



DWS Investment GmbH

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Halbjahresbericht 2024



Investors for a new now

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Inhalt

Halbjahresbericht 2024
vom 1.1.2024 bis 30.6.2024 (gemäß § 103 KAGB)

- 2 / Hinweise
- 3 / Hinweise für Anleger in Luxemburg
- 6 / Halbjahresbericht
FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Hinweise

Wertentwicklung

Der Erfolg einer Investmentfondsanlage wird an der Wertentwicklung der Anteile gemessen. Als Basis für die Wertberechnung werden die Anteilwerte (= Rücknahmepreise) herangezogen, unter Hinzurechnung zwischenzeitlicher Ausschüttungen; bei inländischen thesaurierenden Fonds wird die – nach etwaiger Anrechnung ausländischer Quellensteuer – vom Fonds erhobene inländische Kapitalertragsteuer zuzüglich Solidaritätszuschlag hinzugerechnet. Die Berechnung der Wertentwicklung erfolgt nach der BVI-Methode. Angaben zur bisherigen Wertentwicklung erlauben keine Prognosen für die Zukunft.

Darüber hinaus sind in den Berichten auch die entsprechenden Vergleichsindizes – soweit vor-

handen – dargestellt. Alle Grafik- und Zahlenangaben geben den **Stand vom 30. Juni 2024** wieder sofern nichts anderes angegeben ist).

Verkaufsprospekte

Alleinverbindliche Grundlage des Kaufs ist der aktuelle Verkaufsprospekt einschließlich Anlagebedingungen sowie das Dokument „Wesentliche Anlegerinformationen“, die Sie bei der DWS Investment GmbH oder den Geschäftsstellen der Deutsche Bank AG und weiteren Zahlstellen erhalten.

Angaben zur Kostenpauschale

In der Kostenpauschale sind folgende Aufwendungen nicht enthalten:

- a) im Zusammenhang mit dem Erwerb und der Veräußerung von Vermögensgegenständen entstehende Kosten;
- b) im Zusammenhang mit den Kosten der Verwaltung und Verwahrung evtl. entstehende Steuern;
- c) Kosten für die Geltendmachung und Durchsetzung von Rechtsansprüchen des Sondervermögens.

Details zur Vergütungsstruktur sind im aktuellen Verkaufsprospekt geregelt.

Ausgabe- und Rücknahmepreise

Börsentäglich im Internet
www.dws.de

Hinweise für Anleger in Luxemburg

Einrichtung für Privatanleger in Luxemburg gemäß Art. 92 der Richtlinie (EU) 2019/1160 ist die

Deutsche Bank Luxembourg S.A.
2, Boulevard Konrad Adenauer
1115 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Bei dieser Stelle können

- die Rücknahme der Anteile durchgeführt bzw. Rücknahmeanträge eingereicht werden,
- die Anleger kostenlos sämtliche Informationen, wie Verkaufsprospekte samt Anlagebedingungen, Basisinformationsblatt, Jahres- und Halbjahresberichte sowie die Ausgabe- und Rücknahmepreise erhalten und sonstige Angaben und Unterlagen erfragen bzw. einsehen; zudem sind diese Dokumente über die Internetseite www.dws.com/fundinformation erhältlich,
- Zahlungen an die Anteilinhaber weitergeleitet werden.

Halbjahresbericht

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertentwicklung der Anteilsklassen (in Euro)

Anteilklasse	ISIN	6 Monate
Klasse A	DE000DWS0XF8	3,2%
Klasse B	DE000DWS2S93	3,2%

Wertentwicklung nach BVI-Methode, d. h. ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages.
Wertentwicklungen der Vergangenheit ermöglichen keine Prognose für die Zukunft.

Stand: 30.6.2024

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Überblick über die Anteilsklassen

ISIN-Code	A	DE000DWS0XF8
	B	DE000DWS2S93
Wertpapierkennnummer (WKN)	A	DWS0XF
	B	DWS2S9
Fondswährung		EUR
Anteilklassenwährung	A	EUR
	B	EUR
Erstzeichnungs- und Auflegungsdatum	A	3.9.2009 (ab 27.9.2017 als Anteilklasse A)
	B	2.1.2018
Ausgabeaufschlag	A	3%
	B	3%
Verwendung der Erträge	A	Ausschüttung
	B	Ausschüttung
Kostenpauschale	A	0,9% p.a.
	B	0,9% p.a.
Mindestanlagesumme	A	Keine
	B	Keine
Erstausgabepreis	A	EUR 103 (inklusive Ausgabeaufschlag)
	B	Anteilwert der Anteilklasse FOS Rendite und Nachhaltigkeit A am Auflegungstag der Anteilklasse B zusätzlich Ausgabeaufschlag

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Vermögensübersicht zum 30.06.2024

	Bestand in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien (Branchen):		
Informationstechnologie	27.100.098,83	3,51
Industrien	23.960.191,06	3,09
Gesundheitswesen	22.623.685,04	2,92
Versorger	14.023.099,16	1,81
Finanzsektor	12.420.650,75	1,60
Grundstoffe	11.965.320,00	1,54
Hauptverbrauchsgüter	6.872.020,19	0,89
Dauerhafte Konsumgüter	2.525.600,00	0,33
Sonstige	15.995.486,47	2,06
Summe Aktien:	137.486.151,50	17,75
2. Anleihen (Emittenten):		
Institute	252.758.693,39	32,62
Zentralregierungen	131.580.273,91	16,98
Sonst. Finanzierungsinstitutionen	124.348.572,04	16,05
Sonstige öffentliche Stellen	27.716.130,02	3,58
Unternehmen	26.419.053,83	3,41
Sonstige	185.404,32	0,02
Summe Anleihen:	563.008.127,51	72,66
3. Zertifikate	17.682.000,00	2,28
4. Investmentanteile	45.493.602,07	5,87
5. Derivate	-1.356.956,65	-0,18
6. Bankguthaben	8.956.843,01	1,16
7. Sonstige Vermögensgegenstände	4.109.806,40	0,53
II. Verbindlichkeiten		
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-561.000,72	-0,07
III. Fondsvermögen	774.818.573,12	100,00

Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Vermögensaufstellung zum 30.06.2024

