

DWS Investment GmbH

# DeAM-Fonds BKN-HR

Halbjahresbericht 2022/2023



Investors for a new now

# **DeAM-Fonds BKN-HR**

# Inhalt

Halbjahresbericht 2022/2023  
vom 1.10.2022 bis 31.3.2023 (gemäß § 103 KAGB)

2 / Hinweise

4 / Halbjahresbericht  
DeAM-Fonds BKN-HR

# 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 hinzuge-rechnet. Die Berechnung der Wertentwicklung erfolgt nach der BVI-Methode.

Angaben zur bisherigen Wertentwicklung erlauben keine Prognosen für die Zukunft. Darüber hinaus ist in dem Bericht auch der entsprechende Vergleichsindex – soweit vorhanden – dargestellt. Alle Grafik- und Zahlenangaben geben den **Stand vom 31. März 2023** 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.

## Ausgabe- und Rücknahmepreise

Börsentäglich im Internet  
[www.dws.de](http://www.dws.de)

## Russland/Ukraine-Krise

---

Der Konflikt zwischen Russland und der Ukraine markiert einen dramatischen Wendepunkt in Europa, der unter anderem die Sicherheitsarchitektur und die Energiepolitik Europas nachhaltig beeinflusst und für erhebliche Volatilität gesorgt hat und auch weiterhin sorgen dürfte. Allerdings sind die konkreten bzw. möglichen mittel- bis langfristigen Auswirkungen der Krise auf die Konjunktur, einzelne Märkte und Branchen sowie die sozialen Implikationen angesichts der Unsicherheit zum Zeitpunkt der Aufstellung des vorliegenden Berichts nicht abschließend beurteilbar. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft des Sondervermögens setzt deshalb ihre Bemühungen im Rahmen ihres Risikomanagements fort, um diese Unsicherheiten bewerten und ihren möglichen Auswirkungen auf die Aktivitäten, die Liquidität und die Wertentwicklung des Sondervermögens begegnen zu können. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft ergreift alle als angemessen erachteten Maßnahmen, um die Anlegerinteressen bestmöglich zu schützen.

## Wesentliche Ereignisse nach dem Abschlussstichtag

---

Namensänderung: Der Fonds **DeAM-Fonds BKN-HR** wird mit Wirkung zum 15. April 2023 in **DWS Fonds ESG BKN-HR** umbenannt.

# Halbjahresbericht

# DeAM-Fonds BKN-HR

---

## DeAM-Fonds BKN-HR

### Überblick über die Anteilklassen

ISIN-Code	RC	DE0008498171
	FC	DE000DWS2Z37
Wertpapierkennnummer (WKN)	RC	849817
	FC	DWS2Z3
Fondswährung		EUR
Anteilklassenwährung	RC	EUR
	FC	EUR
Erstzeichnungs- und Auflegungsdatum	RC	1.6.1981 (seit 1.1.2019 als Anteilklasse RD, ab 1.10.2019 als Anteilklasse RC)
	FC	15.2.2019
Ausgabeaufschlag	RC	keinen
	FC	keinen
Verwendung der Erträge	RC	Thesaurierung
	FC	Thesaurierung
Verwaltungsvergütung	RC	0,15% p.a.
	FC	0,30% p.a.
Mindestanlagesumme	RC	keine
	FC	EUR 500.000
Erstausgabepreis	RC	DM 100
	FC	EUR 100

---

# DeAM-Fonds BKN-HR

## Vermögensübersicht zum 31.03.2023

	Bestand in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Anleihen (Emittenten):</b>		
Institute	83.615.410,20	39,41
Zentralregierungen	73.439.490,97	34,62
Unternehmen	17.967.719,60	8,47
Sonstige öffentliche Stellen	17.607.512,10	8,30
Sonst. Finanzierungsinstitutionen	15.080.293,30	7,11
Regionalregierungen	1.440.379,20	0,68
Sonstige	1.034.274,00	0,49
<b>Summe Anleihen:</b>	<b>210.185.079,37</b>	<b>99,08</b>
<b>2. Derivate</b>	<b>-117.646,80</b>	<b>-0,06</b>
<b>3. Bankguthaben</b>	<b>760.066,59</b>	<b>0,36</b>
<b>4. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>1.355.677,80</b>	<b>0,64</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		
<b>1. Sonstige Verbindlichkeiten</b>	<b>-39.528,71</b>	<b>-0,02</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>		
	<b>212.143.648,25</b>	<b>100,00</b>

