2025 DD 01/31/17	570.713
BERRY GLOBAL INC REGS 1.500% 01/15/2027	568.000
TARGA RESOURCES PARTNERS LP / 5.000% 01/15/2028 DD 10/17/17	567.929
AMC NETWORKS INC 5.000% 04/01/2024 DD 03/30/16	567.929
CENTENE CORP 144A 5.375% 06/01/2026 DD 05/23/18	567.261
TRONOX FINANCE PLC 144A 5.750% 10/01/2025 DD 09/22/17	567.216
SUMMIT MIDSTREAM HOLDINGS LLC 5.500% 08/15/2022 DD 07/15/14	566.904
CENTURYLINK INC 144A 5.125% 12/15/2026 DD 12/16/19	566.609
WPX ENERGY INC 5.250% 09/15/2024 DD 09/08/14	565.089
CALPINE CORP 144A 4.500% 02/15/2028 DD 12/20/19	561.732
ENERGIZER HOLDINGS INC 144A 5.500% 06/15/2025 DD 06/01/15	559.187
CDW LLC / CDW FINANCE CORP 5.000% 09/01/2025 DD 03/02/17	558.575
CEMEX SAB DE CV 144A 5.450% 11/19/2029 DD 11/19/19	558.575
1011778 BC ULC / NEW RED 144A 3.875% 01/15/2028 DD 09/24/19	557.292

Naam	Waarde in euro's
SONIC AUTOMOTIVE INC 6.125% 03/15/2027 DD 03/10/17	557.238
SUMMIT MIDSTREAM HOLDINGS LLC 5.500% 08/15/2022 DD 07/15/14	555.011
ALTICE FINCO SA 144A 7.625% 02/15/2025 DD 02/04/15	553.229
TRI POINTE GROUP INC / TRI POI 5.875% 06/15/2024 DD 06/15/15	553.196
HERTZ CORP/THE 144A 7.625% 06/01/2022 DD 06/06/17	553.122
SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.625% 01/15/2028 DD 05/09/19	553.087
SPECTRUM BRANDS INC 6.125% 12/15/2024 DD 12/15/15	551.893
TRANSDIGM INC 6.500% 07/15/2024 DD 06/04/14	551.278
VIRGIN MEDIA FINANCE PLC 144A 6.000% 10/15/2024 DD 10/07/14	550.557
ASCENT RESOURCES UTICA HO 144A 10.000% 04/01/2022 DD 04/05/17	550.259
HEATHROW FINANCE PLC REGS 3.875% 03/01/2027	548.021
ENSIGN DRILLING INC 144A 9.250% 04/15/2024 DD 04/10/19	546.492
PRECISION DRILLING CORP 144A 7.125% 01/15/2026 DD 11/22/17	545.880
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.125% 05/01/2023 DD 04/21/15	545.548
FIDELITY & GUARANTY LIFE 144A 5.500% 05/01/2025 DD 04/20/18	545.546
PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC 5.750% 10/01/2022 DD 04/01/13	541.871
FIRST QUANTUM MINERALS LT 144A 6.875% 03/01/2026 DD 02/27/18	541.203
CUMULUS MEDIA NEW HOLDING 144A 6.750% 07/01/2026 DD 06/26/19	539.204
PRIME SECURITY SERVICES B 144A 5.250% 04/15/2024 DD 04/04/19	538.190
TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.000% 09/30/2034 DD 09/30/05	537.922
CHEMOURS CO/THE 6.625% 05/15/2023 DD 05/15/16	537.463
BUILDERS FIRSTSOURCE INC 144A 6.750% 06/01/2027 DD 05/30/19	537.138
NEXTERA ENERGY OPERATING 144A 3.875% 10/15/2026 DD 09/23/19	536.526
ORANO SA REGS 3.375% 04/23/2026	536.260
MOHEGAN TRIBAL 9/16 TLB	534.452
ENERGIZER HOLDINGS INC 144A 6.375% 07/15/2026 DD 07/06/18	531.314
MGM GROWTH PROPERTIES OPERATIN 4.500% 01/15/2028 DD 01/15/18	531.234
ARDONAGH MIDCO 3 PLC 144A 8.625% 07/15/2023 DD 06/20/17	530.512
SHELF DRILLING HOLDINGS L 144A 8.250% 02/15/2025 DD 02/07/18	530.345
OUTFRONT MEDIA CAPITAL LLC / O 5.625% 02/15/2024 DD 11/15/14	529.621
PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC 5.750% 10/01/2022 DD 04/01/13	528.324
INEOS GROUP HOLDINGS SA REGS 5.375% 08/01/2024	527.999
POST HOLDINGS INC 144A 5.625% 01/15/2028 DD 12/01/17	527.951
PERFORMANCE FOOD GROUP IN 144A 5.500% 10/15/2027 DD 09/27/19	525.568
TRIVIUM PACKAGING FINANCE 144A VAR RT 08/15/2027 DD 08/02/19	525.278
VODAFONE GROUP PLC VAR RT 04/04/2079 DD 04/04/19	523.324
NAVISTAR INTERNATIONAL CO 144A 6.625% 11/01/2025 DD 11/06/17	521.854
SPRINT CAPITAL CORP 8.750% 03/15/2032 DD 03/14/02	519.020
ARCHROCK PARTNERS LP / AR 144A 6.875% 04/01/2027 DD 03/21/19	518.151

Naam	Waarde in euro's
DOUGLAS GMBH REGS 6.250% 07/15/2022	517.568
EPIC HEALTH 6/18 INCREMENTAL TLB	517.393
LTF MERGER SUB INC 144A 8.500% 06/15/2023 DD 06/10/15	515.225
FRONTDOOR INC 144A 6.750% 08/15/2026 DD 08/16/18	514.655
MOTION BONDCO DAC REGS 4.500% 11/15/2027	514.497
ICAHN ENTERPRISES LP / ICAHN E 6.375% 12/15/2025 DD 12/06/17	513.864
ZIGGO BOND CO BV REGS 4.625% 01/15/2025	512.249
ZIGGO BV 144A 4.875% 01/15/2030 DD 10/28/19	509.675
FORESTAR GROUP INC 144A 8.000% 04/15/2024 DD 04/12/19	508.630
SCIENTIFIC GAMES INTERNAT 144A 7.250% 11/15/2029 DD 11/26/19	508.428
HILCORP ENERGY I LP / HIL 144A 6.250% 11/01/2028 DD 10/16/18	507.795
LIVE NATION ENTERTAINMENT 144A 4.750% 10/15/2027 DD 10/17/19	507.127
DAVITA INC 5.125% 07/15/2024 DD 06/13/14	506.793
PICARD BONDCO SA REGS 5.500% 11/30/2024	506.288
FIRST QUANTUM MINERALS LT 144A 6.875% 03/01/2026 DD 02/27/18	505.122
GREIF INC 144A 6.500% 03/01/2027 DD 02/11/19	505.122
MAUSER PACKAGING SOLUTION 144A 5.500% 04/15/2024 DD 04/03/17	504.726
SCIENTIFIC GAMES INTERNAT 144A 7.000% 05/15/2028 DD 11/26/19	503.526
NOVA CHEMICALS CORP 144A 5.250% 06/01/2027 DD 06/09/17	503.452
PERFORMANCE FOOD GROUP IN 144A 5.500% 06/01/2024 DD 05/17/16	502.227
HCA INC 5.875% 05/01/2023 DD 10/23/12	502.122
ICAHN ENTERPRISES LP / IC 144A 5.250% 05/15/2027 DD 12/12/19	501.066
GOLDEN NUGGET INC 144A 8.750% 10/01/2025 DD 09/26/17	500.153
BOATS INVESTMENTS NETHERL REGS 11.000% 03/31/2017	497.775
PANTHER BF AGGREGATOR 2 L 144A 6.250% 05/15/2026 DD 04/01/19	497.234
ENVISION HEALTHCARE CORP 144A 8.750% 10/15/2026 DD 10/11/18	497.105
HUDBAY MINERALS INC 144A 7.250% 01/15/2023 DD 12/12/16	496.961
GO DADDY OPERATING CO LLC 144A 5.250% 12/01/2027 DD 06/04/19	496.949
TENET HEALTHCARE CORP 8.125% 04/01/2022 DD 09/27/13	495.718
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 7.000% 03/15/2024 DD 03/21/17	495.679
JELD-WEN INC 144A 4.625% 12/15/2025 DD 12/14/17	495.261
ACADIA HEALTHCARE CO INC 5.125% 07/01/2022 DD 07/01/14	493.653
SUMMIT MATERIALS LLC / SUMMIT 6.125% 07/15/2023 DD 07/08/15	493.413
BOMBARDIER INC 144A 7.500% 03/15/2025 DD 03/13/15	493.342
ELDORADO RESORTS INC 7.000% 08/01/2023 DD 02/01/16	492.900
TENET HEALTHCARE CORP 8.125% 04/01/2022 DD 09/27/13	492.762
ALCOA NEDERLAND HOLDING B 144A 6.750% 09/30/2024 DD 09/27/16	492.069
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 7.000% 03/15/2024 DD 03/21/17	491.047
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 7.000% 01/15/2028 DD 05/23/19	490.687

Naam	Waarde in euro's
BOMBARDIER INC 144A 7.875% 04/15/2027 DD 03/07/19	490.317
BOMBARDIER INC 144A 6.000% 10/15/2022 DD 04/03/14	489.831
MINERAL RESOURCES LTD 144A 8.125% 05/01/2027 DD 04/23/19	488.864
TELE COLUMBUS AG REGS 3.875% 05/02/2025	488.601
FLEX ACQUISITION CO INC 144A 6.875% 01/15/2025 DD 01/17/17	488.267
HCA HEALTHCARE INC 6.250% 02/15/2021 DD 12/06/12	487.584
IHEARTCOMMUNICATIONS INC 6.375% 05/01/2026 DD 05/01/19	483.296
ARUBA INVESTMENTS INC 144A 8.750% 02/15/2023 DD 02/02/15	482.209
YUM! BRANDS INC 3.875% 11/01/2023 DD 10/31/13	481.737
LAMAR MEDIA CORP 5.000% 05/01/2023 DD 10/30/12	481.330
CONSTELLUM SE 144A 5.750% 05/15/2024 DD 05/07/14	480.568
INEOS GROUP HOLDINGS SA 144A 5.625% 08/01/2024 DD 08/09/16	480.334
ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.850% 07/15/2026 DD 07/14/16	480.234
ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY I 5.750% 03/15/2025 DD 03/15/17	479.465
DAVITA INC 5.125% 07/15/2024 DD 06/13/14	479.399
BRAND INDUSTRIAL SERVICES 144A 8.500% 07/15/2025 DD 06/21/17	479.399
WELLCARE HEALTH PLANS INC 144A 5.375% 08/15/2026 DD 08/13/18	479.131
SUNOCO LP / SUNOCO FINANCE COR 4.875% 01/15/2023 DD 07/15/18	478.239
BOYD GAMING CORP 6.000% 08/15/2026 DD 06/25/18	477.728
CENTURY COMMUNITIES INC 144A VAR RT 06/01/2027 DD 05/23/19	477.595
CROWNROCK LP / CROWNROCK 144A 5.625% 10/15/2025 DD 10/11/17	477.060
GRAY TELEVISION INC 144A 7.000% 05/15/2027 DD 11/16/18	470.239
BUILDERS FIRSTSOURCE INC 144A 5.625% 09/01/2024 DD 08/22/16	468.811
ELDORADO RESORTS INC 6.000% 04/01/2025 DD 03/29/17	468.641
IRON MOUNTAIN INC 6.000% 08/15/2023 DD 08/13/13	468.547
VIASAT INC 144A 5.625% 04/15/2027 DD 03/27/19	468.036
L BRANDS INC 6.875% 11/01/2035 DD 10/30/15	468.031
IHEARTCOMMUNICATIONS INC 144A 5.250% 08/15/2027 DD 08/07/19	466.058
TRANSOCEAN INC 7.500% 04/15/2031 DD 04/05/01	466.036
UBER TECHNOLOGIES INC 144A 7.500% 11/01/2023 DD 11/07/18	465.479
SM ENERGY CO 5.625% 06/01/2025 DD 05/21/15	465.072
UBER TECHNOLOGIES INC 144A 8.000% 11/01/2026 DD 11/07/18	464.365
CALLON PETROLEUM CO 6.125% 10/01/2024 DD 04/01/17	463.856
SCRIPPS ESCROW INC 144A 5.875% 07/15/2027 DD 07/26/19	463.793
SPCM SA 144A 4.875% 09/15/2025 DD 04/20/17	463.252
VERSCEND ESCROW CORP 144A 9.750% 08/15/2026 DD 08/27/18	462.834
DAE FUNDING LLC 144A 5.250% 11/15/2021 DD 11/14/18	462.138
TASEKO MINES LTD 144A 8.750% 06/15/2022 DD 06/14/17	462.138
ENLINK MIDSTREAM LLC 5.375% 06/01/2029 DD 04/09/19	460.579

Naam	Waarde in euro's
ENCOMPASS HEALTH CORP 4.750% 02/01/2030 DD 09/18/19	459.365
AHERN RENTALS INC 144A 7.375% 05/15/2023 DD 05/14/15	458.909
ENCOMPASS HEALTH CORP 4.500% 02/01/2028 DD 09/18/19	458.812
PILGRIM'S PRIDE CORP 144A 5.875% 09/30/2027 DD 09/29/17	457.545
INTELSAT LUXEMBOURG SA 8.125% 06/01/2023 DD 04/05/13	457.198
TELECOM ITALIA SPA/MILANO 5.250% 03/17/2055	457.046
MOSS CREEK RESOURCES HOLD 144A 7.500% 01/15/2026 DD 01/18/18	457.016
GENWORTH HOLDINGS INC 7.700% 06/15/2020 DD 06/24/10	455.561
TEVA PHARMACEUTICAL FINAN REGS 1.875% 03/31/2027	453.823
CHESAPEAKE ENERGY CORP 144A 8.000% 03/15/2026 DD 04/03/19	452.953
SUNOCO LP / SUNOCO FINANCE COR 4.875% 01/15/2023 DD 07/15/18	452.733
EAGLE HOLDING CO II LLC 144A 7.625% 05/15/2022 DD 05/11/17	452.445
DAE FUNDING LLC 144A 4.500% 08/01/2022 DD 08/04/17	452.116
ACRISURE LLC / ACRISURE F 144A 7.000% 11/15/2025 DD 11/17/17	451.336
PATRICK INDUSTRIES INC 144A 7.500% 10/15/2027 DD 09/17/19	450.668
NOVELIS CORP 144A 5.875% 09/30/2026 DD 09/14/16	450.289
JACOBS ENTERTAINMENT INC 144A 7.875% 02/01/2024 DD 02/07/17	449.610
PRIME SECURITY SERVICES B 144A 9.250% 05/15/2023 DD 05/02/16	449.398
DISH DBS CORP 5.875% 07/15/2022 DD 05/16/12	448.552
DCP MIDSTREAM OPERATING L 144A 5.350% 03/15/2020 DD 03/11/10	447.661
TALEN ENERGY SUPPLY LLC 144A 10.500% 01/15/2026 DD 11/29/17	444.905
SIRIUS XM RADIO INC 144A 4.625% 07/15/2024 DD 07/02/19	444.321
CDK GLOBAL INC VAR RT 10/15/2024 DD 04/15/15	443.608
H&E EQUIPMENT SERVICES INC 5.625% 09/01/2025 DD 03/01/18	443.263
OUTFRONT MEDIA CAPITAL LL 144A 5.000% 08/15/2027 DD 06/14/19	443.263
IHEARTCOMMUNICATIONS INC 144A 5.250% 08/15/2027 DD 08/07/19	441.823
ASP AMC MERGER SUB INC 144A 8.000% 05/15/2025 DD 04/21/17	441.359
LOXAM SAS REGS 5.750% 07/15/2027	441.280
HB FULLER CO 4.000% 02/15/2027 DD 02/14/17	440.980
QUATRIM SASU REGS 5.875% 01/15/2024	438.272
TRANSOCEAN POSEIDON LTD 144A 6.875% 02/01/2027 DD 02/01/19	438.165
OWENS-BROCKWAY GLASS CONT 144A 6.375% 08/15/2025 DD 08/24/15	437.973
CSC HOLDINGS LLC 144A 5.375% 02/01/2028 DD 01/29/18	435.999
POLARIS INTERMEDIATE CORP 144A 8.500% 12/01/2022 DD 11/21/17	435.551
WILLIAM HILL PLC REGS 4.750% 05/01/2026	435.174
TAKKO LUXEMBOURG 2 SCA REGS 5.375% 11/15/2023	434.976
BRUIN E&P PARTNERS LLC 144A 8.875% 08/01/2023 DD 07/26/18	434.298
SELECT MEDICAL CORP 144A 6.250% 08/15/2026 DD 08/01/19	433.972
AMERIGAS PARTNERS LP / AMERIGA 5.625% 05/20/2024 DD 06/27/16	432.962