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
Börsengehandelte Wertpapiere						701.937.290,71	90,59	
Aktien								
Siegfried Holding Reg. (CH0014284498) (N)	Stück	2.000	2.000		CHF	935,0000	1.943.462,90	0,25
Novo-Nordisk (DK0062498333) (N)	Stück	40.000		20.000	DKK	1.002,2000	5.375.672,16	0,69
Air Liquide (FR0000120073) (N)	Stück	12.100	1.100		EUR	161,7000	1.956.570,00	0,25
ASML Holding (NL0010273215) (N)	Stück	6.000			EUR	964,6000	5.787.600,00	0,75
BEFESA (LU1704650164) (N)	Stück	100.000			EUR	31,3200	3.132.000,00	0,40
BNP Paribas (FR0000131104) (N)	Stück	80.000			EUR	59,5300	4.762.400,00	0,61
Compagnie de Saint-Gobain (C.R.) (FR0000125007) (N)	Stück	40.000		10.000	EUR	72,8400	2.913.600,00	0,38
Covestro (DE0006062144) (N)	Stück	120.000	40.000		EUR	54,6400	6.556.800,00	0,85
Deutsche Post Reg. (DE0005552004) (N)	Stück	50.000		40.000	EUR	37,8900	1.894.500,00	0,24
ENCAVIS (DE000A4BGGQ8) (N)	Stück	206.000	206.000		EUR	17,1000	3.522.600,00	0,45
European Healthcare Acq.+ Grow Cl.A (NL0015000K10)	Stück	58.615			EUR	10,5000	615.457,50	0,08
Kion Group (DE000KGX8881) (N)	Stück	62.500		20.000	EUR	39,3100	2.456.875,00	0,32
Legrand (FR0010307819) (N)	Stück	18.500	18.500		EUR	93,0200	1.720.870,00	0,22
Merck (DE0006599905) (N)	Stück	30.000		3.500	EUR	154,6000	4.638.000,00	0,60
Michelin (FR001400AJ45) (N)	Stück	70.000			EUR	36,0800	2.525.600,00	0,33
Stora Enso R (FI0009005961) (N)	Stück	270.000	270.000		EUR	12,7850	3.451.950,00	0,45
Verbund AG (AT0000746409) (N) ³⁾	Stück	30.000		30.000	EUR	73,4500	2.203.500,00	0,28
VINCI (FR0000125486) (N)	Stück	40.000	40.000		EUR	98,3200	3.932.800,00	0,51
Vonovia (DE000A1ML7J1) (N)	Stück	60.000	60.000		EUR	26,6800	1.600.800,00	0,21
Nordea Bank (FI4000297767) (N)	Stück	240.000			SEK	126,7500	2.673.862,60	0,35
Agriculture & Natural Solutions Acquisition (KYG0131Y1008)	Stück	300.000	300.000		USD	10,2350	2.870.430,96	0,37
American Water Works Co. (US0304201033) (N)	Stück	40.000	10.000		USD	129,2700	4.833.878,66	0,62
Avalonbay Communities (US0534841012) (N)	Stück	15.000	15.000		USD	206,3000	2.892.867,16	0,37
Bristol-Myers Squibb Co. (US1101221083) (N)	Stück	120.000	30.000		USD	41,5100	4.656.632,70	0,60
Eli Lilly and Company (US5324571083) (N)	Stück	4.000	4.000		USD	909,0400	3.399.233,43	0,44
General Mills (US3703341046) (N)	Stück	50.000	50.000		USD	63,7100	2.977.937,74	0,38
Johnson Controls International (IE00BY7QL619) (N)	Stück	70.000		20.000	USD	67,0300	4.386.370,01	0,57
Legato Merger Corp. III (KYG5451A1031)	Stück	200.000	200.000		USD	10,1050	1.889.314,76	0,24
Nabors Energy Trans. Corp.II (KYG6363K1067)	Stück	327.778			USD	10,5350	3.228.139,88	0,42
NVIDIA Corp. (US67066G1040) (N) ⁶⁾	Stück	97.000	103.500	21.500	USD	123,9900	11.243.367,30	1,45
Ormat Technologies (US6866881021) (N)	Stück	50.000	13.000		USD	74,0900	3.463.120,50	0,45
Palo Alto Networks (US6974351057) (N)	Stück	10.000	5.000	10.000	USD	340,8200	3.186.126,95	0,41
salesforce (US79466L3024) (N)	Stück	15.000	15.000		USD	252,8500	3.545.620,27	0,46
Synopsys (US8716071076) (N)	Stück	6.000	6.000		USD	595,0000	3.337.384,31	0,43
The Procter & Gamble (US7427181091) (N) ⁶⁾	Stück	25.000		15.000	USD	166,6200	3.894.082,45	0,50
VISA Cl.A (US92826C8394) (N)	Stück	20.000			USD	266,5900	4.984.388,15	0,64
Welltower REIT (US95040Q1040) (N)	Stück	30.000	10.000		USD	103,3500	2.898.476,21	0,37
Verzinsliche Wertpapiere								
3,3750 % Allianz 14/und. MTN (DE000A13R7Z7) (N)	EUR	2.000			%	99,6350	1.992.700,00	0,26
0,0000 % Austria 21/20.02.31 (AT0000A2NW83) (N)	EUR	3.000	2.000		%	82,4740	2.474.220,00	0,32
1,8500 % Austria 22/23.05.2049 (AT0000A2Y8G4) (N)	EUR	5.000	5.000		%	76,2920	3.814.600,00	0,49
2,9000 % Austria 23/25.05.2029 (AT0000A33SH3) (N) ³⁾	EUR	10.000		3.000	%	100,2240	10.022.400,00	1,29
1,1250 % Banco Santander 20/23.06.27 MTN (XS2194370727) (N)	EUR	6.000		4.000	%	93,4910	5.609.460,00	0,72
4,8750 % Banco Santander 23/18.10.2031 MTN (XS2705604234) (N)	EUR	2.000		1.600	%	105,8150	2.116.300,00	0,27
0,1250 % Bayerische Landesbank 21/10.02.28 MTN (DE000BLB6JJ0)	EUR	5.000	2.200		%	88,1040	4.405.200,00	0,57
1,2500 % Belgium 18/22.04.33 S.86 (BE0000346552) (N) ³⁾	EUR	20.000			%	86,4750	17.295.000,00	2,23
0,3750 % Berlin Hyp 21/21.04.31 MTN (DE000BHY0SL9) ³⁾	EUR	8.000			%	80,2010	6.416.080,00	0,83
3,0000 % Berlin Hyp 23/10.01.2033 MTN (DE000BHY0GM2)	EUR	8.000	3.000		%	99,2940	7.943.520,00	1,03
0,2500 % BNG Bank 21/22.11.36 MTN (XS2408981103)	EUR	5.000	5.000		%	69,9970	3.499.850,00	0,45
0,3750 % BNP Paribas 20/14.10.27 MTN (FR00140005J1) (N)	EUR	6.000			%	92,5600	5.553.600,00	0,72
0,0000 % Caisse d'Amort de la Dette Sociale 20/25.02.28 MTN (FR00140002P5)	EUR	5.000			%	89,2340	4.461.700,00	0,58
0,7500 % Caixabank 20/10.07.26 MTN (XS2200150766) (N)	EUR	6.000			%	97,0110	5.820.660,00	0,75
0,3750 % Caixabank 20/18.11.26 MTN (XS2258971071) (N)	EUR	5.000			%	95,3840	4.769.200,00	0,62