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

# DeAM-Fonds BKN-HR

## Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>						<b>210.185.079,37</b>	<b>99,08</b>
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>							
0,7500 % ABB Finance 17/16.05.24 MTN (XS1613121422)	EUR	800			% 97,1790	777.432,00	0,37
3,2500 % ABB Finance 23/16.01.2027 MTN (XS2575555938)	EUR	240	240		% 99,3690	238.485,60	0,11
4,2500 % ABN AMRO Bank22/21.02.2030 MTN (XS2536941656)	EUR	900	900		% 99,6490	896.841,00	0,42
3,8750 % Acea 23/24.01.2031 MTN (XS2579284469)	EUR	660	660		% 98,5410	650.370,60	0,31
0,0000 % adidas 20/05.10.28 (XS2240505268)	EUR	200			% 83,7170	167.434,00	0,08
0,1250 % Agence Francaise de Developpement 21/29.09.31 (FR0014005NA6)	EUR	1.900			% 77,1180	1.465.242,00	0,69
1,0000 % Air Liquide Finance 20/02.04.25 MTN (FR0013505559)	EUR	100			% 95,6820	95.682,00	0,05
3,5000 % Arkema 23/23.01.31 (FR001400FAZ5)	EUR	300	300		% 97,9390	293.817,00	0,14
1,1250 % Autoroutes du Sud de la France 17/20.04.26 MTN (FR0013251170) <sup>3)</sup>	EUR	1.200			% 92,9970	1.115.964,00	0,53
0,7500 % Avinor 20/01.10.30 MTN (XS2239067379) <sup>3)</sup>	EUR	1.130			% 81,1240	916.701,20	0,43
3,7500 % AXA 22/12.10.2030 MTN (XS2537251170)	EUR	850	850		% 100,3650	853.102,50	0,40
0,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 19/15.11.26 MTN (XS2079713322)	EUR	400			% 88,8920	355.568,00	0,17
0,1250 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 21/24.03.27 MTN (XS232289385)	EUR	400	400		% 89,3980	357.592,00	0,17
4,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 22/14.10.2029 MTN (XS2545206166) <sup>3)</sup>	EUR	600	600		% 101,8720	611.232,00	0,29
3,3750 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 22/20.09.2027 MTN (XS2534785865)	EUR	300	300		% 97,8880	293.664,00	0,14
1,0000 % Banco BPM 18/23.01.25 MTN PF (IT0005321663)	EUR	1.000			% 95,4285	954.285,00	0,45
0,2500 % Banco Santander 19/10.07.29 PF (ES0413900566)	EUR	2.000	2.000		% 82,1510	1.643.020,00	0,77
0,2500 % Banco Santander 19/19.06.24 MTN (XS2014287937)	EUR	800			% 95,7670	766.136,00	0,36
3,6250 % Banco Santander 22/27.09.2026 MTN (XS2538366878)	EUR	700	700		% 98,9020	692.314,00	0,33
0,6250 % Banque Fédérative Crédit Mu. 21/03.11.28 MTN (FR0014003SA0)	EUR	200			% 81,9770	163.954,00	0,08
3,6250 % Banque Fédérative Crédit Mu. 22/14.09.2032 MTN (FR001400CMZ7)	EUR	900	900		% 97,8750	880.875,00	0,42
2,6250 % Banque Fédérative Crédit Mu.22/06.11.29 MTN (FR001400A3G4)	EUR	700	700		% 90,3240	632.268,00	0,30
0,1000 % Banque Federative Crédit Mut. 20/08.10.27 MTN (FR00140003P3)	EUR	500			% 85,2020	426.010,00	0,20
0,2500 % Banque Fédérative Crédit Mut. 21/29.06.28 MTN (FR0014004750)	EUR	900			% 83,9350	755.415,00	0,36
0,8750 % BASF 17/15.11.27 MTN (XS1718418103)	EUR	430			% 91,8500	394.955,00	0,19
1,5000 % BASF 22/17.03.31 MTN (XS2456247787)	EUR	200			% 86,4710	172.942,00	0,08
4,0000 % BASF 23/08.03.2029 MTN (XS2595418323)	EUR	1.100	1.100		% 102,1360	1.123.496,00	0,53
1,0000 % Belfius Bank 18/12.06.28 MTN PF (BE0002598762)	EUR	1.500			% 89,3370	1.340.055,00	0,63
0,0000 % Belfius Bank 19/28.08.26 MTN (BE6315719490)	EUR	400			% 87,3150	349.260,00	0,16
0,1250 % Belfius Bank 21/08.02.28 MTN (BE6326784566) <sup>3)</sup>	EUR	500			% 83,1870	415.935,00	0,20
0,8000 % Belgium 14/22.06.25 S.74 (BE0000334434)	EUR	2.000			% 95,7870	1.915.740,00	0,90
0,8750 % BMW Finance 17/03.04.25 MTN (XS1589881785) <sup>3)</sup>	EUR	710			% 95,9630	681.337,30	0,32
0,0000 % BMW Finance 21/11.01.26 MTN (XS2280845491) <sup>3)</sup>	EUR	300			% 91,8750	275.625,00	0,13
2,1000 % BNP Paribas 22/07.04.32 MTN (FR0014009LQ8)	EUR	1.000	1.000		% 83,6820	836.820,00	0,39
0,1250 % BPCE 19/04.12.24 MTN (FR0013464930)	EUR	300			% 94,4310	283.293,00	0,13
0,2500 % BPCE 21/14.01.31 (FR0014001G37)	EUR	500			% 75,0380	375.190,00	0,18
2,3750 % BPCE 22/26.04.32 MTN (FR0014009YC1)	EUR	800	800		% 88,0190	704.152,00	0,33
0,8750 % BPCE SFH 17/13.04.28 MTN PF (FR0013286820)	EUR	1.500			% 88,8310	1.332.465,00	0,63
3,1250 % BPCE SFH 22/24.01.2028 (FR001400DGZ7)	EUR	900	900		% 99,0470	891.423,00	0,42
0,0000 % Bpifrance Financement 21/25.05.28 MTN Reg S (FR0014003C70)	EUR	900			% 85,4640	769.176,00	0,36
1,2500 % bpost 18/11.07.26 (BE0002601798)	EUR	1.400			% 92,5540	1.295.756,00	0,61
3,0000 % Caisse d'Amortism. Dette Sociale 23/25.05.2028 MTN (FR001400F5U5)	EUR	600	600		% 99,5280	597.168,00	0,28
3,0000 % Caisse Francaise Fin. Local 13/02.10.28 MTN ÖPF (FR0011580588)	EUR	1.100	1.100		% 98,4170	1.082.587,00	0,51