Naam	Waarde in euro's
TEAM HEALTH HOLDINGS INC 144A 6.375% 02/01/2025 DD 02/01/17	431.125
ANTERO MIDSTREAM PARTNERS 144A 5.750% 03/01/2027 DD 02/25/19	430.874
SEDGWICK CMS 8/19 INCREMENTAL 0.000% 08/07/2026 DD 08/08/19	430.016
BOPARAN FINANCE PLC REGS 5.500% 07/15/2021	429.782
NETFLIX INC 144A 4.875% 06/15/2030 DD 10/25/19	429.775
CLEARWAY ENERGY OPERATING 144A 4.750% 03/15/2028 DD 12/11/19	428.981
LADDER CAPITAL FINANCE HO 144A 5.875% 08/01/2021 DD 08/01/14	428.981
DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC 7.875% 08/15/2025 DD 08/15/17	428.606
ESH HOSPITALITY INC 144A 4.625% 10/01/2027 DD 09/18/19	428.452
HESS MIDSTREAM OPERATIONS 144A 5.125% 06/15/2028 DD 12/10/19	428.452
DCP MIDSTREAM OPERATING LP 3.875% 03/15/2023 DD 03/14/13	428.129
SUNOCO LP / SUNOCO FINANCE COR 6.000% 04/15/2027 DD 03/14/19	427.951
TPC GROUP INC 144A 10.500% 08/01/2024 DD 08/02/19	426.336
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 5.750% 08/15/2027 DD 03/08/19	425.301
SEVEN GENERATIONS ENERGY 144A 5.375% 09/30/2025 DD 10/02/17	425.278
GOLDEN ENTERTAINMENT INC 144A 7.625% 04/15/2026 DD 04/15/19	424.944
MGM RESORTS INTERNATIONAL 7.750% 03/15/2022 DD 03/22/12	423.580
TENET HEALTHCARE CORP 144A 5.125% 11/01/2027 DD 08/26/19	423.441
VALARIS PLC 4.750% 01/15/2024 DD 01/15/14	421.497
HAT HOLDINGS I LLC / HAT 144A 5.250% 07/15/2024 DD 07/02/19	421.437
CLOUD CRANE LLC 144A 10.125% 08/01/2024 DD 07/29/16	420.935
CF INDUSTRIES INC 5.150% 03/15/2034 DD 03/11/14	419.125
UNIVAR SOLUTIONS USA INC/ 144A 5.125% 12/01/2027 DD 11/22/19	418.442
CF INDUSTRIES INC 5.375% 03/15/2044 DD 03/11/14	415.608
FMG RESOURCES AUGUST 2006 144A 4.750% 05/15/2022 DD 05/12/17	413.920
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 5.875% 05/15/2023 DD 03/27/15	413.385
ASGN INC 144A 4.625% 05/15/2028 DD 11/22/19	412.068
DIAMOND SPORTS GROUP LLC 144A 6.625% 08/15/2027 DD 08/02/19	411.526
KENNEDY-WILSON INC 5.875% 04/01/2024 DD 03/25/14	410.913
CHESAPEAKE ENERGY CORP 8.000% 01/15/2025 DD 01/15/18	410.816
DISH DBS CORP 5.875% 11/15/2024 DD 11/20/14	409.660
CALLON PETROLEUM CO 6.125% 10/01/2024 DD 04/01/17	408.484
CLEAN HARBORS INC 144A 4.875% 07/15/2027 DD 07/02/19	407.873
IRON MOUNTAIN INC 144A 4.875% 09/15/2029 DD 09/09/19	407.225
ZEKELMAN INDUSTRIES INC 144A 9.875% 06/15/2023 DD 06/14/16	406.452
MPT OPERATING PARTNERSHIP LP / 2.550% 12/05/2023	405.478
KAPLA HOLDING SAS REGS 3.375% 12/15/2026	404.636
CCM MERGER INC 144A 6.000% 03/15/2022 DD 03/15/17	404.365
TRANSDIGM INC 7.500% 03/15/2027 DD 09/15/19	402.440

Naam	Waarde in euro's
ALTICE FRANCE SA/FRANCE 144A 8.125% 02/01/2027 DD 07/31/18	401.336
TRINSEO MATERIALS OPERATI 144A 5.375% 09/01/2025 DD 08/29/17	400.891
BARCLAYS BANK PLC 7.625% 11/21/2022 DD 11/21/12	400.445
J2 CLOUD SERVICES LLC / J 144A 6.000% 07/15/2025 DD 06/27/17	400.392
RANGE RESOURCES CORP 5.750% 06/01/2021 DD 06/01/17	399.889
WEST STREET MERGER SUB IN 144A 6.375% 09/01/2025 DD 08/24/17	399.889
RADIAN GROUP INC 4.875% 03/15/2027 DD 06/24/19	398.497
COMMSCOPE INC 144A 8.250% 03/01/2027 DD 02/19/19	398.497
WILLIAMS SCOTSMAN INTERNA 144A 6.875% 08/15/2023 DD 08/06/18	398.497
FRONTIER COMMUNICATIONS C 144A 8.000% 04/01/2027 DD 03/15/19	395.657
VERICAST CORP 144A 9.250% 03/01/2021 DD 02/04/14	395.379
COLFAX CORP 144A 6.375% 02/15/2026 DD 02/05/19	394.245
CENTENE CORP 144A 4.750% 01/15/2025 DD 07/15/19	393.283
CONSTANTIN INVESTISSEMENT REGS 5.375% 04/15/2025	391.894
ARCHROCK PARTNERS LP / AR 144A 6.250% 04/01/2028 DD 12/20/19	389.978
TEVA PHARMACEUTICAL FINAN REGS 1.625% 10/15/2028	389.299
CREDIT SUISSE GROUP AG 144A VAR RT 12/31/2049 DD 06/18/14	387.617
ACRISURE LLC / ACRISURE F 144A 8.125% 02/15/2024 DD 01/30/19	387.528
ALCOA NEDERLAND HOLDING B 144A 6.125% 05/15/2028 DD 05/17/18	385.746
SBA COMMUNICATIONS CORP 4.000% 10/01/2022 DD 04/01/18	385.718
TOWNSQUARE MEDIA INC 144A 6.500% 04/01/2023 DD 04/01/15	384.298
SEALED AIR CORP 144A 4.000% 12/01/2027 DD 11/26/19	383.352
ENEL SPA REGS VAR RT 01/10/2074	382.294
BUCKEYE PARTNERS LP 5.850% 11/15/2043 DD 11/14/13	381.658
FREEPORT-MCMORAN INC 3.550% 03/01/2022 DD 02/13/12	381.548
APX GROUP INC 8.750% 12/01/2020 DD 06/01/13	381.292
OI EUROPEAN GROUP BV REGS 4.875% 03/31/2021	381.096
NXP BV / NXP FUNDING LLC 144A 4.625% 06/01/2023 DD 05/23/16	380.971
RADIATE HOLDCO LLC / RADI 144A 6.875% 02/15/2023 DD 01/24/18	379.806
NFP CORP 144A 6.875% 07/15/2025 DD 07/12/17	379.566
DRAX FINCO PLC 144A 6.625% 11/01/2025 DD 04/26/18	378.619
AVIS BUDGET FINANCE PLC REGS 4.125% 11/15/2024	378.192
LCPR SENIOR SECURED FINAN 144A 6.750% 10/15/2027 DD 10/25/19	377.728
VIRGIN MEDIA SECURED FINA 144A 5.500% 05/15/2029 DD 05/16/19	377.283
INDIGO NATURAL RESOURCES 144A 6.875% 02/15/2026 DD 02/06/18	376.837
CIRSA FINANCE INTERNATIONAL 144A 7.875% 12/20/2023 DD 07/02/18	376.720
F-BRASILE SPA / F-BRASILE 144A 7.375% 08/15/2026 DD 08/09/19	375.947
IQVIA INC 144A 5.000% 10/15/2026 DD 09/28/16	375.947
OASIS PETROLEUM INC 6.500% 11/01/2021 DD 11/10/11	375.715

Naam	Waarde in euro's
TRIVIUM PACKAGING FINANCE 144A VAR RT 08/15/2026 DD 08/02/19	375.501
KFC HOLDING CO/PIZZA HUT 144A 4.750% 06/01/2027 DD 06/15/17	375.056
KIRK BEAUTY ONE GMBH REGS 8.750% 07/15/2023	374.978
NETFLIX INC 5.375% 02/01/2021 DD 02/01/13	372.077
UNITED RENTALS NORTH AMERICA I 3.875% 11/15/2027 DD 11/04/19	371.999
OCI NV 144A 6.625% 04/15/2023 DD 04/26/18	371.492
CHARLES RIVER LABORATORIE 144A 4.250% 05/01/2028 DD 10/23/19	371.197
PETSMART INC 144A 7.125% 03/15/2023 DD 03/04/15	371.047
MELCO RESORTS FINANCE LTD 144A 5.625% 07/17/2027 DD 07/17/19	371.034
PACIFIC GAS & ELECTRIC CO 5.400% 01/15/2040 DD 11/18/09	370.601
MGM CHINA HOLDINGS LTD 144A 5.375% 05/15/2024 DD 05/16/19	370.601
OCI NV 144A 5.250% 11/01/2024 DD 10/18/19	369.710
ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY I 5.750% 03/15/2025 DD 03/15/17	368.820
PILGRIM'S PRIDE CORP 144A 5.750% 03/15/2025 DD 03/11/15	368.331
MELCO RESORTS FINANCE LTD 144A 5.250% 04/26/2026 DD 04/26/19	368.098
OUTFRONT MEDIA CAPITAL LL 144A 5.000% 08/15/2027 DD 06/14/19	367.675
JEFFERIES FINANCE LLC / J 144A 7.250% 08/15/2024 DD 08/03/17	367.038
L BRANDS INC 7.500% 06/15/2029 DD 06/20/19	367.038
TWIN RIVER WORLDWIDE HOLD 144A 6.750% 06/01/2027 DD 05/10/19	366.849
CAMELOT FINANCE SA 144A 4.500% 11/01/2026 DD 10/31/19	366.147
MELCO RESORTS FINANCE LTD 144A 5.375% 12/04/2029 DD 12/04/19	365.589
UNIVISION COMMUNICATIONS 144A 6.750% 09/15/2022 DD 08/29/12	365.310
CSC HOLDINGS LLC 144A 5.375% 07/15/2023 DD 07/15/18	365.256
TRANSOCEAN GUARDIAN LTD 144A 5.875% 01/15/2024 DD 07/13/18	364.821
ATOTECH ALPHA 2 BV 144A 8.750% 06/01/2023 DD 05/30/18	363.474
WYNN MACAU LTD 144A 4.875% 10/01/2024 DD 09/20/17	363.474
CSC HOLDINGS LLC 144A 7.500% 04/01/2028 DD 10/01/18	363.412
BOYNE USA INC 144A 7.250% 05/01/2025 DD 04/11/18	363.307
LSF10 WOLVERINE INVESTMEN REGS VAR RT 03/15/2024	362.654
EG GLOBAL FINANCE PLC 144A 6.750% 02/07/2025 DD 05/13/19	361.693
TRANSOCEAN GUARDIAN LTD 144A 5.875% 01/15/2024 DD 07/13/18	361.578
UPC HOLDING BV 144A 5.500% 01/15/2028 DD 10/18/17	361.247
SOLVAY FINANCE SA REGS VAR RT 12/31/2049	361.205
SOTHEBY'S 144A 7.375% 10/15/2027 DD 10/02/19	360.802
FAIRSTONE FINANCIAL INC 144A 7.875% 07/15/2024 DD 07/02/19	359.131
CHOBANI LLC / CHOBANI FIN 144A 7.500% 04/15/2025 DD 04/13/17	358.129
SENSATA TECHNOLOGIES INC 144A 4.375% 02/15/2030 DD 09/20/19	356.911
LIVE NATION ENTERTAINMENT 144A 5.625% 03/15/2026 DD 03/20/18	355.791
NATIONSTAR MORTGAGE HOLDI 144A 8.125% 07/15/2023 DD 07/13/18	353.626

Naam	Waarde in euro's
TOLL BROTHERS FINANCE CORP 5.875% 02/15/2022 DD 02/07/12	353.285
WERNER FINCO LP / WERNER 144A 8.750% 07/15/2025 DD 07/10/17	353.062
ENDEAVOR ENERGY RESOURCES 144A 5.750% 01/30/2028 DD 12/07/17	351.197
MURPHY OIL CORP 5.875% 12/01/2027 DD 11/27/19	350.780
USA COMPRESSION PARTNERS LP / 6.875% 04/01/2026 DD 10/01/18	350.780
FREEPORT-MCMORAN INC 5.000% 09/01/2027 DD 08/15/19	350.780
SOPHIA LP / SOPHIA FINANC 144A 9.000% 09/30/2023 DD 09/30/15	349.670
USA COMPRESSION PARTNERS LP / 6.875% 09/01/2027 DD 09/01/19	347.973
NEXTERA ENERGY OPERATING 144A 4.250% 07/15/2024 DD 06/27/19	347.856
ALGECO GLOBAL FINANCE 2 P 144A 10.000% 08/15/2023 DD 02/15/18	347.439
TRANSDIGM INC 6.500% 05/15/2025 DD 11/15/15	347.439
DCP MIDSTREAM OPERATING LP 3.875% 03/15/2023 DD 03/14/13	346.147
SIRIUS XM RADIO INC 144A 3.875% 08/01/2022 DD 07/05/17	345.724
MIDAS INTERMEDIATE HOLDCO 144A 7.875% 10/01/2022 DD 09/24/14	345.490
AVIS BUDGET CAR RENTAL LLC / A 5.500% 04/01/2023 DD 04/03/13	345.361
SOUTHWESTERN ENERGY CO VAR RT 01/23/2025 DD 01/23/15	344.001
SIRIUS XM RADIO INC 144A 5.375% 07/15/2026 DD 05/23/16	343.496
TITAN INTERNATIONAL INC 6.500% 11/30/2023 DD 05/30/18	342.762
UNITED RENTALS NORTH AMERICA I 6.500% 12/15/2026 DD 10/30/18	342.692
IHEARTCOMMUNICATIONS INC 144A 4.750% 01/15/2028 DD 11/22/19	342.428
WPX ENERGY INC 5.750% 06/01/2026 DD 05/23/18	342.361
CARLSON TRAVEL INC 144A 6.750% 12/15/2023 DD 12/16/16	340.757
REFINITIV US HOLDINGS INC 144A 6.250% 05/15/2026 DD 10/01/18	340.256
ZAYO GROUP LLC / ZAYO CAP 144A 5.750% 01/15/2027 DD 01/27/17	339.504
MARRIOTT OWNERSHIP RESORTS INC 6.500% 09/15/2026 DD 03/15/19	339.477
HERTZ CORP/THE 144A 7.125% 08/01/2026 DD 08/01/19	337.684
SIRIUS XM RADIO INC 144A 5.500% 07/01/2029 DD 06/07/19	337.135
CENTENE CORP 144A 4.750% 01/15/2025 DD 07/15/19	336.835
COOKE OMEGA INVESTMENTS I 144A 8.500% 12/15/2022 DD 12/19/17	336.581
EXTRACTION OIL & GAS INC 144A 5.625% 02/01/2026 DD 01/25/18	334.076
CSC HOLDINGS LLC 5.250% 06/01/2024 DD 05/23/14	334.049
ALTICE LUXEMBOURG SA 144A 10.500% 05/15/2027 DD 05/08/19	330.081
TERRAFORM POWER OPERATING 144A 5.000% 01/31/2028 DD 12/12/17	329.674
CENTENNIAL RESOURCE PRODU 144A 5.375% 01/15/2026 DD 11/30/17	328.229
VINE OIL & GAS LP / VINE 144A 8.750% 04/15/2023 DD 10/18/17	327.394
NOVELIS CORP 144A 6.250% 08/15/2024 DD 08/29/16	327.004
BOPARAN FINANCE PLC REGS 4.375% 07/15/2021	326.323
TELESAT CANADA / TELESAT 144A 6.500% 10/15/2027 DD 10/11/19	325.056
KAR AUCTION SERVICES INC 144A 5.125% 06/01/2025 DD 05/31/17	324.276