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
0,5000 % Caixabank 21/09.02.29 MTN (XS2297549391) (N)	EUR	5.000			% 89,0350	4.451.750,00	0,57
4,2500 % Caixabank 23/06.09.2030 MTN (XS2676814499) (N)	EUR	3.500			% 103,5100	3.622.850,00	0,47
3,0000 % Commerzbank 22/14.09.27 (DE000CZ45W57) (N)	EUR	6.000			% 98,1230	5.887.380,00	0,76
4,0000 % Coöp. Rabobank (Utrecht Br.) 23/10.01.2030 MTN (XS2572996606) (N)	EUR	3.000		1.700	% 102,2780	3.068.340,00	0,40
0,0500 % Crédit Agricole Home Loan 19/06.12.29 MTN (FR0013465010) (N)	EUR	5.000	1.000		% 84,5840	4.229.200,00	0,55
3,2500 % Crédit Agricole Home Loan 23/28.09.2026 MTN (FR001400G5S8) (N) ³⁾	EUR	3.000		2.000	% 100,0030	3.000.090,00	0,39
3,2500 % Dekabank Deutsche Giro 24/08.02.2029 MTN (XS2760218003) ³⁾	EUR	3.000	3.000		% 99,8580	2.995.740,00	0,39
1,8750 % Deutsche Bank 22/23.02.28 MTN (DE000DL19WL7)	EUR	8.000		2.000	% 94,8420	7.587.360,00	0,98
1,8750 % Encavis Finance Bv 21/Und. Cv. (DE000A3MQE86) (N)	EUR	5.000	5.000		% 95,7480	4.787.400,00	0,62
0,1250 % Estonia 20/10.06.30 (XS2181347183) (N)	EUR	6.000	1.000		% 83,0770	4.984.620,00	0,64
0,1500 % EUROFIMA 19/10.10.34 MTN (XS2055744689) (N)	EUR	7.000	1.000		% 74,5960	5.221.720,00	0,67
1,2500 % European Investment Bank 14/13.11.26 MTN (XS1107718279) ³⁾	EUR	2.000			% 96,2550	1.925.100,00	0,25
0,0100 % European Investment Bank 20/15.11.35 MTN (XS2194790262)	EUR	8.000	8.000		% 70,8000	5.664.000,00	0,73
0,5000 % Germany 14/15.04.30 INFL (DE0001030559) (N) ³⁾	EUR	4.000			% 99,9710	5.061.171,83	0,65
0,1000 % Germany 15/15.04.26 INFL (DE0001030567) (N)	EUR	3.000		2.000	% 97,6190	3.696.763,20	0,48
0,0000 % Germany 20/15.08.30 (DE0001030708) (N) ³⁾	EUR	10.000	2.000	2.000	% 86,6860	8.668.600,00	1,12
0,1000 % Germany 21/15.04.33 INFL (DE0001030583) (N) ³⁾	EUR	7.000	2.000		% 97,4120	8.190.995,17	1,06
2,3000 % Germany 23/15.02.2033 S.G. (DE000BU3Z005) (N) ³⁾	EUR	15.000			% 99,0470	14.857.050,00	1,92
1,7500 % Intesa Sanpaolo 19/04.07.29 MTN (XS2022424993) (N)	EUR	5.000	5.000		% 91,2510	4.562.550,00	0,59
0,7500 % Intesa Sanpaolo 21/16.03.28 MTN (XS2317069685) (N)	EUR	10.000			% 90,0310	9.003.100,00	1,16
5,1250 % Intesa Sanpaolo 23/29.08.2031 MTN (XS2673808726) (N)	EUR	2.500		670	% 107,2600	2.681.500,00	0,35
1,3500 % Ireland 18/18.03.31 (IE00BFZRQ242) (N) ³⁾	EUR	11.000			% 91,2200	10.034.200,00	1,30
3,0000 % Ireland Govt. 22/18.10.2043 (IE000GVLBXU6) (N) ³⁾	EUR	5.000			% 97,1630	4.858.150,00	0,63
1,5000 % Italy 21/30.04.45 (IT0005438004) (N)	EUR	4.000	4.000		% 61,3170	2.452.680,00	0,32
1,6000 % Italy B.T.P. 22/28.06.2030 S.ICPI INFL (IT0005497000) (N)	EUR	4.000			% 95,3115	3.815.548,09	0,49
1,3750 % La Banque Postale 19/24.04.29 MTN (FR0013415692)	EUR	5.000			% 89,2560	4.462.800,00	0,58
0,3750 % LB Baden-Württemberg 19/29.07.26 MTN (DE000LB2CLH7)	EUR	5.000			% 92,9220	4.646.100,00	0,60
0,3750 % LB Baden-Württemberg 20/18.02.27 MTN (DE000LB2CRG6)	EUR	8.000			% 91,5350	7.322.800,00	0,95
0,2500 % LB Baden-Württemberg 21/21.07.28 MTN (DE000LB2V7C3)	EUR	8.000	1.000		% 87,6770	7.014.160,00	0,91
0,2500 % Lettland Republik 21/23.01.30 MTN (XS2420426038) ³⁾	EUR	5.000			% 83,5290	4.176.450,00	0,54
0,7500 % NatWest Group 19/15.11.25 (XS2080205367) (N)	EUR	10.000			% 98,8620	9.886.200,00	1,28
0,5000 % Netherlands 19/15.01.40 (NL0013552060) (N) ³⁾	EUR	10.000			% 70,3720	7.037.200,00	0,91
0,5000 % Netherlands Government 22/15.07.32 (NL0015000RP1) (N) ³⁾	EUR	15.000			% 84,0550	12.608.250,00	1,63
0,0000 % NIBC Bank 03/10.02.43 MTN (XS0161702914) (N)	EUR	930	340		% 305,5000	2.841.150,00	0,37
0,0000 % Nordic Investment Bank 19/25.09.26 MTN (XS2055786763)	EUR	2.000			% 93,5210	1.870.420,00	0,24
5,3750 % Porr 20/Und (XS2113662063) (N)	EUR	661	500	1.339	% 97,6030	645.155,83	0,08
7,5000 % Porr 21/und. (XS2408013709) (N)	EUR	214		1.786	% 99,5425	213.020,95	0,03
9,5000 % Porr 24/Und. (AT0000A39724) (N)	EUR	4.000	4.300	300	% 107,9900	4.319.600,00	0,56
0,3750 % Raiffeisen Bank International 19/25.09.26 MTN (XS2055627538) (N)	EUR	6.000			% 92,7680	5.566.080,00	0,72
4,8750 % SBAB 23/26.06.2026 MTN (XS2641720987)	EUR	5.000			% 100,8090	5.040.450,00	0,65
0,8750 % Societe Generale 20/22.09.28 MTN (FR0013536661) (N)	EUR	7.000			% 90,8070	6.356.490,00	0,82
0,6500 % Spain 17/30.11.27 INFL (ES00000128S2) (N)	EUR	3.000			% 98,4670	3.687.815,62	0,48
1,0000 % Spain 21/30.07.42 (ES0000012J07) (N)	EUR	6.000	1.000		% 64,0760	3.844.560,00	0,50
0,0100 % Sparebanken Vest Boligkredit 20/28.06.27 MTN PF (XS2199484929) (N) ³⁾	EUR	9.000		2.000	% 91,0470	8.194.230,00	1,06