## DeAM-Fonds BKN-HR

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
0,1250 % Caixa Montepio Geral ecó. ban. 19/14.11.24 MTN PF (PTCMGAOM0038)	EUR	800			% 94,5305	756.244,00	0,36
1,2500 % Caixabank 17/11.01.27 PF (ES0440609339)	EUR	700			% 92,0350	644.245,00	0,30
1,0000 % Caixabank 18/17.01.28 MTN PF (ES0440609396)	EUR	1.000	1.000		% 89,3630	893.630,00	0,42
0,7500 % Caja Rural de Navarra Soc.Cop.de Cr. 22/16.02.29 (ES0415306093)	EUR	1.200	1.200		% 86,1895	1.034.274,00	0,49
0,8750 % Caja Rural de Navarra Soc.Cop.de Cr.18/08.05.25 PF (ES0415306069)	EUR	1.100			% 94,5080	1.039.588,00	0,49
0,5000 % Cie. Financement Foncier 16/04.09.24 MTN PF (FR0013162302)	EUR	1.800			% 95,8900	1.726.020,00	0,81
1,7500 % Cloverie 14/16.09.24 MTN (XS1109950755)	EUR	800			% 96,8620	774.896,00	0,37
0,3750 % Cofiroute 16/07.02.25 MTN (FR0013201126)	EUR	800			% 94,5110	756.088,00	0,36
2,7500 % Commerzbank 22/08.12.2025 MTN PF (DE000CZ43ZJ6) <sup>3)</sup>	EUR	2.100	2.100		% 98,6110	2.070.831,00	0,98
1,1250 % Coöp. Rabobank (Utrecht Br.) 19/07.05.31 MTN (XS1991126431)	EUR	500	500		% 80,3440	401.720,00	0,19
0,3750 % Coöperatieve Rabobank 21/01.12.27 MTN (XS2416413339)	EUR	400			% 86,9340	347.736,00	0,16
0,3750 % Crédit Agricole 21/20.04.28 MTN (FR0014003182)	EUR	200			% 82,9030	165.806,00	0,08
1,8750 % Crédit Agricole 22/22.04.27 (FR0014009UH8)	EUR	600	600		% 92,8700	557.220,00	0,26
3,3750 % Crédit Agricole 22/28.07.2027 MTN (FR001400E7J5) <sup>3)</sup>	EUR	500	500		% 97,8600	489.300,00	0,23
0,8750 % Credit Agricole Home Loan SFH 22/31.08.27 MTN PF (FR0014009ED1)	EUR	900			% 90,1440	811.296,00	0,38
1,2500 % Credit Mutuel Arkea 20/11.06.29 MTN (FR0013517307)	EUR	600			% 85,3230	511.938,00	0,24
0,6250 % Crédit Mutuel Home Loan SFH 18/02.02.26 MTN PF (FR0013313020)	EUR	1.000			% 92,5840	925.840,00	0,44
1,1250 % Croatia 19/19.06.29 Reg S (XS1843434876)	EUR	4.910	4.910		% 86,0260	4.223.876,60	1,99
1,5000 % Croatia 20/17.06.31 (XS2190201983)	EUR	4.940	4.940		% 84,1000	4.154.540,00	1,96
0,1250 % Deutsche Börse 21/22.02.31 (DE000A3H2465)	EUR	1.000			% 77,6070	776.070,00	0,37
0,0100 % Deutsche Pfandbriefbank 19/15.10.25 MTN (DE000A2YNVVM)	EUR	1.000	1.000		% 92,0185	920.185,00	0,43