Naam	Waarde in euro's
ENERGIZER HOLDINGS INC 144A 7.750% 01/15/2027 DD 01/28/19	323.567
SESI LLC 7.125% 12/15/2021 DD 06/15/12	322.924
OTE PLC REGS 0.875% 09/24/2026	322.506
TALLGRASS ENERGY PARTNERS 144A 5.500% 09/15/2024 DD 09/01/16	322.316
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 7.000% 01/15/2028 DD 05/23/19	319.586
HILCORP ENERGY I LP / HIL 144A 6.250% 11/01/2028 DD 10/16/18	319.065
LENNAR CORP 4.750% 04/01/2021 DD 03/04/16	318.820
CATALENT PHARMA SOLUTIONS 144A 5.000% 07/15/2027 DD 06/27/19	318.216
NATHAN'S FAMOUS INC 144A 6.625% 11/01/2025 DD 11/01/17	318.040
TEGNA INC 144A 5.000% 09/15/2029 DD 09/13/19	317.261
ASSUREDPARTNERS INC 144A 7.000% 08/15/2025 DD 08/02/17	317.167
ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / 5.375% 09/15/2024 DD 03/15/17	313.987
TRONOX FINANCE PLC 144A 5.750% 10/01/2025 DD 09/22/17	313.103
SESI LLC 7.750% 09/15/2024 DD 03/15/18	312.802
BERRY GLOBAL INC 144A 4.500% 02/15/2026 DD 01/26/18	312.049
BOMBARDIER INC 144A 6.000% 10/15/2022 DD 04/03/14	311.710
TARGA RESOURCES PARTNERS LP / 5.375% 02/01/2027 DD 10/06/16	311.481
WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 4.750% 08/15/2028 DD 08/09/18	311.021
IHO VERWALTUNGS GMBH 144A 4.750% 09/15/2026 DD 09/22/16	309.862
RANGE RESOURCES CORP 5.000% 08/15/2022 DD 08/15/17	305.568
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 7.250% 05/30/2029 DD 05/23/19	305.345
BOMBARDIER INC 144A 7.500% 12/01/2024 DD 11/27/17	304.191
CMA CGM SA REGS 5.250% 01/15/2025	301.929
COMMSCOPE INC 144A 5.500% 03/01/2024 DD 02/19/19	301.837
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 5.500% 03/01/2023 DD 01/30/15	300.829
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 6.500% 03/15/2022 DD 03/21/17	300.601
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 5.250% 01/30/2030 DD 12/30/19	300.245
HEXION HOLDINGS CORP	297.509
DIGICEL GROUP ONE LTD 144A 8.250% 12/30/2022 DD 09/30/18	297.002
ARCONIC INC 5.950% 02/01/2037 DD 01/25/07	296.967
ASHTON WOODS USA LLC / AS 144A 6.750% 08/01/2025 DD 08/08/17	296.047
HCA INC 5.375% 02/01/2025 DD 01/16/15	295.545
ELDORADO RESORTS INC 6.000% 09/15/2026 DD 03/15/19	294.321
VIDEOTRON LTD 144A 5.375% 06/15/2024 DD 04/09/14	293.987
NAVIENT CORP 6.750% 06/15/2026 DD 06/11/18	293.746
TENET HEALTHCARE CORP 6.750% 06/15/2023 DD 06/16/15	293.642
CLEAN HARBORS INC 144A 5.125% 07/15/2029 DD 07/02/19	291.441
DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.375% 07/15/2025 DD 07/17/18	290.646
NOBLE HOLDING INTERNATIONAL 144A 7.875% 02/01/2026 DD 01/31/18	290.646

Naam	Waarde in euro's
CNX RESOURCES CORP 5.875% 04/15/2022 DD 10/15/14	289.735
FTS INTERNATIONAL INC 6.250% 05/01/2022 DD 04/16/14	289.532
TRANSOCEAN PONTUS LTD 144A 6.125% 08/01/2025 DD 07/20/18	289.319
PRECISION DRILLING CORP 7.750% 12/15/2023 DD 06/15/17	288.808
PAR PHARMACEUTICAL INC 144A 7.500% 04/01/2027 DD 03/28/19	288.085
PARKLAND FUEL CORP 144A 5.875% 07/15/2027 DD 07/10/19	287.401
MATTEL INC 144A 6.750% 12/31/2025 DD 12/20/17	287.252
BOYD GAMING CORP 6.000% 08/15/2026 DD 06/25/18	286.637
GRINDING MEDIA INC / MOLY 144A 7.375% 12/15/2023 DD 12/16/16	285.885
BEAZER HOMES USA INC 144A 7.250% 10/15/2029 DD 09/24/19	285.301
IAA INC 144A 5.500% 06/15/2027 DD 06/06/19	284.911
MATCH GROUP INC 144A 5.625% 02/15/2029 DD 02/15/19	284.633
COMPASS MINERALS INTERNAT 144A 6.750% 12/01/2027 DD 11/26/19	283.964
MTS SYSTEMS CORP 144A 5.750% 08/15/2027 DD 07/16/19	283.942
DENBURY RESOURCES INC 144A 9.250% 03/31/2022 DD 12/06/17	282.960
NETFLIX INC 144A 5.375% 11/15/2029 DD 04/29/19	282.730
FORTRESS TRANSPORTATION & 144A 6.500% 10/01/2025 DD 09/18/18	282.094
BIG RIVER STEEL LLC / BRS 144A 7.250% 09/01/2025 DD 08/23/17	281.960
CENTURYLINK INC 5.800% 03/15/2022 DD 03/12/12	280.963
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 5.875% 12/01/2027 DD 11/22/19	280.624
IRB HOLDING CORP 144A 6.750% 02/15/2026 DD 02/05/18	279.955
NEW ENTERPRISE STONE & LI 144A 6.250% 03/15/2026 DD 03/12/18	279.955
SPRINT COMMUNICATIONS INC 9.250% 04/15/2022 DD 04/15/92	279.900
PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.250% 12/14/2026	279.820
TRANSOCEAN INC VAR RT 10/15/2022 DD 09/13/12	279.399
LIONS GATE CAPITAL HOLDIN 144A 6.375% 02/01/2024 DD 02/04/19	279.293
TARGA RESOURCES PARTNERS 144A 6.500% 07/15/2027 DD 01/17/19	278.993
ALERIS INTERNATIONAL INC 144A 10.750% 07/15/2023 DD 06/25/18	278.619
ANTERO RESOURCES CORP 5.375% 11/01/2021 DD 05/01/14	275.689
HILCORP ENERGY I LP / HIL 144A 5.750% 10/01/2025 DD 06/04/15	275.357
KRATON POLYMERS LLC / KRA 144A 7.000% 04/15/2025 DD 03/24/17	275.278
TERRAFORM POWER OPERATING 144A 4.250% 01/31/2023 DD 12/12/17	275.137
VISTAJET MALTA FINANCE PL 144A 10.500% 06/01/2024 DD 05/29/19	275.056
USI INC/NY 144A 6.875% 05/01/2025 DD 04/18/17	273.194
ICAHN ENTERPRISES LP / ICAHN E 6.250% 02/01/2022 DD 01/18/17	272.339
MGM RESORTS INTERNATIONAL 5.500% 04/15/2027 DD 04/10/19	271.938
TARGA RESOURCES PARTNERS 144A 6.875% 01/15/2029 DD 01/17/19	271.938
BANFF MERGER SUB INC 144A 9.750% 09/01/2026 DD 08/23/18	271.503
STAPLES INC 144A 7.500% 04/15/2026 DD 04/16/19	270.813

Naam	Waarde in euro's
BANFF MERGER SUB INC 144A 9.750% 09/01/2026 DD 08/23/18	270.601
STAPLES INC 144A 10.750% 04/15/2027 DD 04/16/19	268.557
POLARIS INTERMEDIATE CORP 144A 8.500% 12/01/2022 DD 11/21/17	267.774
ADT SECURITY CORP/THE 3.500% 07/15/2022 DD 01/15/13	267.571
GCI LLC 144A 6.625% 06/15/2024 DD 06/06/19	265.200
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 9.000% 12/15/2025 DD 12/18/17	264.418
CALFRAC HOLDINGS LP 144A 8.500% 06/15/2026 DD 05/30/18	262.619
SPECTRUM BRANDS INC 6.125% 12/15/2024 DD 12/15/15	262.149
INSTALLED BUILDING PRODUC 144A 5.750% 02/01/2028 DD 09/26/19	261.832
CDK GLOBAL INC 5.875% 06/15/2026 DD 06/18/18	261.717
UBS AG REGS VAR RT 02/12/2026	261.139
BELDEN INC REGS 3.375% 07/15/2027	260.625
NABORS INDUSTRIES INC 5.100% 09/15/2023 DD 03/15/14	259.971
WW INTERNATIONAL INC 144A 8.625% 12/01/2025 DD 11/29/17	259.840
MASONITE INTERNATIONAL CO 144A 5.375% 02/01/2028 DD 07/25/19	258.769
POST HOLDINGS INC 144A 5.000% 08/15/2026 DD 08/03/16	258.769
MURPHY OIL USA INC 4.750% 09/15/2029 DD 09/13/19	258.725
CARVANA CO 144A 8.875% 10/01/2023 DD 09/21/18	258.311
DOWNSTREAM DEVELOPMENT AU 144A 10.500% 02/15/2023 DD 02/01/18	257.238
QORVO INC 144A 4.375% 10/15/2029 DD 09/30/19	256.626
TOPBUILD CORP 144A 5.625% 05/01/2026 DD 04/25/18	256.013
NGPL PIPECO LLC 144A 4.375% 08/15/2022 DD 08/01/17	254.478
WEEKLEY HOMES LLC / WEEKLEY FI 6.625% 08/15/2025 DD 08/14/17	254.176
MERCER INTERNATIONAL INC 6.500% 02/01/2024 DD 08/01/17	254.176
ENTEGRIS INC 144A 4.625% 02/10/2026 DD 11/10/17	253.563
JBS USA LUX SA / JBS USA 144A 5.750% 06/15/2025 DD 06/04/15	253.563
NAVIENT CORP 5.875% 03/25/2021 DD 03/27/15	253.074
BOYD GAMING CORP 6.375% 04/01/2026 DD 10/01/16	253.049
NETFLIX INC 5.375% 02/01/2021 DD 02/01/13	252.645
BOMBARDIER INC 144A 7.500% 03/15/2025 DD 03/13/15	252.642
MPT OPERATING PARTNERSHIP LP / 4.625% 08/01/2029 DD 07/26/19	252.339
TERRIER MEDIA BUYER INC 144A 8.875% 12/15/2027 DD 12/17/19	251.539
WILLIAMS SCOTSMAN INTERNA 144A 7.875% 12/15/2022 DD 11/29/17	250.757
SM ENERGY CO 6.750% 09/15/2026 DD 09/12/16	250.566
CONSOLIDATED ENERGY FINAN 144A 6.500% 05/15/2026 DD 05/07/18	250.557
GRUBHUB HOLDINGS INC 144A 5.500% 07/01/2027 DD 06/10/19	250.236
INTELSAT LUXEMBOURG SA 8.125% 06/01/2023 DD 04/05/13	250.195
NFP CORP 144A 8.000% 07/15/2025 DD 10/18/19	249.889
SIRIUS XM RADIO INC 144A 4.625% 05/15/2023 DD 05/16/13	248.664

Naam	Waarde in euro's
CALLON PETROLEUM CO 6.375% 07/01/2026 DD 06/07/18	248.567
BAFFINLAND IRON MINES COR 144A 8.750% 07/15/2026 DD 06/27/18	246.826
FLEX ACQUISITION CO INC 144A 7.875% 07/15/2026 DD 06/29/18	246.826
DUN & BRADSTREET CORP/THE 144A 6.875% 08/15/2026 DD 02/08/19	245.824
NEWMARK GROUP INC 6.125% 11/15/2023 DD 11/06/18	245.614
AMKOR TECHNOLOGY INC 144A 6.625% 09/15/2027 DD 03/15/19	245.267
BANCO ESPIRITO SANTO SA REGS 4.000% 01/21/2019	244.006
GENWORTH HOLDINGS INC 4.900% 08/15/2023 DD 08/15/18	242.539
STARS GROUP HOLDINGS BV / 144A 7.000% 07/15/2026 DD 07/10/18	241.091
EXELA INTERMEDIATE LLC / 144A 10.000% 07/15/2023 DD 07/12/17	240.535
OASIS PETROLEUM INC 144A 6.250% 05/01/2026 DD 05/14/18	240.312
SPRINT CAPITAL CORP 6.875% 11/15/2028 DD 11/16/98	239.978
SCHWEITZER-MAUDUIT INTERN 144A 6.875% 10/01/2026 DD 09/25/18	239.978
CHARLES RIVER LABORATORIE 144A 5.500% 04/01/2026 DD 04/03/18	239.421
FREEPORT-MCMORAN INC 5.250% 09/01/2029 DD 08/15/19	238.597
GULFPORT ENERGY CORP 6.000% 10/15/2024 DD 04/15/17	237.194
COMMSCOPE INC 144A 6.000% 03/01/2026 DD 02/19/19	236.915
NGPL PIPECO LLC 144A 4.875% 08/15/2027 DD 08/01/17	236.734
CHURCHILL DOWNS INC 144A 5.500% 04/01/2027 DD 03/25/19	236.080
CHEMOURS CO/THE 7.000% 05/15/2025 DD 05/15/16	234.261
PIONEER HOLDINGS LLC / PI 144A 9.000% 11/01/2022 DD 10/31/17	232.739
FORTRESS TRANSPORTATION & 144A 6.750% 03/15/2022 DD 03/15/17	232.183
KB HOME 6.875% 06/15/2027 DD 02/20/19	232.016
TARGA RESOURCES PARTNERS LP / 5.125% 02/01/2025 DD 10/06/16	231.069
ARCONIC INC 5.900% 02/01/2027 DD 01/25/07	229.567
PBF LOGISTICS LP / PBF LOGISTI 6.875% 05/15/2023 DD 11/15/15	229.399
OXFORD FINANCE LLC / OXFO 144A 6.375% 12/15/2022 DD 12/19/17	229.120
UBER TECHNOLOGIES INC 144A 7.500% 09/15/2027 DD 09/17/19	228.494
WHITING PETROLEUM CORP 6.625% 01/15/2026 DD 07/15/18	227.666
APTIM CORP 144A 7.750% 06/15/2025 DD 06/30/17	227.171
DELPHI TECHNOLOGIES PLC 144A 5.000% 10/01/2025 DD 09/28/17	226.615
CALLON PETROLEUM CO 6.250% 04/15/2023 DD 04/28/15	226.025
REFINITIV US HOLDINGS INC 144A 8.250% 11/15/2026 DD 10/01/18	225.752
NAVIENT CORP 8.000% 03/25/2020 DD 03/22/10	225.016
PDC ENERGY INC 6.250% 12/01/2025 DD 06/01/18	224.388
FREEPORT-MCMORAN INC 5.400% 11/14/2034 DD 11/14/14	223.964
ASURION 2/18 COV-LITE TLB 0.000% 11/03/2023 DD 02/20/18	223.285
MATADOR RESOURCES CO 5.875% 09/15/2026 DD 08/21/18	223.274
WABASH NATIONAL CORP 144A 5.500% 10/01/2025 DD 09/26/17	222.717

Naam	Waarde in euro's
COEUR MINING INC 5.875% 06/01/2024 DD 05/31/17	222.717
MEDALLION MIDLAND 10/17 TLB	222.672
NATIONSTAR MORTGAGE HOLDI 144A 9.125% 07/15/2026 DD 07/13/18	221.993
CHEMOURS CO/THE 5.375% 05/15/2027 DD 05/23/17	221.546
SM ENERGY CO 6.625% 01/15/2027 DD 08/20/18	218.899
TENNANT CO 5.625% 05/01/2025 DD 11/01/17	218.775
TAYLOR MORRISON COMMUNITI 144A 5.750% 01/15/2028 DD 08/01/19	218.486
TRANSOCEAN INC 144A 7.250% 11/01/2025 DD 10/25/18	218.263
VERICAST CORP 144A 8.375% 08/15/2022 DD 02/08/17	217.817
CLEVELAND-CLIFFS INC 5.750% 03/01/2025 DD 03/01/18	217.156
CREDIT ACCEPTANCE CORP 144A 6.625% 03/15/2026 DD 03/07/19	216.732
AVIS BUDGET CAR RENTAL LLC / A 5.500% 04/01/2023 DD 04/03/13	216.644
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	216.479
MERCER INTERNATIONAL INC 7.375% 01/15/2025 DD 07/15/19	215.769
VERTIV GROUP CORP 144A 9.250% 10/15/2024 DD 10/17/16	215.479
CDK GLOBAL INC 144A 5.250% 05/15/2029 DD 05/15/19	214.978
PGT INNOVATIONS INC 144A 6.750% 08/01/2026 DD 08/10/18	214.727
VIASAT INC 144A 5.625% 04/15/2027 DD 03/27/19	214.477
CNX RESOURCES CORP 144A 7.250% 03/14/2027 DD 03/14/19	214.292
ENERGIZER HOLDINGS INC 144A 6.375% 07/15/2026 DD 07/06/18	213.474
QORVO INC 5.500% 07/15/2026 DD 01/15/19	213.474
ENPRO INDUSTRIES INC 5.750% 10/15/2026 DD 04/15/19	213.474
NEW ENTERPRISE STONE & LI 144A 10.125% 04/01/2022 DD 03/15/17	212.222
IQVIA INC 144A 5.000% 05/15/2027 DD 05/10/19	212.042
PRECISION DRILLING CORP 144A 7.125% 01/15/2026 DD 11/22/17	211.581
EAGLE INTERMEDIATE GLOBAL 144A 7.500% 05/01/2025 DD 05/04/18	211.136
PRESTIGE BRANDS INC 144A 5.125% 01/15/2028 DD 12/02/19	209.967
ELEMENT SOLUTIONS INC 144A 5.875% 12/01/2025 DD 11/24/17	209.716
COMMSCOPE TECHNOLOGIES LL 144A 5.000% 03/15/2027 DD 03/13/17	209.354
GLOBAL AIRCRAFT LEASING C 144A 6.500% 09/15/2024 DD 07/31/19	209.155
TRIUMPH GROUP INC 7.750% 08/15/2025 DD 08/17/17	209.004
TENET HEALTHCARE CORP 144A 4.625% 09/01/2024 DD 08/26/19	208.984
WILLIAM LYON HOMES INC 6.000% 09/01/2023 DD 09/01/18	208.964
WESTERN DIGITAL CORP 4.750% 02/15/2026 DD 02/13/18	208.964
CALPINE CORP 144A 5.250% 06/01/2026 DD 05/31/16	208.714
AVIS BUDGET CAR RENTAL LL 144A 5.750% 07/15/2027 DD 07/03/19	208.463
CREDIT ACCEPTANCE CORP 144A 5.125% 12/31/2024 DD 12/18/19	208.155
ENCOMPASS HEALTH CORP 4.750% 02/01/2030 DD 09/18/19	207.962
MATTEL INC 5.450% 11/01/2041 DD 11/08/11	207.768