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
0,0100 % Sparebanken Vest Boligkreditt 21/11.11.26 MTN PF (XS2397352233) (N)	EUR	8.400			% 92,7880	7.794.192,00	1,01
3,3240 % Standard Chart.Bk (Singapore) 24/28.05.2027 (XS2821666745) (N)	EUR	5.000	5.000		% 100,1690	5.008.450,00	0,65
0,0000 % Unedic 20/25.11.28 MTN (FR0014000667)	EUR	9.000			% 87,2300	7.850.700,00	1,01
0,0100 % UniCredit Bank GmbH 21/28.09.2026 MTN (DE000HV2AYN4) (N)	EUR	6.000			% 92,9830	5.578.980,00	0,72
1,6250 % Vonovia 21/01.09.51 MTN (DE000A3MP4W5) (N)	EUR	5.000	5.000		% 56,4840	2.824.200,00	0,36
2,0000 % ZF Finance 21/06.05.27 MTN Reg S (XS2338564870) (N)	EUR	4.000			% 93,5220	3.740.880,00	0,48
5,6250 % NatWest Markets 02/und. MTN (XS0154144132) (N)	GBP	2.167			% 95,5000	2.444.610,48	0,32
10,0625 % Santander Uk 95/Und. (XS0060837068) (N)	GBP	3.200			% 133,6075	5.050.428,21	0,65
1,5060 % AEGON (NL0000120004) (N)	NLG	10.000			% 83,7070	3.798.458,05	0,49
1,4250 % AEGON 96/Und (NL0000121416) (N)	NLG	5.000			% 75,7785	1.719.339,21	0,22
5,7500 % African Development Bank 24/und. CoCo. (US008281BF39)	USD	6.000	6.000		% 96,7352	5.425.923,90	0,70
2,1250 % Caisse Amortism. Dette Soc. 22/26.01.32 Reg S (XS2436433333) (N) ³⁾	USD	16.000			% 84,4760	12.635.467,89	1,63
4,2500 % Caisse Amortism. Dette Soc. 24/24.01.2027 MTN Reg S (XS2753427421) (N)	USD	3.000	3.000		% 98,7070	2.768.262,13	0,36
8,1510 % Dresdner Funding Tr I 99/30.06.31 Reg S (XS0097772965)	USD	6.000	4.575		% 108,4930	6.085.425,82	0,79
0,1000 % European Bank for Rec. & Dev. 20/20.11.30 INFL (XS2259635170)	USD	18.500	18.500		% 91,6500	19.096.648,78	2,46
0,1121 % European Bank for Rec. & Dev. 21/18.10.31 INFL (XS2398388046)	USD	5.100			% 89,2000	4.876.961,84	0,63
0,7500 % European Investment Bank (EIB) 20/23.09.30 (US298785JH03)	USD	5.000		5.000	% 80,4700	3.761.334,95	0,49
3,7500 % European Investment Bank 23/14.02.2033 (US298785JV96) ³⁾	USD	8.000	5.000		% 95,6736	7.155.174,05	0,92
Verbriefte Geldmarktinstrumente							
4,5000 % Aareal Bank 22/25.07.2025 (DE000AAR0355) (N)	EUR	8.000			% 100,6320	8.050.560,00	1,04
2,8463 % AEGON (NL0000116150) (N)	EUR	3.000			% 82,8860	2.486.580,00	0,32
3,6300 % AXA 03/und. MTN (XS0179060974) (N)	EUR	5.000			% 91,5540	4.577.700,00	0,59
3,1060 % AXA 03/und. MTN (XS0181369454) (N)	EUR	7.000		1.000	% 91,7310	6.421.170,00	0,83
2,9230 % AXA 04/und. MTN (XS0203470157) (N)	EUR	5.000			% 92,5065	4.625.325,00	0,60
3,0000 % Axa 23/und. MTN (XS0210434782) (N)	EUR	1.000			% 93,0985	930.985,00	0,12
5,0880 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 07/und. S.1 (ES0214974075) (N)	EUR	6.250			% 96,4955	6.030.968,75	0,78
2,6780 % Banco Santander 04/und. (XS0202197694) (N) ³⁾	EUR	10.000			% 84,8130	8.481.300,00	1,09
0,0000 % Banesto Financial Products 20/21.09.2030 MTN (XS2231046140)	EUR	4.500	3.900		% 84,1440	3.786.480,00	0,49
2,7480 % Compagnie De Saint-Gobain 18/25.5.33 MTN (XS1824277641) (N)	EUR	10.000			% 86,1485	8.614.850,00	1,11
2,0000 % Coöperatieve Rabobank 06/29.02.2035 MTN (XS0211284491) (N)	EUR	2.500			% 89,8155	2.245.387,50	0,29
0,0100 % De Volksbank 19/16.09.24 MTN (XS2052503872)	EUR	3.000			% 99,1790	2.975.370,00	0,38
0,7500 % Deutsche Kreditbank 17/26.09.24 (DE000GRN0016)	EUR	6.000			% 99,1760	5.950.560,00	0,77
2,9310 % Deutsche Postbank Funding Trust I 04/und. pref. (DE000A0DEN75) (N)	EUR	10.000			% 83,6330	8.363.300,00	1,08
2,9120 % Deutsche Postbank Funding Trust III 05/und. pref. (DE000A0D24Z1) (N)	EUR	10.000			% 83,4800	8.348.000,00	1,08
0,0000 % European Investment Bank 05/17.08.30 MTN (XS0224480722)	EUR	2.275			% 89,2400	2.030.210,00	0,26
0,7500 % Intesa Sanpaolo 19/04.12.24 MTN (XS2089368596) (N)	EUR	4.000	2.000		% 98,7150	3.948.600,00	0,51
2,9689 % LB Hessen-Thüringen 09/05.02.29 (DE000HLB1Q05)	EUR	1.000			% 98,6600	986.600,00	0,13
2,8500 % NIBC Bank 05/21.02.40 MTN (XS0210781828) (N)	EUR	3.767	594		% 67,0580	2.526.074,86	0,33
2,7280 % NIBC Bank 06/Und. (XS0249580357) (N)	EUR	4.365		635	% 79,4200	3.466.683,00	0,45
6,5000 % Stichting AK Rabobank Certificaten 13/Und. (XS1002121454) (N)	EUR	3.000		2.000	% 108,7300	3.261.900,00	0,42
4,1780 % UniCredit Bank Austria 01/27.12.31 MTN (XS0140394817) (N)	EUR	6.600			% 92,6135	6.112.491,00	0,79
0,8500 % AEGON (NL0000120889) (N)	NLG	7.000			% 72,5655	2.305.015,18	0,30