4,0000 % DNB Bank ASA 23/14.03.2029 MTN (XS2597696124)	EUR	1.000	1.200	200	% 101,1310	1.011.310,00	0,48
0,0100 % DNB Boligkredit 21/21.01.31 (XS2289593670)	EUR	1.300			% 77,8280	1.011.764,00	0,48
0,5000 % DZ HYP 18/13.11.25 MTN PF (DE000A2G9HE4)	EUR	1.000			% 92,9890	929.890,00	0,44
0,8750 % Enxsis Holding 16/28.04.26 MTN (XS1396367911)	EUR	900			% 92,6730	834.057,00	0,39
1,6250 % Erste Group Bank 20/08.09.31 MTN (AT0000A2J645)	EUR	400	400		% 87,4450	349.780,00	0,16
0,1250 % Euroclear Bank 20/07.07.25 MTN (BE6322991462)	EUR	810			% 92,9340	752.765,40	0,35
0,5000 % European Union 18/04.04.25 MTN (EU000A19VVY6)	EUR	2.140			% 94,9930	2.032.850,20	0,96
0,0000 % European Union 21/04.07.29 MTN (EU000A3KRJQ6)	EUR	1.100			% 83,2600	915.860,00	0,43
0,0000 % European Union 21/04.07.31 MTN (EU000A3KSXE1)	EUR	1.400			% 78,3700	1.097.180,00	0,52
0,8000 % European Union 22/04.07.25 S.NGEU (EU000A3K4DJ5)	EUR	800			% 95,1380	761.104,00	0,36
0,5000 % Finland 19/15.09.29 (FI4000369467)	EUR	2.500	2.500		% 86,3320	2.158.300,00	1,02
0,7500 % France 17/25.11.28 (FR0013341682)	EUR	6.300			% 89,7770	5.655.951,00	2,67
2,2500 % France O.A.T 13/25.05.24 (FR0011619436)	EUR	4.000	4.000		% 99,1170	3.964.680,00	1,87
0,2500 % France O.A.T. 13/25.07.24 INFL (FR0011427848)	EUR	711			% 101,5510	878.843,73	0,41
0,7500 % Frankreich 22/25.02.28 O.A.T. (FR001400AIN5)	EUR	10			% 90,8590	9.085,90	0,00
0,1000 % Germany 15/15.04.26 INFL (DE0001030567)	EUR	500			% 100,4610	606.131,44	0,29
0,2500 % Germany 19/15.02.29 (DE0001102465)	EUR	1.000			% 88,7150	887.150,00	0,42
0,0000 % Germany 20/15.05.35 (DE0001102515)	EUR	400	11.710	11.310	% 74,9030	299.612,00	0,14
5,6250 % Germany 98/04.01.28 (DE0001135069)	EUR	80	20.170	20.090	% 114,3630	91.490,40	0,04
1,1250 % Hannover Rück 18/18.04.28 (XS1808482746) <sup>3)</sup>	EUR	900			% 88,1810	793.629,00	0,37
1,3750 % Heimstaden Bostad Treasury 20/03.03.27 MTN (XS2225207468)	EUR	640	640		% 79,8900	511.296,00	0,24
4,1250 % Heineken 23/23.03.2035 MTN (XS2599169922)	EUR	990	990		% 101,6480	1.006.315,20	0,47
0,0000 % Hemso Treasury 21/19.01.28 MTN (XS2281473111)	EUR	270			% 78,3670	211.590,90	0,10