Naam	Waarde in euro's
CAESARS RESORT COLLECTION 144A 5.250% 10/15/2025 DD 10/16/17	207.461
TTM TECHNOLOGIES INC 144A 5.625% 10/01/2025 DD 09/28/17	207.210
CORNERSTONE CHEMICAL CO 144A 6.750% 08/15/2024 DD 08/09/17	207.127
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC 6.000% 12/01/2020 DD 11/08/13	206.759
DIGICEL LTD 144A 6.750% 03/01/2023 DD 03/03/15	206.685
KAISER ALUMINUM CORP 144A 4.625% 03/01/2028 DD 11/26/19	205.657
BOMBARDIER INC 144A 6.125% 01/15/2023 DD 01/14/13	205.557
WHITING PETROLEUM CORP 6.250% 04/01/2023 DD 03/27/15	205.178
TELESAT CANADA / TELESAT 144A 4.875% 06/01/2027 DD 12/06/19	203.953
EAGLE HOLDING CO II LLC 144A 7.750% 05/15/2022 DD 05/14/19	203.528
CLEVELAND COMMON STOCK	203.459
TRANSOCEAN PONTUS LTD 144A 6.125% 08/01/2025 DD 07/20/18	203.174
GRANITE US HOLDINGS CORP 144A 11.000% 10/01/2027 DD 09/30/19	202.951
CF INDUSTRIES INC 5.375% 03/15/2044 DD 03/11/14	202.949
CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDING 5.125% 02/15/2023 DD 12/17/12	202.700
WINDSTREAM SERVICES LLC / 144A 8.625% 10/31/2025 DD 11/06/17	202.690
SM ENERGY CO 6.125% 11/15/2022 DD 05/15/15	202.450
KORN FERRY 144A 4.625% 12/15/2027 DD 12/16/19	201.448
WYNDHAM DESTINATIONS INC 144A 4.625% 03/01/2030 DD 12/13/19	200.947
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC 5.875% 11/15/2026 DD 05/15/17	200.724
MATTHEWS INTERNATIONAL CO 144A 5.250% 12/01/2025 DD 12/06/17	200.445
ALTICE FINANCING SA 144A 6.625% 02/15/2023 DD 02/04/15	199.421
BARCLAYS PLC VAR RT 12/31/2049 DD 03/27/19	199.332
DCP MIDSTREAM OPERATING L 144A 4.750% 09/30/2021 DD 09/19/11	198.635
USA COMPRESSION PARTNERS LP / 6.875% 09/01/2027 DD 09/01/19	198.577
ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.600% 04/01/2044 DD 03/19/14	198.441
TRIVIUM PACKAGING FINANCE 144A VAR RT 08/15/2027 DD 08/02/19	198.218
TRANSOCEAN INC 144A 7.500% 01/15/2026 DD 10/17/17	197.940
SCIENTIFIC GAMES INTERNAT 144A 8.250% 03/15/2026 DD 03/19/19	196.437
TENET HEALTHCARE CORP 7.000% 08/01/2025 DD 06/14/17	195.724
BARCLAYS PLC VAR RT 12/31/2049 DD 08/14/18	194.655
JBS INVESTMENTS II GMBH 144A 7.000% 01/15/2026 DD 10/26/18	193.823
DIEBOLD NIXDORF INC 8.500% 04/15/2024 DD 10/15/16	193.430
CALIFORNIA RESOURCES CORP 144A 8.000% 12/15/2022 DD 12/15/15	192.686
SENSATA TECHNOLOGIES UK F 144A 6.250% 02/15/2026 DD 11/27/15	191.982
COMSTOCK RESOURCES INC 144A 7.500% 05/15/2025 DD 05/03/17	191.537
WYNN LAS VEGAS LLC / WYNN 144A 5.500% 03/01/2025 DD 02/18/15	190.646
MATTEL INC 144A 5.875% 12/15/2027 DD 11/20/19	190.567
PERFORMANCE FOOD GROUP IN 144A 5.500% 10/15/2027 DD 09/27/19	190.423

Naam	Waarde in euro's
GRAHAM HOLDINGS CO 144A 5.750% 06/01/2026 DD 05/30/18	190.200
TRANSDIGM UK HOLDINGS PLC 6.875% 05/15/2026 DD 11/15/18	189.755
DARLING INGREDIENTS INC 144A 5.250% 04/15/2027 DD 04/03/19	189.532
IAA INC 144A 5.500% 06/15/2027 DD 06/06/19	189.310
EG GLOBAL FINANCE PLC 144A 8.500% 10/30/2025 DD 10/21/19	189.087
CHS/COMMUNITY HEALTH SYST 144A 8.625% 01/15/2024 DD 07/06/18	188.864
MGM CHINA HOLDINGS LTD 144A 5.875% 05/15/2026 DD 05/16/19	188.864
NETFLIX INC 5.500% 02/15/2022 DD 02/05/15	188.641
RADIAN GROUP INC 4.500% 10/01/2024 DD 09/26/17	188.419
MOTION BONDCO DAC 144A 6.625% 11/15/2027 DD 11/04/19	188.419
LAREDO PETROLEUM INC 6.250% 03/15/2023 DD 03/18/15	187.918
JBS INVESTMENTS II GMBH 144A 5.750% 01/15/2028 DD 07/30/19	187.884
ARAMARK SERVICES INC 144A 5.000% 02/01/2028 DD 01/18/18	187.751
WMG ACQUISITION CORP 144A 5.500% 04/15/2026 DD 03/14/18	187.528
JAMES HARDIE INTERNATIONAL 144A 5.000% 01/15/2028 DD 12/13/17	187.082
JEFFERIES FINANCE LLC / J 144A 6.250% 06/03/2026 DD 06/03/19	186.637
POST HOLDINGS INC 144A 5.500% 03/01/2025 DD 02/14/17	186.637
MURPHY OIL CORP 5.750% 08/15/2025 DD 08/18/17	186.361
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 5.500% 03/01/2023 DD 01/30/15	186.227
MTS SYSTEMS CORP 144A 5.750% 08/15/2027 DD 07/16/19	186.192
DISH DBS CORP 7.750% 07/01/2026 DD 06/13/16	174.599
ALGECO GLOBAL FINANCE PLC 144A 8.000% 02/15/2023 DD 02/15/18	173.497
WILLIAM LYON HOMES INC 144A 6.625% 07/15/2027 DD 07/09/19	169.154
ACRISURE LLC / ACRISURE F 144A 10.125% 08/01/2026 DD 08/01/19	167.984
CHAPARRAL ENERGY INC 144A 8.750% 07/15/2023 DD 06/29/18	167.918
QWEST CORP 6.750% 12/01/2021 DD 10/04/11	167.861
JBS USA LUX SA / JBS USA 144A 5.500% 01/15/2030 DD 08/06/19	167.454
WYNN RESORTS FINANCE LLC 144A 5.125% 10/01/2029 DD 09/20/19	167.205
NEWELL BRANDS INC VAR RT 04/01/2046 DD 03/30/16	167.111
VINE OIL & GAS LP / VINE 144A 9.750% 04/15/2023 DD 10/03/18	167.038
AVANTOR INC 144A 6.000% 10/01/2024 DD 10/02/17	166.227
DIGICEL GROUP TWO LTD 144A 8.250% 09/30/2022 DD 09/30/18	166.129
NETFLIX INC 144A 5.375% 11/15/2029 DD 04/29/19	166.033
COLFAX CORP 144A 6.000% 02/15/2024 DD 02/05/19	165.646
MASONITE INTERNATIONAL CO 144A 5.750% 09/15/2026 DD 08/27/18	165.646
SOLERA LLC / SOLERA FINAN 144A 10.500% 03/01/2024 DD 03/03/16	165.421
HLF FINANCING SARL LLC / 144A 7.250% 08/15/2026 DD 08/16/18	165.256
TRANSOCEAN POSEIDON LTD 144A 6.875% 02/01/2027 DD 02/01/19	165.256
SPX FLOW INC 144A 5.625% 08/15/2024 DD 08/10/16	165.116

Naam	Waarde in euro's
GREAT LAKES DREDGE & DOCK CORP 8.000% 05/15/2022 DD 05/24/17	164.866
VERITAS US INC / VERITAS 144A 10.500% 02/01/2024 DD 01/29/16	164.811
NOKIA OF AMERICA CORP 6.450% 03/15/2029 DD 03/15/99	164.477
MATTEL INC 144A 5.875% 12/15/2027 DD 11/20/19	164.282
CDW LLC / CDW FINANCE CORP 4.250% 04/01/2028 DD 09/26/19	163.502
PACIFIC GAS & ELECTRIC CO 6.050% 03/01/2034 DD 03/23/04	163.307
COMMERCIAL METALS CO 5.750% 04/15/2026 DD 10/15/18	162.918
HOWARD HUGHES CORP/THE 144A 5.375% 03/15/2025 DD 03/16/17	162.528
RITCHIE BROS AUCTIONEERS 144A 5.375% 01/15/2025 DD 12/21/16	162.528
ANIXTER INC 6.000% 12/01/2025 DD 06/01/19	162.138
BOYD GAMING CORP 144A 4.750% 12/01/2027 DD 12/03/19	161.943
ENERGIZER HOLDINGS INC 144A 5.500% 06/15/2025 DD 06/01/15	161.748
GREYSTAR REAL ESTATE PART 144A 5.750% 12/01/2025 DD 11/24/17	161.748
CROWN EUROPEAN HOLDINGS S REGS 2.250% 02/01/2023	161.477
SHEA HOMES LP / SHEA HOME 144A 6.125% 04/01/2025 DD 03/23/15	161.359
ESH HOSPITALITY INC 144A 5.250% 05/01/2025 DD 05/15/15	161.164
JAGGED PEAK ENERGY LLC 5.875% 05/01/2026 DD 11/01/18	160.966
US FOODS INC 144A 5.875% 06/15/2024 DD 06/27/16	160.579
ENDO DAC / ENDO FINANCE L 144A VAR RT 02/01/2025 DD 01/27/15	160.409
SUMMIT MATERIALS LLC / SU 144A 5.125% 06/01/2025 DD 06/01/17	160.189
PACIFIC GAS & ELECTRIC CO 5.125% 11/15/2043 DD 11/12/13	159.508
DCP MIDSTREAM OPERATING LP 3.875% 03/15/2023 DD 03/14/13	159.410
DONNELLEY FINANCIAL SOLUTIONS 8.250% 10/15/2024 DD 04/15/17	159.410
TALEN ENERGY SUPPLY LLC 144A 6.625% 01/15/2028 DD 07/08/19	159.020
NOBLE HOLDING INTERNATIONAL LT VAR RT 04/01/2045 DD 03/16/15	159.020
ADIENT GLOBAL HOLDINGS LT 144A 4.875% 08/15/2026 DD 08/19/16	159.020
CRESTWOOD MIDSTREAM PARTN 144A 5.625% 05/01/2027 DD 04/15/19	158.046
PDC ENERGY INC 6.125% 09/15/2024 DD 03/15/17	157.851
FRONTIER COMMUNICATIONS C 144A 8.500% 04/01/2026 DD 03/19/18	157.851
PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC 3.750% 08/15/2020 DD 08/15/17	157.461
FIVE POINT OPERATING CO L 144A 7.875% 11/15/2025 DD 11/22/17	157.042
DISH DBS CORP 5.125% 05/01/2020 DD 04/05/13	156.876
1011778 BC ULC / NEW RED 144A 4.375% 01/15/2028 DD 11/19/19	156.292
INN OF THE MOUNTAIN GODS RESOR 9.250% 11/30/2020 DD 07/17/18	154.343
UNIVISION COMMUNICATIONS 144A 5.125% 02/15/2025 DD 02/19/15	154.148
TRANSMONTAIGNE PARTNERS LP / T 6.125% 02/15/2026 DD 02/12/18	152.784
PROVIDENT FUNDING ASSOCIA 144A 6.375% 06/15/2025 DD 06/08/17	152.784
NAVIENT CORP 7.250% 09/25/2023 DD 09/16/16	151.006
TULLOW OIL PLC 144A 7.000% 03/01/2025 DD 03/23/18	149.990

Naam	Waarde in euro's
ORANGE SA REGS VAR RT 12/31/2049	146.841
GLP CAPITAL LP / GLP FINANCING 5.250% 06/01/2025 DD 05/21/18	146.673
JPW INDUSTRIES HOLDING CO 144A 9.000% 10/01/2024 DD 09/22/17	146.548
BOMBARDIER INC 144A 8.750% 12/01/2021 DD 11/21/16	146.409
AVOLON HOLDINGS FUNDING L 144A 5.250% 05/15/2024 DD 03/01/19	145.868
JC PENNEY CORP INC 144A 8.625% 03/15/2025 DD 03/12/18	144.543
COMMSCOPE INC 144A 8.250% 03/01/2027 DD 02/19/19	144.396
SUMMIT MATERIALS LLC / SU 144A 6.500% 03/15/2027 DD 03/15/19	143.653
TELECOM ITALIA SPA/MILANO 144A 5.303% 05/30/2024 DD 05/30/14	143.653
RITE AID CORP 144A 6.125% 04/01/2023 DD 04/02/15	143.430
SALEM MEDIA GROUP INC 144A 6.750% 06/01/2024 DD 05/19/17	143.430
GRAPHIC PACKAGING INTERNA 144A 4.750% 07/15/2027 DD 06/25/19	142.984
SCOTTS MIRACLE-GRO CO/THE 5.250% 12/15/2026 DD 12/15/16	142.650
MATTAMY GROUP CORP 144A 6.500% 10/01/2025 DD 09/26/17	142.650
ALBERTSONS COS INC / SAFE 144A 5.875% 02/15/2028 DD 08/15/19	141.982
SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 5.125% 06/01/2029 DD 05/21/19	141.982
AMSTED INDUSTRIES INC 144A 5.625% 07/01/2027 DD 06/05/19	141.648
MIDCONTINENT COMMUNICATIO 144A 5.375% 08/15/2027 DD 08/07/19	141.314
OLIN CORP 5.625% 08/01/2029 DD 07/16/19	141.140
WPX ENERGY INC 5.250% 10/15/2027 DD 09/24/19	140.980
GENWORTH HOLDINGS INC 7.625% 09/24/2021 DD 03/25/11	140.766
CLEAN HARBORS INC 144A 4.875% 07/15/2027 DD 07/02/19	140.646
SPRINT COMMUNICATIONS INC 6.000% 11/15/2022 DD 11/14/12	140.145
MANITOWOC CO INC/THE 144A 9.000% 04/01/2026 DD 03/25/19	139.978
KINROSS GOLD CORP 4.500% 07/15/2027 DD 07/15/18	139.978
LITHIA MOTORS INC 144A 5.250% 08/01/2025 DD 07/24/17	139.811
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC 4.250% 10/01/2022 DD 09/29/17	139.644
GTCR AP FINANCE INC 144A 8.000% 05/15/2027 DD 05/13/19	138.976
SUNOCO LP / SUNOCO FINANCE COR 5.500% 02/15/2026 DD 08/15/18	138.641
AVON INTERNATIONAL CAPITA 144A 6.500% 08/15/2022 DD 07/03/19	138.641
QUALITYTECH LP / QTS FINA 144A 4.750% 11/15/2025 DD 11/08/17	138.474
GULFPORT ENERGY CORP 6.375% 01/15/2026 DD 01/15/18	138.085
RBS GLOBAL INC / REXNORD 144A 4.875% 12/15/2025 DD 12/07/17	137.973
ADVANCED DRAINAGE SYSTEMS 144A 5.000% 09/30/2027 DD 09/23/19	137.806
BEACON ROOFING SUPPLY INC 144A 4.500% 11/15/2026 DD 10/09/19	137.639
JELD-WEN INC 144A 4.625% 12/15/2025 DD 12/14/17	137.572
HILL-ROM HOLDINGS INC 144A 4.375% 09/15/2027 DD 09/19/19	137.472
LITHIA MOTORS INC 144A 4.625% 12/15/2027 DD 12/09/19	137.353
TARGA RESOURCES PARTNERS 144A 5.500% 03/01/2030 DD 11/27/19	137.305