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
4,5802 % AEGON (NL0000116168) (N) ³⁾	USD	6.000			% 80,6420	4.523.249,51	0,58
4,9200 % AXA 04/Und. MTN (XS0184718764) (N)	USD	2.000			% 89,8250	1.679.442,83	0,22
0,0000 % Natixis 13/27.12.33 MTN (US63873HJT23)	USD	300			% 66,1090	185.404,32	0,02
0,0000 % Natixis 13/29.08.33 MTN (US63873HLN25)	USD	2.000			% 69,8960	1.306.833,69	0,17
4,7500 % ZF North America Capital 15/29.04.25 Reg S (USU98737AC03) (N)	USD	4.000			% 98,8772	3.697.380,57	0,48
Zertifikate							
HANetf ETC Securities/Carbon ETC (XS2353177293)	Stück	280.000	140.000		EUR 63,1500	17.682.000,00	2,28
Sonstige Beteiligungswertpapiere							
Roche Holding Profitsh. (CH0012032048) (N)	Stück	10.000	5.000		CHF 251,2000	2.610.683,85	0,34
Schindler Holding (participation cert.) (CH0024638196) (N)	Stück	15.000	10.000		CHF 226,0000	3.523.176,05	0,45
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						14.713.155,64	1,90
Verbriefte Geldmarktinstrumente							
0,0000 % Bank of Nova Scotia 13/29.07.2033 (US064159CP95) (N)	USD	5.850			% 63,6590	3.481.398,06	0,45
6,1703 % HSB Group 97/15.07.27 (US40428NAC39) (N)	USD	8.800			% 94,9301	7.809.527,05	1,01
5,7585 % Royal Bank of Canada 86/29.06.2085 (GB0007542557) (N)	USD	4.000			% 91,5190	3.422.230,53	0,44
Nicht notierte Wertpapiere						1.525.832,66	0,20
Verzinsliche Wertpapiere							
0,0000 % Intl Bk Recon & Develop 14/30.06.2034 MTN (US45905UPL25)	USD	410			% 63,7370	244.294,38	0,03
Verbriefte Geldmarktinstrumente							
0,0000 % Int. Bank for Rec. and Develop. 14/31.07.34 MTN (US45905UPQ12)	USD	2.150			% 63,7610	1.281.538,28	0,17
Investmentanteile						45.493.602,07	5,87
Gruppenfremde Investmentanteile							
FSGU-Stewart Inv.APAC Sus. VI EUR Accu. (IE00BFY86394) (0,850%)	Stück	8.200.000			EUR 3,9779	32.618.779,78	4,21
GS Funds SICAV-GS Japan Equity Partners Port I JPY (LU1217871059) (0,750%)	Stück	83.000			JPY 26.700,5200	12.874.822,29	1,66
Summe Wertpapiervermögen						763.669.881,08	98,56
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Derivate auf einzelne Wertpapiere						-820.418,23	-0,11
Wertpapier-Optionsrechte (Forderungen / Verbindlichkeiten)							
Optionsrechte auf Aktien							
Put Straumann Holding 07/2024 Strike 110,00 (EURX) ...	Stück	-15.000			CHF 2,5750	-40.142,38	-0,01
Put Straumann Holding 09/2024 Strike 130,00 (EURX) ...	Stück	-10.000			CHF 19,8250	-206.038,25	-0,03
Put Kion Group 08/2024 Strike 40,00 (EURX)	Stück	-37.500			EUR 2,4250	-90.937,50	-0,01
Call NVIDIA Corp. 07/2024 Strike 1000,00 (USS)	Stück	-15.000			USD 24,5000	-343.554,27	-0,04
Call The Procter & Gamble 09/2024 Strike 180,00 (USS) .	Stück	-25.000			USD 0,6500	-15.191,18	0,00
Put Deere & Co. 09/2024 Strike 360,00 (USS)	Stück	-5.000			USD 8,1900	-38.281,76	0,00
Put Palo Alto Networks 11/2024 Strike 300,00 (USS)	Stück	-5.000			USD 11,0500	-51.650,00	-0,01
Put Stryker Corp. 12/2024 Strike 320,00 (USS)	Stück	-8.200			USD 9,5500	-73.207,44	-0,01
Put The Procter & Gamble 09/2024 Strike 155,00 (USS) .	Stück	-12.500			USD 1,0900	-12.737,22	0,00
Wertpapier-Optionsscheine							
Optionsscheine auf Aktien							
Agriculture & Natural Sol Acq Corp 31.12.2028 (KYG0131Y1180)	Stück	150.000	150.000		USD 0,1700	23.838,46	0,00
Legato Merger Corp. III (KYG5451A1114)	Stück	100.000	100.000		USD 0,1301	12.162,29	0,00

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Nabors Energy Transition 01.09.2028 (KYG6363K1141) . . .	Stück	163.889			USD 0,1000	15.321,02	0,00
Devisen-Derivate						-536.538,42	-0,07
Devisentermingeschäfte							
EUR/USD FUTURE (EUREX) SEP 24 (EURX)	USD	64.000				-536.538,42	-0,07
Bankguthaben und nicht verbriefte Geldmarktinstrumente						8.956.843,01	1,16
Bankguthaben						8.956.843,01	1,16
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	3.402.866,58		%	100	3.402.866,58	0,44
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen.	EUR	7.104,61		%	100	7.104,61	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							
Australische Dollar	AUD	163,76		%	100	101,68	0,00
Kanadische Dollar	CAD	165,24		%	100	112,69	0,00
Schweizer Franken	CHF	70,39		%	100	73,16	0,00
Britische Pfund	GBP	877,58		%	100	1.036,65	0,00
Japanische Yen	JPY	9.569,00		%	100	55,59	0,00
Mexikanische Peso	MXN	2.552,92		%	100	130,07	0,00
US Dollar	USD	5.931.873,71		%	100	5.545.361,98	0,72
Sonstige Vermögensgegenstände						4.109.806,40	0,53
Zinsansprüche	EUR	3.943.045,37		%	100	3.943.045,37	0,51
Dividenden-/Ausschüttungsansprüche	EUR	86.491,29		%	100	86.491,29	0,01
Quellensteueransprüche	EUR	59.437,87		%	100	59.437,87	0,01
Sonstige Ansprüche.	EUR	20.831,87		%	100	20.831,87	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten						-561.000,72	-0,07
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-535.251,15		%	100	-535.251,15	-0,07
Andere sonstige Verbindlichkeiten.	EUR	-25.749,57		%	100	-25.749,57	0,00
Fondsvermögen						774.818.573,12	100,00
Anteilwert bzw. umlaufende Anteile	Stück bzw. Whg.					Anteilwert in der jeweiligen Whg.	
Anteilwert							
Klasse A	EUR					117,60	
Klasse B	EUR					118,10	
Umlaufende Anteile							
Klasse A	Stück					5.744.020,795	
Klasse B	Stück					841.023,357	

Durch Rundung der Prozentanteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
 USS = American Stock Options Exchange

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 28.06.2024				
Australische Dollar	AUD	1,610500	= EUR	1
Kanadische Dollar	CAD	1,466350	= EUR	1
Schweizer Franken	CHF	0,962200	= EUR	1
Dänische Kronen	DKK	7,457300	= EUR	1
Britische Pfund	GBP	0,846550	= EUR	1
Japanische Yen	JPY	172,130000	= EUR	1
Mexikanische Peso	MXN	19,627900	= EUR	1
Niederländische Gulden	NLG	2,203710	= EUR	1
Schwedische Kronen	SEK	11,376800	= EUR	1
US Dollar	USD	1,069700	= EUR	1

Fußnoten

- 3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 97.040.941,83.
6) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise Gegenstand eines Stillhaltergeschäfts in Wertpapieren (Verkauf einer Kaufoption).

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
-----------------------	--------------------------------	--------------------------	-----------------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Aktien

Aurubis (DE0006766504)	Stück		20.000
Carl Zeiss Meditec (DE0005313704)	Stück		18.500
CTP (NL00150006R6)	Stück		320.000
ENCAVIS (DE0006095003)	Stück		320.000
Infineon Technologies Reg. (DE0006231004)	Stück		70.500
Kering (FR0000121485)	Stück	6.100	13.000
Agriculture & Natural Solution Acqui.Cl.A (KYG0131Y1263)	Stück		300.000
Estée Lauder Companies, The Cl.A (US5184391044)	Stück	10.000	40.000
Intel Corp. (US4581401001)	Stück	50.000	50.000
Legato Merger (KYG5451A1296)	Stück	200.000	200.000
Microsoft Corp. (US5949181045)	Stück		21.000

Verzinsliche Wertpapiere

0,1250 % Berlin Hyp Ag 21/18.01.30 (DE000BHY0H34)	EUR		2.000
4,3750 % BNP Paribas 23/13.01.2029 MTN (FR001400DCZ6)	EUR		3.500
0,8000 % Bonos Y Oblig Del Estado 22/30.07.29 (ES0000012K53)	EUR		2.000
3,3750 % Commerzbank 23/12.12.2025 MTN (DE000CZ43Z15)	EUR		2.000
4,1250 % DekaBank DGZ 23/03.08.2028 MTN (XS2660380622)	EUR	200	5.000
4,6000 % Deut. Pfandbr.bk. 17/22.02.27 R.35274 MTN (DE000A2DASM5)	EUR	2.000	2.000
2,7500 % European Investment Bank 28/28.07.2028 S.EARN (XS2587298204)	EUR		7.240
1,3000 % Germany 22/15.10.2027 S.G (DE0001030740)	EUR		5.000
3,0000 % Hamburger Sparkasse 23/15.09.2028 (DE000A351M80)	EUR		4.600
5,0000 % Intesa Sanpaolo 23/08.03.2028 MTN (XS2592650373)	EUR		5.000
4,5000 % NN Group 14/und (XS1028950290)	EUR		3.000
0,0100 % Oberoesterreichische 21/15.09.28 MTN (AT0000A2SUL3)	EUR		5.000
6,0000 % Raiffeisen Bank International 23/15.09.2028 MTN (XS2682093526)	EUR		3.000

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
-----------------------	--------------------------------	--------------------------	-----------------------------

Verbriefte Geldmarktinstrumente

0,3750 % LB Baden-Württemberg 19/24.05.24 MTN S.806 (DE000LB2CHW4)	EUR		4.000
0,2500 % Nederlandse Waterschapsbank 17/07.06.24 MTN (XS1626191107)	EUR		5.000
0,1250 % Nordic Investment Bank 16/10.06.24 MTN (XS1431730388)	EUR		4.000
0,5000 % SBAB 20/13.05.25 MTN (XS2173114542)	EUR		5.000
5,9707 % BNP Paribas 86/und (FR0008131403)	USD		6.000
6,0625 % DNB Bank 86/und. (GB0040940875)	USD		6.000
3,5000 % KBC Ifima 05/07.02.25 MTN (XS0210976329)	USD		2.000

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

Verbriefte Geldmarktinstrumente

5,9375 % DNB Bank 85/Und. S.OLD (LU0001344653)	USD		2.000
--	-----	--	-------

Nicht notierte Wertpapiere

Zertifikate

UBS London/Equity Basket 29.03.28 TrackerCert. (CH0575775371)	Stück		180.000
---	-------	--	---------

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Derivate (in Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumina der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe)

	Zugänge	Abgänge
Optionsscheine		
Wertpapier-Optionsscheine		
Optionsscheine auf Aktien		
Pyrophyte Acquisition 03.05.2028 WRT (KYG7308P1274)..... Stück		285.000
		Volumen in 1.000
Terminkontrakte		
Devisentermingeschäfte		
Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: EUR/USD FUTURE (EUREX) JUN 24)	EUR	64.381
Optionsrechte		
Wertpapier-Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktien		
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswerte: ASML Holding, Intel Corp., Kion Group, Novo-Nordisk, NVIDIA Corp., Palo Alto Networks, The Procter & Gamble)	EUR	10.503
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: Air Liquide, BNP Paribas, Covestro, First Solar, General Mills, Intuitive Surgical, Palo Alto Networks, salesforce, Schindler Holding (participation cert.), Stora Enso R, Synopsys)	EUR	22.735
Optionsrechte auf Zins-Derivate		
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte		
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: EURO-BUND JUN 24)	EUR	26.000

Wertpapier-Darlehen (Geschäftsvolumen, bewertet auf Basis des bei Abschluss des Darlehensgeschäftes vereinbarten Wertes)