Naam	Waarde in euro's
SINCLAIR TELEVISION GROUP 144A 5.500% 03/01/2030 DD 11/27/19	136.637
SPX FLOW INC 144A 5.625% 08/15/2024 DD 08/10/16	136.360
LPL HOLDINGS INC 144A 4.625% 11/15/2027 DD 11/12/19	136.303
TRANSOCEAN SENTRY LTD 144A 5.375% 05/15/2023 DD 05/24/19	135.969
SPEEDWAY MOTORSPORTS LLC 144A 4.875% 11/01/2027 DD 10/23/19	135.468
NCL CORP LTD 144A 3.625% 12/15/2024 DD 12/16/19	135.468
BANK OF NOVA SCOTIA/THE VAR RT 12/31/2049 DD 10/12/17	135.301
FERRELLGAS LP / FERRELLGAS FIN 6.500% 05/01/2021 DD 05/01/11	134.855
ALLY FINANCIAL INC 8.000% 03/15/2020 DD 09/15/10	134.800
TWITTER INC 144A 3.875% 12/15/2027 DD 12/09/19	133.561
AVAYA HOLDINGS CORP	133.482
VIRGIN AUSTRALIA HOLDINGS 144A 8.125% 11/15/2024 DD 11/07/19	132.808
DENBURY RESOURCES INC 6.375% 08/15/2021 DD 02/17/11	131.706
ENCOMPASS HEALTH CORP 5.750% 11/01/2024 DD 09/11/12	131.530
TALLGRASS ENERGY PARTNERS 144A 5.500% 01/15/2028 DD 09/15/17	130.958
MOSS CREEK RESOURCES HOLD 144A 10.500% 05/15/2027 DD 05/01/19	130.178
MOUNTAIN PROVINCE DIAMOND 144A 8.000% 12/15/2022 DD 12/11/17	128.953
HCA INC 5.875% 02/15/2026 DD 11/13/15	126.629
ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.450% 06/01/2047 DD 05/11/17	125.891
ADVANCED MICRO DEVICES INC 7.500% 08/15/2022 DD 02/15/13	125.418
MGM GROWTH PROPERTIES OPE 144A 5.750% 02/01/2027 DD 01/25/19	124.165
NETFLIX INC 5.875% 11/15/2028 DD 04/26/18	123.448
CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS I 6.875% 02/01/2022 DD 08/01/14	123.394
IHEARTCOMMUNICATIONS INC 8.375% 05/01/2027 DD 05/01/19	123.051
CHS/COMMUNITY HEALTH SYST 144A 6.875% 04/01/2028 DD 11/19/19	122.613
KCA DEUTAG UK FINANCE PLC 144A 9.625% 04/01/2023 DD 04/09/18	121.158
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 5.750% 08/15/2027 DD 03/08/19	120.824
CHS/COMMUNITY HEALTH SYST 144A 8.125% 06/30/2024 DD 06/22/18	120.535
ENDO DAC / ENDO FINANCE L 144A VAR RT 02/01/2025 DD 01/27/15	120.157
ACI WORLDWIDE INC 144A 5.750% 08/15/2026 DD 08/21/18	119.989
VIZIENT INC 144A 6.250% 05/15/2027 DD 05/06/19	119.154
SUMMIT MIDSTREAM HOLDINGS LLC 5.750% 04/15/2025 DD 02/15/17	119.070
PARKLAND FUEL CORP 144A 6.000% 04/01/2026 DD 03/23/18	117.628
APERGY CORP 6.375% 05/01/2026 DD 11/01/18	117.483
KFC HOLDING CO/PIZZA HUT 144A 5.250% 06/01/2026 DD 06/16/16	117.483
ADT SECURITY CORP/THE 6.250% 10/15/2021 DD 04/15/14	117.483
CATALENT PHARMA SOLUTIONS 144A 5.000% 07/15/2027 DD 06/27/19	116.648
ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY I 6.625% 06/15/2024 DD 06/15/17	116.555
KISSNER HOLDINGS LP / KIS 144A 8.375% 12/01/2022 DD 11/18/16	116.509

Naam	Waarde in euro's
BAUSCH HEALTH COS INC 144A 5.500% 11/01/2025 DD 10/17/17	116.370
PQ CORP 144A 5.750% 12/15/2025 DD 12/11/17	116.370
SPRINGLEAF FINANCE CORP 5.375% 11/15/2029 DD 11/07/19	116.236
TWIN RIVER WORLDWIDE HOLD 144A 6.750% 06/01/2027 DD 05/10/19	116.091
VIPER ENERGY PARTNERS LP 144A 5.375% 11/01/2027 DD 10/16/19	115.813
HEXION INC 144A 7.875% 07/15/2027 DD 07/01/19	115.807
PLASTIPAK HOLDINGS INC 144A 6.250% 10/15/2025 DD 10/12/17	115.251
CASCADES INC/CASCADES USA 144A 5.375% 01/15/2028 DD 11/26/19	114.421
DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC 3.450% 11/01/2023 DD 11/05/13	113.586
CHARLES RIVER LABORATORIE 144A 4.250% 05/01/2028 DD 10/23/19	113.447
LEVEL 3 FINANCING INC 5.375% 08/15/2022 DD 11/15/14	112.665
PETRA DIAMONDS US TREASUR 144A 7.250% 05/01/2022 DD 04/12/17	112.472
OI EUROPEAN GROUP BV 144A 4.000% 03/15/2023 DD 12/12/17	112.194
NORTHWEST HARDWOODS INC 144A 7.500% 08/01/2021 DD 07/18/14	111.359
SM ENERGY CO 6.750% 09/15/2026 DD 09/12/16	109.131
NINE ENERGY SERVICE INC 144A 8.750% 11/01/2023 DD 10/25/18	108.241
LONESTAR RESOURCES AMERIC 144A 11.250% 01/01/2023 DD 01/04/18	106.403
IHO VERWALTUNGS GMBH REGS 3.875% 05/15/2027	105.634
TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.200% 07/18/2036 DD 07/18/06	105.550
SOUTHWESTERN ENERGY CO 7.750% 10/01/2027 DD 09/25/17	103.140
PARKER DRILLING CO	102.092
TRIANGLE USA PETROLEUM CO 144A 6.750% 07/15/2022 DD 07/18/14	100.757
MALLINCKRODT INTERNATIONA 144A 5.750% 08/01/2022 DD 08/13/14	100.445
ARENA LUXEMBOURG FINANCE REGS VAR RT 11/01/2023	100.394
NORTHWEST ACQUISITIONS UL 144A 7.125% 11/01/2022 DD 10/23/17	100.223
TRIDENT TPI HOLDINGS INC 144A 6.625% 11/01/2025 DD 10/17/17	100.223
L BRANDS INC 6.875% 11/01/2035 DD 10/30/15	99.666
SPRINT CORP 7.625% 03/01/2026 DD 02/22/18	98.245
JACK OHIO FINANCE LLC / J 144A 6.750% 11/15/2021 DD 11/08/16	98.138
SPRINT CORP 7.625% 02/15/2025 DD 02/24/15	97.759
L BRANDS INC 6.750% 07/01/2036 DD 06/16/16	97.717
COLFAX CORP 144A 6.375% 02/15/2026 DD 02/05/19	97.105
CHS/COMMUNITY HEALTH SYST 144A STEP 06/30/2023 DD 06/22/2018	96.882
TENET HEALTHCARE CORP 144A 6.250% 02/01/2027 DD 02/05/19	95.880
SUPERIOR PLUS LP / SUPERI 144A 7.000% 07/15/2026 DD 07/03/18	95.657
UNITED STATES STEEL CORP 6.250% 03/15/2026 DD 03/15/18	95.223
TRANSOCEAN INC 6.800% 03/15/2038 DD 12/11/07	94.878
PRIME SECURITY SERVICES B 144A 5.250% 04/15/2024 DD 04/04/19	94.254
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.875% 05/01/2027 DD 04/21/15	94.209

Naam	Waarde in euro's
SILVERSEA CRUISE FINANCE 144A 7.250% 02/01/2025 DD 01/30/17	94.209
FREEPORT-MCMORAN INC 4.550% 11/14/2024 DD 11/14/14	94.172
TRIUMPH GROUP INC 144A 6.250% 09/15/2024 DD 09/23/19	93.653
BEAZER HOMES USA INC 6.750% 03/15/2025 DD 03/14/17	93.541
ASCEND LEARNING LLC 144A 6.875% 08/01/2025 DD 07/12/17	93.541
KEHE DISTRIBUTORS LLC / K 144A 8.625% 10/15/2026 DD 09/16/19	93.318
REALOGY GROUP LLC / REALO 144A 9.375% 04/01/2027 DD 03/29/19	92.959
IAMGOLD CORP 144A 7.000% 04/15/2025 DD 03/16/17	92.816
WELLCARE HEALTH PLANS INC 5.250% 04/01/2025 DD 03/22/17	92.650
LADDER CAPITAL FINANCE HO 144A 5.250% 03/15/2022 DD 03/16/17	92.539
CARDTRONICS INC / CARDTRO 144A 5.500% 05/01/2025 DD 04/04/17	92.428
CENTRAL GARDEN & PET CO 5.125% 02/01/2028 DD 12/14/17	92.205
TRONOX INC 144A 6.500% 04/15/2026 DD 04/06/18	91.777
VICI PROPERTIES LP / VICI 144A 4.250% 12/01/2026 DD 11/26/19	91.759
JBS USA LUX SA / JBS USA 144A 5.875% 07/15/2024 DD 06/25/14	91.670
HILTON WORLDWIDE FINANCE LLC / 4.625% 04/01/2025 DD 03/16/17	91.537
AVOLON HOLDINGS FUNDING L 144A 3.625% 05/01/2022 DD 04/16/19	91.278
DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC 5.700% 10/15/2039 DD 10/08/09	91.203
MARRIOTT OWNERSHIP RESORT 144A 4.750% 01/15/2028 DD 10/01/19	91.203
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 4.750% 03/01/2030 DD 10/01/19	90.693
STATION CASINOS LLC 144A 5.000% 10/01/2025 DD 09/21/17	90.646
LAMAR MEDIA CORP 5.000% 05/01/2023 DD 10/30/12	90.646
SBA COMMUNICATIONS CORP 4.875% 07/15/2022 DD 01/15/15	90.200
AMC NETWORKS INC 4.750% 12/15/2022 DD 12/17/12	89.866
CHEMOURS CO/THE 7.000% 05/15/2025 DD 05/15/16	89.755
JACK OHIO FINANCE LLC / J 144A 6.750% 11/15/2021 DD 11/08/16	89.051
SESI LLC 7.750% 09/15/2024 DD 03/15/18	88.864
CHS/COMMUNITY HEALTH SYST 144A 8.000% 12/15/2027 DD 11/19/19	88.568
MATCH GROUP INC 144A 5.000% 12/15/2027 DD 12/04/17	88.229
ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.050% 04/01/2045 DD 11/12/14	87.973
GENWORTH HOLDINGS INC 4.800% 02/15/2024 DD 08/15/18	87.065
MARG ESC	86.758
JONES ENERGY II INC	86.606
UNITI GROUP LP / UNITI GR 144A 6.000% 04/15/2023 DD 04/24/15	85.523
ARROW BIDCO LLC 144A 9.500% 03/15/2024 DD 03/15/19	85.078
SOUTHWESTERN ENERGY CO 7.500% 04/01/2026 DD 09/25/17	82.405
WARRIOR MET COAL INC 144A 8.000% 11/01/2024 DD 11/02/17	82.285
JC PENNEY CORP INC 6.375% 10/15/2036 DD 04/27/07	78.396
KB HOME 7.625% 05/15/2023 DD 02/17/15	74.833

Naam	Waarde in euro's
MATCH GROUP INC 144A 5.000% 12/15/2027 DD 12/04/17	74.298
MICRON TECHNOLOGY INC 4.975% 02/06/2026 DD 02/06/19	74.186
MGIC INVESTMENT CORP 5.750% 08/15/2023 DD 08/05/16	73.831
TARGA RESOURCES PARTNERS 144A 6.500% 07/15/2027 DD 01/17/19	73.163
SEALED AIR CORP 144A 5.125% 12/01/2024 DD 11/24/14	71.993
TRANSOCEAN INC VAR RT 12/15/2041 DD 12/05/11	71.715
VIKING CRUISES LTD 144A 5.875% 09/15/2027 DD 09/20/17	71.409
NAVIENT CORP 5.500% 01/25/2023 DD 01/28/13	71.325
HCA INC 4.125% 06/15/2029 DD 06/12/19	70.896
LAMAR MEDIA CORP 5.750% 02/01/2026 DD 08/01/16	70.817
NUSTAR LOGISTICS LP 6.000% 06/01/2026 DD 05/22/19	70.657
TALEN ENERGY SUPPLY LLC 144A 7.250% 05/15/2027 DD 05/21/19	70.303
GFL ENVIRONMENTAL INC 144A 5.125% 12/15/2026 DD 12/16/19	70.248
COMMERCIAL METALS CO 5.375% 07/15/2027 DD 07/11/17	70.156
ASCEND LEARNING LLC 144A 6.875% 08/01/2025 DD 02/01/19	70.156
SCRIPPS ESCROW INC 144A 5.875% 07/15/2027 DD 07/26/19	69.989
NEXTERA ENERGY OPERATING 144A 4.500% 09/15/2027 DD 09/25/17	69.655
FIRST QUALITY FINANCE CO 144A 5.000% 07/01/2025 DD 06/27/17	69.516
PARKER DRILLING 3/19 2ND LIEN PIK TL	69.505
PARSLEY ENERGY LLC / PARS 144A 6.250% 06/01/2024 DD 05/27/16	69.488
GRAY TELEVISION INC 144A 5.125% 10/15/2024 DD 09/14/16	69.321
CASCADES INC/CASCADES USA 144A 5.125% 01/15/2026 DD 11/26/19	68.653
MALLINCKRODT INTERNATIONAL 144A 4.875% 04/15/2020 DD 04/15/15	68.597
CIT GROUP INC 4.125% 03/09/2021 DD 03/09/18	68.075
SHEA HOMES LP / SHEA HOME 144A 5.875% 04/01/2023 DD 03/23/15	68.068
NOKIA OYJ 3.375% 06/12/2022 DD 06/12/17	67.650
FLEX ACQUISITION CO INC 144A 6.875% 01/15/2025 DD 01/17/17	67.316
LEVEL 3 FINANCING INC 5.125% 05/01/2023 DD 09/01/15	67.233
NIELSEN FINANCE LLC / NIE 144A 5.000% 04/15/2022 DD 04/11/14	67.066
ANTERO RESOURCES CORP 5.000% 03/01/2025 DD 03/01/17	66.815
ALLIANCE DATA SYSTEMS COR 144A 4.750% 12/15/2024 DD 12/20/19	66.648
CLEAVER-BROOKS INC 144A 7.875% 03/01/2023 DD 12/11/17	66.648
HECLA MINING CO 6.875% 05/01/2021 DD 11/01/13	66.598
NABORS INDUSTRIES INC 4.625% 09/15/2021 DD 08/23/11	66.398
RACKSPACE HOSTING INC 144A 8.625% 11/15/2024 DD 11/03/16	65.312
ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.400% 04/01/2024 DD 03/19/14	64.817
L BRANDS INC 5.250% 02/01/2028 DD 01/23/18	63.307
WEATHERFORD INTERNATIONAL 144A 11.000% 12/01/2024 DD 12/13/19	59.722
CHEMOURS CO/THE 5.375% 05/15/2027 DD 05/23/17	59.131

Naam	Waarde in euro's
RHP HOTEL PROPERTIES LP / RHP 5.000% 04/15/2023 DD 04/14/15	59.065
TALEN ENERGY SUPPLY LLC 6.500% 06/01/2025 DD 12/01/15	57.001
EXTRACTION OIL & GAS INC 144A 7.375% 05/15/2024 DD 08/01/17	55.679
CALFRAC HOLDINGS LP 144A 8.500% 06/15/2026 DD 05/30/18	54.788
NOBLE HOLDING INTERNATIONAL LT 7.750% 01/15/2024 DD 12/28/16	51.834
INGLES MARKETS INC 5.750% 06/15/2023 DD 06/12/13	51.732
QUEBECOR MEDIA INC 5.750% 01/15/2023 DD 12/15/12	48.385
MICRON TECHNOLOGY INC 4.640% 02/06/2024 DD 02/06/19	48.343
NAVIENT CORP 6.500% 06/15/2022 DD 03/07/17	48.274
CLEAN HARBORS INC 144A 5.125% 07/15/2029 DD 07/02/19	47.777
BASIC ENERGY SERVICES INC 144A 10.750% 10/15/2023 DD 10/02/18	47.773
WPX ENERGY INC 5.750% 06/01/2026 DD 05/23/18	47.550
DISH DBS CORP 6.750% 06/01/2021 DD 05/05/11	46.880
SPRINGLEAF FINANCE CORP 8.250% 12/15/2020 DD 04/11/16	46.737
XPLOARNET COMMUNICATIONS I 144A 9.625% 06/01/2022 DD 05/31/17	46.675
HOLLY ENERGY PARTNERS LP 144A 6.000% 08/01/2024 DD 07/19/16	46.437
PRESTIGE BRANDS INC 144A 6.375% 03/01/2024 DD 02/19/16	46.325
CHURCHILL DOWNS INC 144A 4.750% 01/15/2028 DD 12/27/17	45.991
HERTZ CORP/THE 144A 5.500% 10/15/2024 DD 09/22/16	45.657
CALLON PETROLEUM CO 8.250% 07/15/2025 DD 07/14/17	45.546
OUTFRONT MEDIA CAPITAL LL 144A 4.625% 03/15/2030 DD 11/18/19	45.323
CINEMARK USA INC 4.875% 06/01/2023 DD 05/24/13	45.267
CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDING 5.250% 09/30/2022 DD 08/22/12	45.045
ASCENT RESOURCES UTICA HO 144A 10.000% 04/01/2022 DD 04/05/17	44.304
SM ENERGY CO 5.000% 01/15/2024 DD 01/15/14	42.428
WHITING PETROLEUM CORP 5.750% 03/15/2021 DD 09/12/13	42.138
LBI COMMERCIAL PAPER 0.000% 12/12/2031 DD 04/01/09	40.560
SANCHEZ ENERGY CORP 7.750% 06/15/2021 DD 06/15/14	36.080
ANTERO RESOURCES CORP 5.625% 06/01/2023 DD 12/01/15	35.746
FIRST QUANTUM MINERALS LT 144A 7.000% 02/15/2021 DD 02/12/14	29.472
SANCHEZ ENERGY CORP 6.125% 01/15/2023 DD 01/15/15	29.065
NOBLE HOLDING INTERNATIONAL LT 6.200% 08/01/2040 DD 07/26/10	25.390
NAVIENT CORP 6.125% 03/25/2024 DD 03/27/14	24.165
CCO HOLDINGS LLC / CCO HO 144A 5.375% 06/01/2029 DD 05/23/19	23.831
INTELSAT JACKSON HOLDINGS 144A 8.000% 02/15/2024 DD 03/29/16	22.856
NAVIENT CORP 5.000% 10/26/2020 DD 11/06/14	22.599
NIELSEN FINANCE LLC / NIELSEN 4.500% 10/01/2020 DD 04/01/13	22.300
PDC ENERGY INC 5.750% 05/15/2026 DD 05/15/18	22.216
K HOVNANIAN ENTERPRISES I 144A 13.500% 02/01/2026 DD 02/01/18	20.846

Naam	Waarde in euro's
WINDSTREAM SERVICES LLC / WIND 7.750% 10/15/2020 DD 10/06/10	20.267
GEO GROUP INC/THE 5.875% 10/15/2024 DD 09/25/14	20.267
GEO GROUP INC/THE 6.000% 04/15/2026 DD 04/18/16	19.766
MATTEL INC 5.450% 11/01/2041 DD 11/08/11	18.820
JACK OHIO FINANCE LLC / J 144A 6.750% 11/15/2021 DD 11/08/16	17.265
WILLIAM LYON HOMES INC 7.000% 08/15/2022 DD 08/11/14	16.969
MWO HOLDINGS LLC	16.886
MCDERMOTT TECHNOLOGY AMER 144A 10.625% 05/01/2024 DD 04/18/18	13.252
NEWARK EXP LIT	10.153
NEWARK IND ESC	10.153
EP ENERGY LLC / EVEREST A 144A 9.375% 05/01/2024 DD 01/03/18	9.318
K HOVNANIAN ENTERPRISES I 144A 5.000% 02/01/2040 DD 02/01/18	8.802
BNP PARIBAS USD INSTICASH PD	7.866
CLOUD PEAK ENERGY RESOURCES LL 6.375% 03/15/2024 DD 03/11/14	2.121
EP ENERGY LLC / EVEREST ACQUIS 9.375% 05/01/2020 DD 11/01/12	579
ESCROW GCB144A TEXAS COMPETIT 11.500% 10/01/2020 DD 04/19/11	441
EURONAV NV	257
JONES ENERGY II INC WRT EXP 05/17/2024	190
CHC GROUP LLC	67
MURRAY ENERGY CORP 144A 12.000% 04/15/2024 DD 06/29/18	14
BERLIN PACKAGING 5/18 COV-LITE 0.000% 11/07/2025 DD 04/19/18	1
AKZONOBEL SPECIALTY CHEMICALS 0.000% 10/01/2025 DD 09/06/18	-
Totaal waarde in euro's	2.193.343.929

2.5. Achmea IM Emerging Markets Equity Fund

TABEL 2.5.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
BlackRock MSCI Emerging Markets Free B	49.710.009
iShares Emerging Markets Index Fund (IE)	22.247.636
Totaal waarde in euro's	71.957.645

2.6. Achmea IM Commodity Fund EUR hedged

TABEL 2.6.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
Achmea IM Euro Money Market Fund	34.705.612
France (Govt Of) 0% 25/02/2020	27.736.602
Totaal waarde in euro's	62.442.213

2.7. Achmea IM Global Real Estate Equity Fund

TABEL 2.7.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
iShares Developed Real Estate Index Fund (IE)	69.927.121
Totaal waarde in euro's	69.927.121

2.8. Achmea IM (LC) Emerging Markets Debt Fund

TABEL 2.8.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
Investec Emerging Markets LC Dynamic Debt Fund	45.346.059
L&G EM Government Bond (Local Currency) Index Fund	41.559.566
Totaal waarde in euro's	86.905.625

2.9. Achmea IM Euro Local Government Loans Fund

TABEL 2.9.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
Freien Hansestadt Bremen	300.000.000
Stadt Koeln	236.000.000
Land Rheinland-Pfalz	200.000.000
Stadt Mönchengladbach	180.000.000
Stadt Bonn	168.300.000
Landeshauptstadt Kiel	105.526.101
Gemeente Amsterdam	100.000.000
Munchen	75.000.000
Stadt Witten	71.000.000
Gemeente Horst	65.000.000
Gemeente Rotterdam	54.000.000
REPOREV_ING BANK_NETHER.7500JUL27_07/02/2020	53.730.062
Landeshauptstadt Mainz	52.800.000
Hannover	51.195.339
Sachsen-Anhalt	50.000.000
Stadt Krefeld	50.000.000
Stadt Oldenburg	42.351.565
Gemeente Nissewaard	40.000.000
Stadt Neuwied	40.000.000
Stadt Velbert	35.000.000
Gemeente Zwolle	34.000.000
Gemeente Rijswijk	30.000.000
Stadt Schwerin	30.000.000
STADT BERGISCHE GLADBACH	25.312.000
Gemeente Veenendaal	20.000.000
Stadt Alsdorf	20.000.000
Stadt Gelsenkirchen	20.000.000
Stadt Salzgitter	17.299.921
Gemeente Goes	15.000.000
Gemeente Overbetuwe	12.000.000
Gemeente Zaanstad	12.000.000
Stadt Ennepetal	12.000.000
Stadt Werdohl	11.000.000
Gemeente Heerde	10.000.000
Gemeente Hoogeveen	10.000.000
Gemeinde Engelskirchen	10.000.000
Kreisstadt Neunkirchen	10.000.000

Naam		Waarde in euro's
Gemeente Soest		9.700.000
Stadt Menden		8.796.444
Gemeente Stadskanaal		8.500.000
Gemeente Boxtel		4.000.000
Stadt Rüsselsheim am Main		4.000.000
Stadtverwaltung Pirmasens		4.000.000
Gemeente Lisse		2.000.000
Stadt Datteln		1.357.200
Totaal waarde in euro's		2.310.868.633

2.10. Achmea IM Euro Green Bond Fund

TABEL 2.10.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT 144A 1.750% 06/25/2039	15.004.000
KINGDOM OF BELGIUM GOVERNMENT REGS 1.250% 04/22/2033	4.256.304
AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT REGS 1.375% 09/17/2024	4.062.739
KREDITANSTALT FUER WIEDERERBAU REGS 0.010% 05/05/2027	4.021.498
NETHERLANDS GOVERNMENT BO 144A 0.500% 01/15/2040	3.970.924
NRW BANK REGS 0.875% 11/10/2025	3.286.041
EUROPEAN INVESTMENT BANK REGS 0.375% 05/15/2026	2.687.119
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP REGS 0.000% 07/21/2021	2.506.760
CITIGROUP INC REGS 0.500% 01/29/2022	2.022.312
SNCF RESEAU REGS 1.000% 11/09/2031	2.004.116
APPLE INC 0.000% 11/15/2025	1.989.372
ELECTRICITE DE FRANCE SA REGS 1.000% 10/13/2026	1.878.566
TELEFONICA EMISIONES SA REGS 1.069% 02/05/2024	1.864.260
EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.125% 11/15/2032	1.664.601
SSE PLC REGS 0.875% 09/06/2025	1.640.276
ABN AMRO BANK NV REGS 0.500% 04/15/2026	1.620.221
SOCIETE DU GRAND PARIS EP REGS 1.125% 05/25/2034	1.607.830
BERLIN HYP AG REGS 0.010% 07/19/2027	1.597.118
KOMMUNEKREDIT REGS 0.750% 05/18/2027	1.579.200
LG CHEM LTD REGS 0.500% 04/15/2023	1.561.697
BNP PARIBAS SA REGS VAR RT 06/04/2026	1.502.733
CREDIT AGRICOLE SA REGS 0.375% 10/21/2025	1.494.207
INNOGY FINANCE BV REGS 1.250% 10/19/2027	1.471.695
SNCF RESEAU REGS 0.875% 01/22/2029	1.460.182
DANSKE BANK A/S REGS 1.625% 03/15/2024	1.458.242
CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL 0.830% 07/02/2031	1.419.110
NORDEA BANK ABP REGS 0.375% 05/28/2026	1.403.116
SOCIETE DU GRAND PARIS EP REGS 1.125% 10/22/2028	1.399.935
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL REGS 0.980% 10/09/2023	1.335.814
ENGIE SA REGS 0.500% 10/24/2030	1.277.709
TENNET HOLDING BV REGS 1.500% 06/03/2039	1.264.145
BERLIN HYP AG REGS 0.625% 10/22/2025	1.249.373
ING GROEP NV REGS 2.500% 11/15/2030	1.178.880
SNCF RESEAU REGS 2.250% 12/20/2047	1.120.642
IRELAND GOVERNMENT BOND REGS 1.350% 03/18/2031	1.118.699
IBERDROLA FINANZAS SA REGS 1.250% 10/28/2026	1.060.434
INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION 0.625% 11/22/2027	1.052.620

Naam	Waarde in euro's
TENNET HOLDING BV REGS 0.750% 06/26/2025	1.028.293
NATIONAL AUSTRALIA BANK L REGS 0.625% 08/30/2023	1.019.035
LANDESBANK BADEN-WUERTTEM REGS 0.125% 06/27/2023	1.012.304
INTESA SANPAOLO SPA REGS 0.750% 12/04/2024	1.003.884
WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LOND 0.300% 06/25/2024	1.001.831
LANDESBANK BADEN-WUERTTEM REGS 0.375% 05/24/2024	1.000.136
ENEL FINANCE INTERNATIONA REGS 0.375% 06/17/2027	986.343
EUROFIMA REGS 0.250% 02/09/2024	914.633
EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTI 0.000% 01/10/2024	908.732
IBERDROLA INTERNATIONAL B REGS 1.125% 04/21/2026	841.574
ENGIE SA REGS 1.375% 06/21/2039	825.568
BNP PARIBAS SA REGS 1.000% 04/17/2024	823.718
ENGIE SA REGS 0.375% 06/21/2027	800.704
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGE REGS 1.375% 05/14/2025	735.161
EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.500% 11/15/2047	732.344
BARCLAYS PLC REGS VAR RT 11/14/2023	706.062
SOUTHERN POWER CO 1.850% 06/20/2026	650.957
PROLOGIS INTERNATIONAL FU REGS 1.750% 03/15/2028	638.462
ADIF - ALTA VELOCIDAD REGS 0.950% 04/30/2027	622.627
ADIF - ALTA VELOCIDAD REGS 0.800% 07/05/2023	616.188
ENBW ENERGIE BADEN-WUERTT REGS VAR RT 11/05/2079	604.247
MUNICIPALITY FINANCE PLC REGS 0.050% 09/06/2029	595.398
SNCF RESEAU REGS 0.750% 05/25/2036	593.516
EDP FINANCE BV REGS 0.375% 09/16/2026	591.284
CPPIB CAPITAL INC 0.875% 06-FEB-2029	581.488
TENNET HOLDING BV REGS 2.000% 06/05/2034	573.411
PROLOGIS INTERNATIONAL FU REGS 2.375% 11/14/2030	568.049
EDP FINANCE BV REGS 1.875% 10/13/2025	540.168
IREN SPA REGS 1.950% 09/19/2025	538.522
ENGIE SA REGS 1.375% 02/28/2029	538.170
IBERDROLA FINANZAS SA REGS 1.250% 09/13/2027	532.796
LA BANQUE POSTALE SA REGS 1.375% 04/24/2029	525.546
VESTEDA FINANCE BV REGS 1.500% 05/24/2027	521.686
CGNPC INTERNATIONAL LTD REGS 1.625% 12/11/2024	518.284
BNP PARIBAS SA REGS 1.125% 08/28/2024	516.881
MIZUHO FINANCIAL GROUP IN REGS 0.956% 10/16/2024	514.137
CREDIT AGRICOLE SA/LONDON REGS 0.750% 12/05/2023	512.657
SOUTHERN POWER CO 1.000% 06/20/2022	511.384
STOCKLAND TRUST REGS 1.500% 11/03/2021	510.900

Naam	Waarde in euro's
NATIONAL AUSTRALIA BANK L REGS 0.350% 09/07/2022	505.084
REGIE AUTONOME DES TRANSP REGS 0.350% 06/20/2029	501.258
FCC SERVICIOS MEDIO AMBIE REGS 1.661% 12/04/2026	498.320
BPCE SA REGS 0.125% 12/04/2024	497.393
STEDIN HOLDING NV REGS 0.500% 11/14/2029	492.369
NEDERLANDSE WATERSCHAPSBA REGS 0.000% 10/02/2034	463.616
LA POSTE SA REGS 1.450% 11/30/2028	429.418
LEASEPLAN CORP NV REGS 1.375% 03/07/2024	413.827
ENGIE SA REGS VAR RT 12/31/2049	403.495
E.ON SE REGS 0.000% 08/28/2024	395.113
RAIFFEISEN BANK INTERNATI REGS 0.375% 09/25/2026	394.581
TENNET HOLDING BV REGS 1.250% 10/24/2033	313.805
NRW BANK REGS 0.625% 02/02/2029	313.783
UNIONE DI BANCHE ITALIANE REGS 1.500% 04/10/2024	306.390
ENBW ENERGIE BADEN-WUERTT REGS VAR RT 08/05/2079	301.989
INDUSTRIAL & COMMERCIAL B REGS 0.250% 04/25/2022	299.561
ENBW INTERNATIONAL FINANC REGS 1.875% 10/31/2033	229.706
TENNET HOLDING BV REGS 1.875% 06/13/2036	227.449
TENNET HOLDING BV REGS 1.750% 06/04/2027	220.914
ROYAL SCHIPHOL GROUP NV REGS 1.500% 11/05/2030	218.781
DIGITAL EURO FINCO LLC REGS 2.500% 01/16/2026	217.448
ASSICURAZIONI GENERALI SP REGS 2.124% 10/01/2030	207.214
ORSTED A/S REGS VAR RT 12/09/3019	201.632
CNP ASSURANCES REGS VAR RT 07/27/2050	201.391
KOMMUNEKREDIT REGS 0.625% 11/21/2039	197.706
E.ON SE REGS 0.350% 02/28/2030	143.733
EUROPEAN INVESTMENT BANK REGS 1.000% 11/14/2042	109.322
Waarde van de Futures	17.310