	Volumen in 1.000
unbefristet	EUR 134.232
Gattung: 4,5000 % Aareal Bank 22/25.07.2025 (DE000AAR0355), 3,6300 % AXA 03/und. MTN (XS0179060974), 0,1250 % Bayerische Landebank 21/10.02.28 MTN (DE000BLB6JJ0), 0,0000 % Caisse d'Amort de la Dette Sociale 20/25.02.28 MTN (FR00140002P5), 0,3750 % Caixabank 20/18.11.26 MTN (XS2258971071), 3,3750 % Commerzbank 23/12.12.2025 MTN (DE000CZ43Z15), 4,0000 % Coöp. Rabobank (Utrecht Br.) 23/10.01.2030 MTN (XS2572996606), 3,2500 % Dekabank Deutsche Giro 24/08.02.2029 MTN (XS2760218003), 4,1250 % DekaBank DGZ 23/03.08.2028 MTN (XS2660380622), 0,1250 % Estonia 20/10.06.30 (XS2181347183), 1,2500 % European Investment Bank 14/13.11.26 MTN (XS1107718279), 2,7500 % European Investment Bank 28/28.07.2028 S.EARN (XS2587298204), 2,3000 % Germany 23/15.02.2033 S.G (DE000BU3Z005), 0,7500 % Intesa Sanpaolo 19/04.12.24 MTN (XS2089368596), 5,1250 % Intesa Sanpaolo 23/29.08.2031 MTN (XS2673808726), 5,0000 % Intesa Sanpaolo 23/08.03.2028 MTN (XS2592650373), 1,3750 % La Banque Postale 19/24.04.29 MTN (FR0013415692), 0,3750 % LB Baden-Württemberg 19/29.07.26 MTN (DE000LB2CLH7), 0,3750 % LB Baden-Württemberg 20/18.02.27 MTN (DE000LB2CRG6), 0,2500 % LB Baden-Württemberg 21/21.07.28 MTN (DE000LB2V7C3), 0,2500 % Lettland Republik 21/23.01.30 MTN (XS2420426038), 0,5000 % Netherlands 19/15.01.40 (NL0013552060), 6,0000 % Raiffeisen Bank International 23/15.09.2028 MTN (XS2682093526), 4,8750 % SBAB 23/26.06.2026 MTN (XS2641720987), 0,0100 % Sparebanken Vest Boligkreditt 20/28.06.27 MTN PF (XS2199484929), 6,5000 % Stichting AK Rabobank Certificaten 13/Und. (XS1002121454), 0,0000 % Unedic 20/25.11.28 MTN (FR0014000667), 0,0100 % UniCredit Bank GmbH 21/28.09.2026 MTN (DE000HV2AYN4), 5,9707 % BNP Paribas 86/und (FR0008131403), 2,1250 % Caisse Amortism. Dette Soc. 22/26.01.32 Reg S (XS2436433333), 3,7500 % European Investment Bank 23/14.02.2033 (US298785JV96)	

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Anhang gemäß § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert Klasse A: EUR 117,60
Anteilwert Klasse B: EUR 118,10

Umlaufende Anteile Klasse A: 5.744.020,795
Umlaufende Anteile Klasse B: 841.023,357

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände:

Die Bewertung erfolgt durch die Verwahrstelle unter Mitwirkung der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Verwahrstelle stützt sich hierbei grundsätzlich auf externe Quellen.

Sofern keine handelbaren Kurse vorliegen, werden Bewertungsmodelle zur Preisermittlung (abgeleitete Verkehrswerte) genutzt, die zwischen Verwahrstelle und Kapitalverwaltungsgesellschaft abgestimmt sind und sich so weit als möglich auf Marktparameter stützen. Diese Vorgehensweise unterliegt einem permanenten Kontrollprozess. Preisauskünfte Dritter werden durch andere Preisquellen, modellhafte Rechnungen oder durch andere geeignete Verfahren auf Plausibilität geprüft.

Die in diesem Bericht ausgewiesenen Anlagen werden in geringem Maße zu abgeleiteten Verkehrswerten bewertet.

Die in Klammer aufgeführten Buchstaben-Kennzeichnung N gibt bei den einzelnen Werten an, dass die Nachhaltigkeitskriterien gemäss § 27 Abs. 1 der Besonderen Vertragsbedingungen erfüllt sind.

Für die Investmentanteile sind in der Vermögensaufstellung in Klammern die aktuellen Verwaltungsvergütungs-/Kostenpauschalsätze zum Berichtsstichtag für die im Wertpapiervermögen enthaltenen Sondervermögen aufgeführt. Das Zeichen + bedeutet, dass darüber hinaus ggf. eine erfolgsabhängige Vergütung berechnet werden kann. Da das Sondervermögen im Berichtszeitraum andere Investmentanteile („Zielfonds“) hielt, können weitere Kosten, Gebühren und Vergütungen auf Ebene des Zielfonds angefallen sein.

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Angaben gemäß Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (WpFinGesch.) und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 – Ausweis nach Abschnitt A

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
Angaben in Fondswährung			
1. Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	97.040.941,83	-	-
in % des Fondsvermögens	12,52	-	-
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name	BofA Securities Europe S.A., Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	22.772.285,00		
Sitzstaat	Frankreich		
2. Name	UBS AG London Branch, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	20.515.335,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
3. Name	HSBC Continental Europe S.A., Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	13.494.335,00		
Sitzstaat	Frankreich		
4. Name	Barclays Bank Ireland PLC, Dublin		
Bruttovolumen offene Geschäfte	13.203.065,32		
Sitzstaat	Irland		
5. Name	BNP Paribas S.A. Arbitrage, Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	12.986.098,86		
Sitzstaat	Frankreich		
6. Name	Royal Bank of Canada, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	3.948.583,72		
Sitzstaat	Großbritannien		
7. Name	Goldman Sachs AG, Frankfurt am Main		
Bruttovolumen offene Geschäfte	3.825.977,36		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

8. Name	Deutsche Bank AG, Frankfurt am Main		
Bruttovolumen offene Geschäfte	3.590.247,50		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
9. Name	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1.900.057,00		
Sitzstaat	Frankreich		
10. Name	Nomura Financial Products Europe GmbH, Frankfurt am Main		
Bruttovolumen offene Geschäfte	804.957,08		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		

3. Art(en) von Abwicklung und Clearing

(z.B. zweiseitig, dreiseitig, zentrale Gegenpartei)	zweiseitig	-	-
---	------------	---	---

4. Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)

unter 1 Tag	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-
über 1 Jahr	-	-	-
unbefristet	97.040.941,83	-	-

5. Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten

Art(en):			
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	44.052.700,82	-	-
Aktien	62.654.555,87	-	-
Sonstige	1.586.479,73	-	-
Qualität(en):	Dem Fonds werden – soweit Wertpapier-Darlehensgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte oder Geschäfte mit OTC-Derivaten (außer Währungstermingeschäften) abgeschlossen werden - Sicherheiten in einer der folgenden Formen gestellt: – liquide Vermögenswerte wie Barmittel, kurzfristige Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente gemäß Definition in Richtlinie 2007/16/EG vom 19. März 2007, Akkreditive und Garantien auf erstes Anfordern, die von erstklassigen, nicht mit dem Kontrahenten verbundenen Kreditinstituten ausgegeben werden, beziehungsweise von einem OECD-Mitgliedstaat oder dessen Gebietskörperschaften oder von supranationalen Institutionen und Behörden auf kommunaler, regionaler oder internationaler Ebene begebene Anleihen unabhängig von ihrer Restlaufzeit – Anteile eines in Geldmarktinstrumente anlegenden Organismus für gemeinsame Anlagen (nachfolgend „OGA“), der täglich einen Nettoinventarwert berechnet und der über ein Rating von AAA oder ein vergleichbares Rating verfügt – Anteile eines OGAW, der vorwiegend in die unter den nächsten beiden Gedankenstrichen aufgeführten Anleihen / Aktien anlegt – Anleihen unabhängig von ihrer Restlaufzeit, die ein Mindestrating von niedrigem Investment-Grade aufweisen – Aktien, die an einem geregelten Markt eines Mitgliedstaats der Europäischen Union oder an einer Börse eines OECD-Mitgliedstaats zugelassen sind oder gehandelt werden, sofern diese Aktien in einem wichtigen Index enthalten sind. Die Verwaltungsgesellschaft behält sich vor, die Zulässigkeit der oben genannten Sicherheiten einzuschränken. Des Weiteren behält sich die Verwaltungsgesellschaft vor, in Ausnahmefällen von den oben genannten Kriterien abzuweichen. Weitere Informationen zu Sicherheitenanforderungen befinden sich in dem Verkaufsprospekt des Fonds/Teilfonds.		

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

6. Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Währung(en):	EUR; GBP; JPY; USD; SEK; NOK; CAD; CHF; AUD; DKK	-	-

7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)			
unter 1 Tag	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-
über 1 Jahr	-	-	-
unbefristet	108.293.736,42	-	-

8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich) *			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	87.613,42	-	-
in % der Bruttoerträge	70,00	-	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	-

Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	37.548,08	-	-
in % der Bruttoerträge	30,00	-	-
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft	-	-	-

Ertragsanteil Dritter			
absolut	-	-	-
in % der Bruttoerträge	-	-	-
Kostenanteil Dritter	-	-	-

9. Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
absolut	-		

10. Verleihe Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds			
Summe	97.040.941,83		
Anteil	12,71		

11. Die 10 größten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
1. Name	Belgium, Kingdom of		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	15.519.394,79		
2. Name	Aktia Bank PLC		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	5.195.677,24		

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

3. Name	French Republic		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	5.079.107,94		
4. Name	Bankinter S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3.417.620,38		
5. Name	UniCredit S.p.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2.540.510,15		
6. Name	Kreditanstalt für Wiederaufbau		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2.212.208,95		
7. Name	Novo-Nordisk AS		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2.181.383,82		
8. Name	Novonesis A/S		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2.181.272,68		
9. Name	Ferrovial SE		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2.181.270,73		
10. Name	AGEAS SA/NV		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2.181.258,22		
12. Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
Anteil	-		
13. Verwahrart begebener Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps (In % aller begebenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps)			
gesonderte Konten / Depots	-	-	
Sammelkonten / Depots	-	-	
andere Konten / Depots	-	-	
Verwahrart bestimmt Empfänger	-	-	

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

14. Verwahrer/Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps			
Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	1	-	-
1. Name	State Street Bank International GmbH (Custody Operations)		
verwahrter Betrag absolut	108.293.736,42		

* Eventuelle Abweichungen zu den korrespondierenden Angaben der detaillierten Ertrags- und Aufwandsrechnung beruhen auf Effekten im Rahmen des Ertragsausgleichs.

Geschäftsführung und Verwaltung

Kapitalverwaltungsgesellschaft

DWS Investment GmbH
60612 Frankfurt am Main
Eigenmittel am 31.12.2023: 452,6 Mio. Euro
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital
am 31.12.2023: 115 Mio. Euro

Aufsichtsrat

Dr. Stefan Hoops
Vorsitzender
Vorsitzender der Geschäftsführung der
DWS Management GmbH,
(Persönlich haftende Gesellschafterin der
DWS Group GmbH & Co. KGaA),
Frankfurt am Main

Christof von Dryander
stellv. Vorsitzender
Senior Counsel der
Cleary Gottlieb Steen & Hamilton LLP,
Frankfurt am Main

Manfred Bauer
Geschäftsführer der
DWS Management GmbH,
(Persönlich haftende Gesellschafterin der
DWS Group GmbH & Co. KGaA),
Frankfurt am Main

Hans-Theo Franken
Vorsitzender des Aufsichtsrats der
Deutsche Vermögensberatung Aktiengesellschaft
DVAG, Frankfurt am Main

Dr. Alexander Ilgen
ehemals Deutsche Bank Private Bank,
Frankfurt am Main

Dr. Stefan Marcinowski
Ehemaliges Mitglied des Vorstandes der
BASF SE,
Oy-Mittelberg

Holger Naumann
Head of Operations
DWS Group GmbH & Co. KGaA,
Frankfurt am Main

Elisabeth Weisenhorn
Gesellschafterin und Geschäftsführerin der
Portikus Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Gerhard Wiesheu
Sprecher des Vorstands des Bankhauses
B. Metzler seel. Sohn & Co. AG,
Frankfurt am Main

Geschäftsführung

Dr. Matthias Liermann
Sprecher der Geschäftsführung

Sprecher der Geschäftsführung der
DWS International GmbH, Frankfurt am Main
Geschäftsführer der
DWS Beteiligungs GmbH, Frankfurt am Main
Mitglied des Aufsichtsrats der
DWS Investment S.A., Luxemburg
Geschäftsführer der
DIP Management GmbH, Frankfurt am Main
(Persönlich haftende Gesellschafterin an der
DIP Service Center GmbH & Co. KG)

Nicole Behrens
Geschäftsführerin

Geschäftsführerin der
DWS Beteiligungs GmbH, Frankfurt am Main

Petra Pflaum
Geschäftsführerin

Geschäftsführerin der
DWS Beteiligungs GmbH, Frankfurt am Main

Gero Schomann
Geschäftsführer

Geschäftsführer der
DWS International GmbH, Frankfurt am Main
Geschäftsführer der
DWS Beteiligungs GmbH, Frankfurt am Main
Mitglied des Verwaltungsrats der DB Vita S.A.,
Luxemburg
Stellvertretender Vorsitzender des Aufsichtsrats
der Deutscher Pensionsfonds AG, Köln

Vincenzo Vedda
Geschäftsführer

Geschäftsführer der
DWS Beteiligungs GmbH, Frankfurt am Main
Mitglied des Aufsichtsrats der
MorgenFund GmbH, Frankfurt am Main

Christian Wolff
Geschäftsführer

Geschäftsführer der
DWS Beteiligungs GmbH, Frankfurt am Main

Verwahrstelle

State Street Bank International GmbH
Brienner Straße 59
80333 München
Eigenmittel am 31.12.2023: 3.841,5 Mio. Euro
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital
am 31.12.2023: 109,4 Mio. Euro

Gesellschafter der DWS Investment GmbH

DWS Beteiligungs GmbH,
Frankfurt am Main

Stand: 30.6.2024