Totaal waarde in euro's

119.072.178

2.11. Achmea IM Global Inflation Linked Bond Fund EUR hedged

TABEL 2.11.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
Tsy I/L Gilt .1250% 22/11/2056	4.603.638
United States Treasury IL Bonds 2,375% 15/01/2025	4.069.071
Tsy Infl Ix N/B .1250% 15/07/2022	2.819.275
Tsy 0 1/8% 2036 I/L Gilt .1250% 22/11/2036	2.187.253
Tsy infl ix n/b .6250% 15/04/2023	1.968.817
Tsy Infl Ix N/B 2.125% 15/02/2040	1.765.357
United States Treasury IL Bonds 1,75% 15/01/2028	1.705.958
Tsy 0 1/8% 2048 i/l gilt .1250% 10/08/2048	1.641.284
Tsy Infl Ix N/B .8750% 15/02/2047	1.549.618
Tsy Infl Ix N/B .6250% 15/01/2024	1.316.637
Tsy 0 1/8 i/l Gilt .1250% 10/08/2041	1.205.780
Tsy 0 1/8% 2028 i/l gilt .1250% 10/08/2028	1.066.489
Tsy Infl Ix N/B .3750% 15/07/2027	929.555
United States Treasury IL Bonds 3,875% 15/04/2029	894.229
United States Treasury IL Bonds 2,375% 15/01/2027	866.257
TSY 1 1/4% 2032 I/L Gilt 1.250% 22/11/2032	858.390
United States Treasury IL Bonds 2,5% 15/01/2029	849.823
Tsy Infl Ix N/B .1250% 15/01/2022	840.535
Tsy 0 1/8% 2024 I/L Gilt .1250% 22/03/2024	782.662
Tsy 1 7/8% 2022 i/l gilt 1.875% 22/11/2022	747.477
Tsy Infl Ix N/B .3750% 15/01/2027	703.644
Japan Govt cpi Linked .1000% 10/03/2027	650.441
Tsy Infl Ix N/B .8750% 15/01/2029	607.669
Tsy 0 3/4% 2034 I/L Gilt .7500% 22/03/2034	606.998
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.10% 15/09/2026	535.332
Tsy Infl Ix N/b .1250% 15/04/2022	517.942
Buoni Poliennali Del Tes .1000% 15/05/2023	470.973
Tsy infl ix n/b 1.000% 15/02/2049	460.105
Tsy Infl Ix N/b .7500% 15/02/2045	414.823
France Government Bond OAT 3,15% 25/07/2032	405.161
United States Treasury IL Bonds 3,625% 15/04/2028	399.179
Tsy 0 1/8% 2026 I/L Gilt .1250% 22/03/2026	386.559
France Government Bond OAT 2,1% 25/07/2023	384.854
Buoni Poliennali Del Tes 1.250% 15/09/2032	367.860
Australian Government 3.000% 20/09/2025	365.570
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,35% 15/09/2035	344.722
France (Govt of) .2500% 25/07/2024	344.352

Naam	Waarde in euro's
Tsy infl ix n/b .2500% 15/07/2029	335.008
Canadian Government Rrb 2.000% 01/12/2041	302.217
Tsy Infl ix N/B .6250% 15/01/2026	298.411
France Government Bond OAT 3,4% 25/07/2029	295.732
France (govt of) .1000% 25/07/2047	295.064
Japan govt cpi linked .1000% 10/03/2028	294.453
Canadian Government Rrb 4.000% 01/12/2031	293.359
Tsy Infl IX N/B .1250% 15/07/2024	291.498
Spain I/L Bond 1.000% 30/11/2030	290.984
France (Govt of) .7000% 25/07/2030	290.489
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,1% 15/09/2021	279.514
Japan Govt CPI Linked .1000% 10/03/2024	269.516
Swedish Government .7500% 12/05/2028	262.174
France Government Bond OAT 1,8% 25/07/2040	252.811
Spain I/L Bond 1.800% 30/11/2024	246.391
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,55% 15/09/2041	240.432
France Government Bond OAT 1,1% 25/07/2022	237.169
Buoni Poliennali Del Tes 2.350% 15/09/2024	225.674
Deutschland IL Bond .1000% 15/04/2046	220.615
Buoni Poliennali del Tes .1000% 15/05/2022	214.169
Tsy Infl ix N/B .6250% 15/07/2021	205.794
France (Govt Of) .1000% 01/03/2025	205.318
New Zealand Index Linked 2.500% 20/09/2035	200.719
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,6% 15/09/2023	199.868
Tsy Infl ix N/B 1.250% 15/07/2020	197.305
Spain I/L Bond .6500% 30/11/2027	187.131
France (Govt Of) .1000% 01/03/2028	157.818
Japan govt cpi linked .1000% 10/03/2029	152.428
FXF-EUR/USD-20200204	151.762
Australian Government 2.000% 21/08/2035	135.556
United States Treasury IL Bonds 3,375% 15/04/2032	133.222
Spain i/l bond .1500% 30/11/2023	118.973
France (Govt Of) .1000% 25/07/2036	118.161
TSY 0 1/8% 2044 i/l gilt .1250% 22/03/2044	102.474
Buoni poliennali del tes .4000% 15/05/2030	99.505
Spain i/l bond .7000% 30/11/2033	97.457
Denmark I/L Govt Bond .1000% 15/11/2030	96.210
Canadian Government Rrb .5000% 01/12/2050	67.651
France (govt of) .1000% 01/03/2029	55.732

Naam	Waarde in euro's	
Canadian Government Rrb 1.250% 01/12/2047		51.390
Australian Government 1.000% 21/02/2050		30.320
FXF-USD/JPY-20200204		9.392
FXF-USD/JPY-20200106		6.368
FXF-EUR/SEK-20200204		2.143
FXF-EUR/NZD-20200204		-265
FXF-EUR/AUD-20200204		-1.192
FXF-EUR/CAD-20200204		-1.748
FXF-EUR/JPY-20200204		-2.326
FXF-USD/JPY-20200106		-9.633
FXF-EUR/GBP-20200204		-72.993
Totaal waarde in euro's		48.764.515

2.12. Achmea IM Global Multi Factor Equity Fund EUR hedged

TABEL 2.12.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
Achmea IM Global Multi Factor Equity Fund	238.280.277
FXF-EUR/JPY-20200205	111.536
FXF-EUR/JPY-20200205	89.575
FXF-EUR/USD-20200204	76.534
FXF-EUR/USD-20200204	31.243
FXF-EUR/USD-20200204	26.614
FXF-EUR/USD-20200204	20.002
FXF-EUR/USD-20200204	15.804
FXF-EUR/USD-20200204	5.488
FXF-EUR/JPY-20200205	4.989
FXF-EUR/JPY-20200205	4.889
FXF-EUR/GBP-20200204	1.754
FXF-EUR/CAD-20200204	920
FXF-EUR/AUD-20200204	56
FXF-EUR/SGD-20200204	-75
FXF-EUR/GBP-20200204	-171
FXF-EUR/USD-20200204	-173
FXF-EUR/HKD-20200204	-435
FXF-EUR/CHF-20200204	-1.279
FXF-EUR/AUD-20200204	-1.415
FXF-EUR/CHF-20200204	-1.548
FXF-EUR/AUD-20200204	-1.700
FXF-EUR/CAD-20200204	-2.018
FXF-EUR/SEK-20200204	-4.007
FXF-EUR/HKD-20200204	-9.273
FXF-EUR/SGD-20200204	-9.763
FXF-EUR/SEK-20200204	-48.850
FXF-EUR/AUD-20200204	-87.654
FXF-EUR/CHF-20200204	-91.973
FXF-EUR/CAD-20200204	-110.216
FXF-EUR/GBP-20200204	-259.086
Totaal waarde in euro's	238.040.050

2.13. Achmea IM Global Real Estate Equity Fund EUR hedged

TABEL 2.13.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
Achmea IM Global Real Estate Equity Fund	50.373.197
FXF-EUR/JPY-20200205	58.017
FXF-EUR/USD-20200204	20.053
FXF-EUR/USD-20200204	17.590
FXF-EUR/JPY-20200205	3.574
FXF-EUR/USD-20200204	2.001
FXF-EUR/SEK-20200204	357
FXF-EUR/SEK-20200204	127
FXF-EUR/HKD-20200204	13
FXF-EUR/JPY-20200205	8
FXF-EUR/SGD-20200204	0
FXF-EUR/CHF-20200204	-1
FXF-EUR/SGD-20200204	-13
FXF-EUR/CAD-20200204	-24
FXF-EUR/USD-20200204	-31
FXF-EUR/GBP-20200204	-63
FXF-EUR/GBP-20200204	-126
FXF-EUR/CHF-20200204	-165
FXF-EUR/CAD-20200204	-185
FXF-EUR/CHF-20200204	-221
FXF-EUR/CAD-20200204	-244
FXF-EUR/SEK-20200204	-354
FXF-EUR/HKD-20200204	-537
FXF-EUR/SGD-20200204	-561
FXF-EUR/AUD-20200204	-615
FXF-EUR/JPY-20200205	-623
FXF-EUR/HKD-20200204	-1.063
FXF-EUR/AUD-20200204	-1.620
FXF-EUR/USD-20200204	-2.846
FXF-EUR/GBP-20200204	-4.078
FXF-EUR/CHF-20200204	-6.810
FXF-EUR/HKD-20200204	-9.447
FXF-EUR/SGD-20200204	-12.904
FXF-EUR/CAD-20200204	-18.803
FXF-EUR/SEK-20200204	-23.074
FXF-EUR/AUD-20200204	-27.595
FXF-EUR/GBP-20200204	-41.783

Naam	Waarde in euro's
Totaal waarde in euro's	50.321.152

2.14. Achmea IM 20 Year Overlay Fund

TABEL 2.14.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
Achmea IM Euro Local Government Loans Fund	68.147.749
Netherlands Government 0% 15/01/2022	67.068.914
C-IRS JP LCH Receive 1,55 09/03/2038	22.487.787
420769_Fixed/Float_EUR_20380309	21.416.940
C-IRS BA LCH Receive 1,09 18/04/2039	11.121.249
C-IRS JP LCH Receive 1,064 24/04/2039	9.115.995
C-IRS BN LCH Receive 1,1 23/04/2039	8.763.749
421104_Fixed/Float_EUR_20371003	4.098.861
C-IRS BA LCH Receive 1,4663 16/11/2038	3.416.183
C-IRS BA LCH Receive 0,9788 02/04/2039	3.060.681
C-IRS BA LCH Receive 1,0068 26/04/2039	2.126.642
C-IRS BN LCH Receive 1,084 18/04/2039	1.263.067
Beleggingspool Achmea Liquiditeiten Euro	593.237
C-IRS DB LCH Receive 1,4413 04/04/2038	509.613
C-IRS BA LCH Receive 1,4773 02/10/2038	504.749
C-IRS JP LCH Receive 0,4118 22/10/2039	-601.000
C-IRS JP LCH Pay 1,3447 14/01/2039	-2.170.359
C-IRS BN LCH Receive 0,1888 02/10/2039	-2.211.321
C-IRS JP LCH Pay 1,4287 25/07/2038	-4.273.659
C-IRS BN LCH Pay 1,436 25/07/2038	-4.309.712
Totaal waarde in euro's	210.129.365

2.15. Achmea IM 30 Year Overlay Fund

TABEL 2.15.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
Achmea IM Euro Local Government Loans Fund	132.777.592
Netherlands Government 0% 15/01/2022	125.134.611
C-IRS JP LCH Receive 1,59 09/03/2048	28.229.776
421193_Fixed/Float_EUR_20480309	22.422.412
C-IRS BA LCH Receive 1,19 23/04/2049	16.617.143
C-IRS JP LCH Receive 1,14 24/04/2049	6.076.687
C-IRS BA LCH Receive 1,07 02/04/2049	3.556.997
C-IRS JP LCH Receive 1,181 23/04/2049	2.781.494
C-IRS JP LCH Receive 1,5358 02/10/2048	2.727.138
Beleggingspool Achmea Liquiditeiten Euro	2.371.848
C-IRS BN LCH Receive 1,0838 26/04/2049	2.280.316
C-IRS DB LCH Receive 0,725 02/07/2049	2.190.138
C-IRS BN LCH Receive 1,2 23/04/2049	1.875.689
C-IRS BA LCH Receive 0,4378 21/10/2049	-955.095
C-IRS BN LCH Receive 0,453 18/10/2049	-1.480.397
C-IRS JP LCH Receive 0,425 21/10/2049	-1.718.110
C-IRS BA LCH Receive 0,55 02/08/2049	-1.755.028
C-IRS BN LCH Receive 0,56 02/08/2049	-3.223.246
C-IRS DB LCH Pay 1,4852 27/07/2048	-5.815.517
Totaal waarde in euro's	334.094.448

2.16. Achmea IM 40 Year Overlay Fund

TABEL 2.16.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
Netherlands Government 0% 15/01/2022	46.482.906
Achmea IM Euro Local Government Loans Fund	45.648.587
C-IRS BN LCH Receive 1,609 09/03/2058	15.539.149
421192_Fixed/Float_EUR_20570922	10.461.109
C-IRS BA LCH Receive 1,46 03/07/2058	6.837.468
C-IRS BA LCH Receive 1,131 24/04/2059	4.192.652
C-IRS BA LCH Receive 1,5103 16/11/2058	2.660.228
C-IRS BA LCH Receive 1,5273 02/10/2058	2.024.705
Beleggingspool Achmea Liquiditeiten Euro	1.946.043
C-IRS BA LCH Receive 1,63 03/10/2057	1.089.020
C-IRS BN LCH Receive 1,4738 04/04/2058	626.782
421191_Fixed/Float_EUR_20590402	-175.773
C-IRS BN LCH Receive 0,4035 22/10/2059	-728.401
C-IRS BA LCH Receive 0,3815 21/10/2059	-1.071.154
C-IRS BN LCH Receive 0,401 18/10/2059	-1.477.950
C-IRS DB LCH Pay 1,4837 27/07/2058	-3.039.771
C-IRS DB LCH Receive 0,055 03/09/2059	-7.056.195
Totaal waarde in euro's	123.959.405

2.17. Achmea IM 50 Year Overlay Fund

TABEL 2.17.1 SPECIFICATIE BELEGGINGEN PER 31-12-2019

Naam	Waarde in euro's
Achmea IM Euro Local Government Loans Fund	41.710.060
Netherlands Government 0% 15/01/2022	34.394.315
421214_Fixed/Float_EUR_20690607	3.631.298
C-IRS BNP CC LCH CLEARNET Long 0.83 07/06/2069	2.776.340
C-IRS JPMORG LCH CLEARNET Long 0.85 07/06/2069	2.460.600
C-IRS JP LCH Receive 1,17 23/04/2069	1.744.242
Beleggingspool Achmea Liquiditeiten Euro	1.059.999
421105_Fixed/Float_EUR_20681116	469.309
C-IRS BN LCH Receive 1,0568 26/04/2069	288.552
C-IRS BN LCH Receive 0,3265 21/10/2069	-627.156
C-IRS JP LCH Receive 0,351 22/10/2069	-653.622
C-IRS BN LCH Receive 0,3498 18/10/2069	-658.560
C-IRS JP LCH Receive 0,347 22/10/2069	-669.766
Totaal waarde in euro's	81.688.539

3. Kosten vermogensbeheer overzichten

Deze bijlagen zijn geen onderdeel van de Controleverklaring van de onafhankelijke accountant.

3.1. Achmea IM Euro Government Bond Fund

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.1.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen				
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden		213.037		213.037
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay		213.037		213.037
5.9	Kosten overlay beleggingen		93		93
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay		213.130		213.130
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	377.734			377.734
5.12	Servicekosten	162.025			162.025
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	539.759			539.759
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				752.889

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.4: Transactiekosten vastrentende waarden zijn geschat op basis van de gemiddelde bied-laait spread.

5.11: Kosten vermogensbeheer.

5.12: De Servicekosten dekken onder andere de volgende kosten: kosten van de Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,167% .
Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,133%.

3.2. Achmea IM Euro Investment Grade Credit Fund

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.2.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen				
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden		785.704		785.704
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay		785.704		785.704
5.9	Kosten overlay beleggingen				
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay		785.704		785.704
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	553.076			553.076
5.12	Servicekosten	146.917			146.917
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	699.993			699.993
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				1.485.697

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.4: Transactiekosten vastrentende waarden zijn geschat op basis van de gemiddelde bied-laait spread.

5.11: Kosten vermogensbeheer.

5.12: De Servicekosten dekken onder andere de volgende kosten: kosten van de Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,360% .
Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,207%.

3.3. Achmea IM Global Multi Factor Equity Fund

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.3.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen		126.354		126.354
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden				
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay		126.354		126.354
5.9	Kosten overlay beleggingen		4.022		4.022
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay		130.376		130.376
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	502.623			502.623
5.12	Servicekosten	233.416			233.416
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	736.039			736.039
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				866.415

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.2: Transactiekosten aandelen zijn op basis van een vaste broker fee, UK Stamp Duty en Franse FTT (Tax).

5.11 Kosten vermogensbeheer hebben betrekking op kosten beheervergoeding, verantwoord beleggen en kosten corporate governance.

5.12 De werkelijke Servicekosten zijn de kosten voor: Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,294% .

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,273% .

3.4. Achmea IM Global High Yield Fund EUR hedged

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.4.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen				
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden	6.483.666	2.989.128		9.472.794
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay	6.483.666	2.989.128		9.472.794
5.9	Kosten overlay beleggingen		746.970		746.970
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay	6.483.666	3.736.098		10.219.764
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	2.867.176			2.867.176
5.12	Servicekosten	1.022.790			1.022.790
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	3.889.966			3.889.966
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				14.109.730

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.4: Transactiekosten vastrentende waarden zijn geschat op basis van de gemiddelde bied-laai spread. Beheerkosten zijn exclusief management fee Achmea Investment Management.

5.9 Kosten overlay beleggingen hebben betrekking op FX-spot transacties en zijn geschat conform de door de Pensioenfederatie gehanteerde formule.

5.11 Kosten vermogensbeheer en kosten verantwoord beleggen.

5.12 De Servicekosten zijn de kosten voor: Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,659% .

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,642%.

3.5. Achmea IM Emerging Markets Equity Fund

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.5.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen	53.149	154.300		207.449
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden				
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay	53.149	154.300		207.449
5.9	Kosten overlay beleggingen				
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay	53.149	154.300		207.449
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	56.730			56.730
5.12	Servicekosten	31.517			31.517
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	88.247			88.247
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				295.696

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.2: Transactiekosten aandelen zijn op basis van een vaste broker fee, UK Stamp Duty en Franse FTT (Tax).

5.11: Kosten vermogensbeheer.

5.12: De Servicekosten dekken onder andere de volgende kosten: kosten van de Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,469% .
Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,265%.

3.6. Achmea IM Commodity Fund EUR hedged

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.6.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen				
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden				
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities		136.477		136.477
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay		136.477		136.477
5.9	Kosten overlay beleggingen		1.153		1.153
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay		137.630		137.630
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	51.691			51.691
5.12	Servicekosten	32.519			32.519
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	84.210			84.210
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				221.840

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.6: Transactiekosten commodities zijn geschat conform de door de Pensioenfederatie gehanteerde formule.

5.11: Kosten vermogensbeheer.

5.12: De Servicekosten dekken onder andere de volgende kosten: kosten van de Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,394% .
Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,416%.

3.7. Achmea IM Global Real Estate Equity Fund

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.7.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed	37.766	34.810		72.576
5.2	Aandelen				
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden				
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay	37.766	34.810		72.576
5.9	Kosten overlay beleggingen				
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay	37.766	34.810		72.576
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	38.844			38.844
5.12	Servicekosten	29.883			29.883
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	68.726			68.726
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				141.302

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.1: Transactiekosten vastgoed zijn geschat conform de door de Pensioenfederatie gehanteerde formule.

5.11: Kosten vermogensbeheer.

5.12: De Servicekosten dekken onder andere de volgende kosten: kosten van de Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,226% .
Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,226%.

3.8. Achmea IM (LC) Emerging Markets Debt Fund

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.8.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen				
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden	224.501	844.650		1.069.151
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay	224.501	844.650		1.069.151
5.9	Kosten overlay beleggingen				
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay	224.501	844.650		1.069.151
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	168.612			168.612
5.12	Servicekosten	52.691			52.691
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	221.303			221.303
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				1.290.454

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.4: Transactiekosten vastrentende waarde zijn geschat op basis van de gemiddelde bied-laot spread.

5.11: Kosten vermogensbeheer.

5.12: De Servicekosten dekken onder andere de volgende kosten: kosten van de Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 1,223% .
Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 1,181%.

3.9. Achmea IM Euro Local Government Loans Fund

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.9.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen				
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden				
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay				
5.9	Kosten overlay beleggingen				
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay				
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer				
5.12	Servicekosten	824.820			824.820
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	824.820			824.820
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				824.820

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.12 De Servicekosten zijn de kosten voor: Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,026%.
Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,040%.

3.10. Achmea IM Euro Green Bond Fund

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.10.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen				
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden		164.034		164.034
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay		164.034		164.034
5.9	Kosten overlay beleggingen				
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay		164.034		164.034
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	338.767			338.767
5.12	Servicekosten	45.169			45.169
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	383.936			383.936
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				547.970

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.4: Transactiekosten vastrentende waarde zijn geschat op basis van de gemiddelde bied-laot spread.

5.11: Kosten vermogensbeheer.

5.12: De Servicekosten dekken onder andere de volgende kosten: kosten van de Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,559%.

3.11. Achmea IM Global Inflation Linked Bond Fund EUR hedged

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.11.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen				
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden		13.762		13.762
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay		13.762		13.762
5.9	Kosten overlay beleggingen		47.504		47.504
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay		61.266		61.266
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	81.658			81.658
5.12	Servicekosten	27.220			27.220
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	108.878			108.878
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				170.144

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.4: Transactiekosten vastrentende waarde zijn geschat op basis van de gemiddelde bied-laet spread.

5.11: Kosten vermogensbeheer,

5.12: De Servicekosten dekken onder andere de volgende kosten: kosten van de Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,374% .
Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,389%.

3.12. Achmea IM Global Multi Factor Equity Fund EUR hedged

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.12.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen		116.700		116.700
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden				
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay		116.700		116.700
5.9	Kosten overlay beleggingen		79.640		79.640
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay		196.340		196.340
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	45.372			45.372
5.12	Servicekosten	22.685			22.685
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	68.057			68.057
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				264.397

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.2: Transactiekosten aandelen zijn op basis van een vaste broker fee, UK Stamp Duty en Franse FTT (Tax).

5.11 Kosten vermogensbeheer.

5.12: De Servicekosten dekken onder andere de volgende kosten: kosten van de Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,116%.
Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,061%.

3.13. Achmea IM Global Real Estate Equity Fund EUR hedged

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.13.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed		10.212		10.212
5.2	Aandelen				
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden				
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay		10.212		10.212
5.9	Kosten overlay beleggingen		17.253		17.253
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay		27.465		27.465
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	9.530			9.530
5.12	Servicekosten	4.765			4.765
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	14.295			14.295
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				41.760

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.1: Transactiekosten vastgoed zijn geschat conform de door de Pensioenfederatie gehanteerde formule.

5.11: Kosten vermogensbeheer.

5.12: De Servicekosten dekken onder andere de volgende kosten: kosten van de Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,088% .
Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,087%.

3.14. Achmea IM 20 Year Overlay Fund

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.14.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen				
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden				
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay				
5.9	Kosten overlay beleggingen		464.206		464.206
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay		464.206		464.206
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	244.240			244.240
5.12	Servicekosten	81.414			81.414
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	325.654			325.654
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				789.860

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.9: Kosten overlay beleggingen hebben betrekking op renteswap transacties en zijn geschat conform de door de Pensioenfederatie gehanteerde formule.

5.11: Kosten vermogensbeheer.

5.12: De Servicekosten dekken onder andere de volgende kosten: kosten van de Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,486% .

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,317%.

3.15. Achmea IM 30 Year Overlay Fund

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.15.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen				
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden				
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay				
5.9	Kosten overlay beleggingen		769.872		769.872
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay		769.872		769.872
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	437.735			437.735
5.12	Servicekosten	145.912			145.912
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	583.647			583.647
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				1.353.519

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.9: Kosten overlay beleggingen hebben betrekking op renteswap transacties en zijn geschat conform de door de Pensioenfederatie gehanteerde formule.

5.11: Kosten vermogensbeheer.

5.12: De Servicekosten dekken onder andere de volgende kosten: kosten van de Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,464% .

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,298%.

3.16. Achmea IM 40 Year Overlay Fund

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.16.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen				
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden				
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay				
5.9	Kosten overlay beleggingen		244.723		244.723
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay		244.723		244.723
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	135.540			135.540
5.12	Servicekosten	45.179			45.179
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	180.719			180.719
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				425.442

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.9: Kosten overlay beleggingen hebben betrekking op renteswap transacties en zijn geschat conform de door de Pensioenfederatie gehanteerde formule.

5.11: Kosten vermogensbeheer.

5.12: De Servicekosten dekken onder andere de volgende kosten: kosten van de Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,471% .

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,342%.

3.17. Achmea IM 50 Year Overlay Fund

4.1 Is er gebruik gemaakt van schattingsmethodieken? **JA**

4.2 Toelichting: transactiekosten overlay beleggingen zijn geschat.

5.1 Worden de transactiekosten in vragen 5.1 t/m 5.10 inclusief aan- en verkoopkosten beleggingstitels ingevuld? **NEE**

TABEL 3.17.1 KOSTEN VERMOGENSBEHEER

Kosten Vermogensbeheer in euro's					
Nr.	Kosten per beleggingscategorie	Beheerkosten	Transactiekosten exclusief aan- en verkoopkosten	Transactie kosten	Totaal
5.1	Vastgoed				
5.2	Aandelen				
5.3	Private equity				
5.4	Vastrentende waarden				
5.5	Hedgefonds				
5.6	Commodities				
5.7	Overige beleggingen				
5.8	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën excl. overlay				
5.9	Kosten overlay beleggingen		173.002		173.002
5.10	Totaal kosten toe te wijzen aan categorieën incl. overlay		173.002		173.002
Overige vermogensbeheerkosten in euro's					
5.11	Kosten vermogensbeheer	83.813			83.813
5.12	Servicekosten	27.938			27.938
5.17	Totaal overige vermogensbeheerkosten	111.751			111.751
5.18	Totaal kosten vermogensbeheer				284.753

6.1 Toelichting kosten vermogensbeheer

5.9: Kosten overlay beleggingen hebben betrekking op renteswap transacties en zijn geschat conform de door de Pensioenfederatie gehanteerde formule.

5.11: Kosten vermogensbeheer.

5.12: De Servicekosten dekken onder andere de volgende kosten: kosten van de Juridisch Eigenaar, de Bewaarder, de kosten van bewaargeving van financiële instrumenten, administratieve kosten, accountantskosten, operationele kosten (zoals die in verband met toezicht en registratie), kosten van verslaglegging, de kosten van externe (juridische) dienstverleners, de kosten van het opzetten van het Fonds, de kosten van de vergaderingen van Participanten en de kosten voor maatschappelijk verantwoord beleggen voor zover toegepast door het Fonds.

6.2 Toelichting verschil met rekening van baten en lasten

De transactiekosten vormen het verschil met de resultatenrekening.

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2019: 0,510% .

Percentage Totaal kosten vermogensbeheer ten opzichte van gemiddelde marktwaarde 2018: 0,346%.



4. Verklaringen van de Bewaarder

Deze bijlagen zijn geen onderdeel van de Controleverklaring van de onafhankelijke accountant.

Vanaf de volgende pagina zijn van de onderstaande fondsen de verklaring van de Bewaarder opgenomen.

- Achmea IM Euro Government Bond Fun
- Achmea IM Euro Investment Grade Credit Fund
- Achmea IM Global Multi Factor Equity Fund
- Achmea IM Global High Yield Fund EUR hedged
- Achmea IM Emerging Markets Equity Fund
- Achmea IM Commodity Fund EUR hedged
- Achmea IM Global Real Estate Equity Fund
- Achmea IM (LC) Emerging Markets Debt Fund
- Achmea IM Euro Local Government Loans Fund
- Achmea IM Gloabl Inflation Linked Bond Fund EUR hedged
- Achmea IM Global Multi Factor Equity Fund EUR hedged
- Achmea IM Global Real Estate Equity Fund EUR hedged
- Achmea IM 20 Year Overlay Fund
- Achmea IM 30 Year Overlay Fund
- Achmea IM 40 Year Overlay Fund
- Achmea IM 50 Year Overlay Fund

Verklaring bewaarder 2019

AIM EMU Staatsobligaties Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management EMU Staatsobligaties Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdokumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdokumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM Euro Investment Grade Credits Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management Euro Investment Grade Credits Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdokumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdokumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM Wereldwijd Aandelen Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management Wereldwijd Aandelen Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdokumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdokumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM Wereldwijd High Yield Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management Wereldwijd High Yield Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdokumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdokumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM Opkomende Markten Aandelen Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management Opkomende Markten Aandelen Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdokumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdokumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM Grondstoffen Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management Grondstoffen Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdokumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdokumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM Wereldwijd Beursgenoteerd Vastgoed Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management Wereldwijd Beursgenoteerd Vastgoed Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdokumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdokumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM (LC) Emerging Markets Debt Fund

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management (LC) Emerging Markets Debt Fund ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdocumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdocumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM Lagere Overheden Kasgeldstorting Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management Lagere Overheden Kasgeldstortingen Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdokumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdokumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM Wereldwijd Inflatiegerelateerde Obligaties Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management Wereldwijd Inflatiegerelateerde Obligaties Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdokumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdokumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM Hedged Wereldwijd Aandelen Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management Hedged Wereldwijd Aandelen Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdokumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdokumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM Hedged Wereldwijd Beursgenoteerd Vastgoed Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management Hedged Wereldwijd Beursgenoteerd Vastgoed Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdokumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdokumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM 20y Overlay Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management 20y Overlay Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdocumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdocumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM 30y Overlay Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management 30y Overlay Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdokumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdokumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM 40y Overlay Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management 40y Overlay Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdokumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdokumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

Verklaring bewaarder 2019

AIM 50y Overlay Fonds

Verklaring van de Bewaarder

Overwegende:

- KAS Trust & Depositary Services B.V. ("de bewaarder") is aangesteld om op te treden als bewaarder van Achmea Investment Management 50y Overlay Fonds ("het fonds") uit hoofde van artikel 21(1) van de Richtlijn inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen (2011/61/EU) ("AIFM Richtlijn");
- De aanstelling van de bewaarder en de gemeenschappelijke rechten en plichten van de beheerder en de bewaarder zijn overeengekomen in de Depositary Agreement 9 juli 2015 die tussen deze partijen is gesloten, en de daarbij behorende bijlagen in de Depositary Agreement.
- De bewaarder verstrekt deze verklaring uitsluitend aan de beheerder in kader van de door de beheerder uitgevoerde activiteiten en heeft betrekking op de periode van 1 januari 2019 tot en met 31 december 2019 ("de verslagperiode").

Verantwoordelijkheden van de bewaarder

De bewaarder treedt op als bewaarder zoals gedefinieerd in de AIFM Richtlijn en voert haar taken uit in overeenstemming met de AIFM Richtlijn, de gedelegeerde verordening, relevante Nederlandse wet- en regelgeving en richtlijnen die uitgevaardigd zijn door de European Securities and Markets Authority en de Autoriteit Financiële Markten (de "regelgeving"). De verantwoordelijkheden van de bewaarder zijn beschreven in de Depositary Agreement en omvatten, naast het in bewaring nemen van financiële instrumenten en de bewaarnemingstaken in verband met eigendomsverificatie en het bijhouden van een register van overige activa (zoals gedefinieerd in artikel 21(8) AIFM Richtlijn), ook een aantal monitorings- en toezichtstaken (zoals gedefinieerd in artikel 21(7) en 21(9) AIFM Richtlijn), te weten:

- Monitoring van de kasstromen, waaronder het identificeren van significante en inconsistente kasstromen en het reconciliëren van de kasstromen met de administratie van het fonds;
- Het zorgdragen dat de uitvoering van uitgifte, inkoop, intrekking en waardering van participaties van het fonds in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het zorgdragen dat de tegenwaarde van transacties die betrekking hebben op de activa van het fonds tijdig aan het fonds wordt overgemaakt;
- Het controleren dat de opbrengsten van het fonds de bestemming krijgen die in overeenstemming is met de fondsvoorwaarden en de toepasselijke wet- en regelgeving;
- Het controleren of de beheerder zich houdt aan de in de fondsdokumentatie vastgestelde beleggingsbeperkingen en hefboomfinancieringslimieten.

Verklaring van de bewaarder

De bewaarder heeft die activiteiten uitgevoerd gedurende de verslagperiode die nodig zijn geacht om aan zijn verantwoordelijkheden te voldoen als bewaarder van het fonds. De bewaarder is van mening dat, op basis van de aan hem beschikbare informatie en de door de beheerder verstrekte verklaringen, de beheerder zijn taken die onderworpen zijn aan de monitorings- en toezichtstaken van de bewaarder in alle materiële aspecten heeft uitgevoerd in lijn met de regelgeving en fondsdokumentatie.

Overig

Aan deze verklaring kunnen geen rechten worden ontleend. Deze verklaring is niet bedoeld om enige rechten te creëren, voor individuen of entiteiten die geen partij zijn bij de Depositary Agreement.

Amsterdam, 14 januari 2020

KAS Trust & Depositary Services B.V.