## DeAM-Fonds BKN-HR

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
0,8750 % HSBC Holdings 16/06.09.24 MTN (XS1485597329)	EUR	530			% 96,1540	509.616,20	0,24
0,1250 % HYPO NOE Landesbk. f.NOE& Wien 21/23.06.31 OPF (AT0000A2RY95)	EUR	3.000			% 77,1010	2.313.030,00	1,09
2,7500 % ING Bank 22/21.11.2025 MTN PF (XS2557551889)	EUR	2.000	2.000		% 98,5190	1.970.380,00	0,93
5,2500 % ING Groep 22/14.11.2033 MTN (XS2554745708)	EUR	800	800		% 104,1670	833.336,00	0,39
3,0500 % Instituto de Credito Oficial 23/31.10.2027 MTN (XS2586947082)	EUR	530	530		% 99,5710	527.726,30	0,25
0,3750 % Intesa Sanpaolo 16/14.09.26 MTN PF (IT0005215147) <sup>3)</sup>	EUR	1.645			% 90,2020	1.483.822,90	0,70
5,2500 % Intesa Sanpaolo 22/13.01.2030 MTN (XS2545759099)	EUR	830	830		% 103,2920	857.323,60	0,40
2,7500 % Investor 22/10.06.2032 (XS2481287634)	EUR	540			% 93,2770	503.695,80	0,24
0,9000 % Ireland 18/15.05.28 (IE00BDHDP44)	EUR	10			% 91,3570	9.135,70	0,00
1,3500 % Ireland 18/18.03.31 (IE00BFZRQ242)	EUR	3.470			% 90,2980	3.133.340,60	1,48
0,7500 % Kering 20/13.05.28 MTN (FR0013512407)	EUR	1.000			% 87,8500	878.500,00	0,41
1,1250 % Knorr-Bremse 18/13.06.25 MTN (XS1837288494)	EUR	590			% 95,2570	562.016,30	0,26
3,5000 % Koninklijke Ahold Delhaize 23/04.04.2028 (XS2596537972)	EUR	450	450		% 99,6100	448.245,00	0,21
0,8750 % La Banque Postale Home Loan SFH 18/07.02.28 PF (FR0013313855)	EUR	1.200		700	% 89,4630	1.073.556,00	0,51
3,0000 % La Banque Postale Home Loan SFH 23/31.01.2031 MTN (FR001400FD12) <sup>3)</sup>	EUR	2.300	2.300		% 98,1290	2.256.967,00	1,06
0,6250 % Legrand 19/24.06.28 (FR0013428943)	EUR	400			% 86,6380	346.552,00	0,16
0,2500 % Linde Finance 20/19.05.27 (XS2177021271)	EUR	400			% 88,3730	353.492,00	0,17
0,5000 % Lithuania 19/19.06.29 MTN (XS2013677864)	EUR	2.830			% 82,3870	2.331.552,10	1,10
0,7500 % Lithuania 20/06.05.30 MTN (XS2168038847)	EUR	6.700			% 81,4770	5.458.959,00	2,57
1,6250 % Logicor Financing 19/15.07.27 MTN (XS2027364327)	EUR	630	630		% 78,9290	497.252,70	0,23
0,2500 % LSEG Netherlands 21/06.04.28 MTN (XS2327299298) <sup>3)</sup>	EUR	670			% 85,5970	573.499,90	0,27
0,2500 % Medtronic Global Holdings 19/02.07.25 (XS2020670779)	EUR	360			% 93,1970	335.509,20	0,16
1,8750 % Merck Financial Services 22/15.06.2026 MTN (XS2491029208)	EUR	600			% 95,3880	572.328,00	0,27
1,5000 % Nestlé Finance Internationa 20/01.04.30 MTN (XS2148390755)	EUR	870			% 88,9180	773.586,60	0,36
0,8750 % Nestlé Finance International 22/29.03.27 MTN (XS2462321212)	EUR	500			% 91,7500	458.750,00	0,22
0,5000 % Niedersachsen 16/08.06.26 A.863 LSA (DE000A2AAWN1)	EUR	1.560			% 92,3320	1.440.379,20	0,68
3,6250 % Nordea Bank 23/10.02.2026 MTN (XS2584643113)	EUR	820	820		% 99,5120	815.998,40	0,38
1,1250 % Novartis Finance 17/30.09.27 (XS1585010074)	EUR	420			% 90,8870	381.725,40	0,18
1,1250 % Novo Nordisk Finance (Netherlands) 22/30.09.27 MTN (XS2449330179)	EUR	590			% 91,2780	538.540,20	0,25
1,0000 % OP Yrityspankki 18/22.05.25 MTN (XS1823485039)	EUR	740			% 94,3550	698.227,00	0,33
0,6250 % OP-Asuntoluottopankki 19/15.02.29 MTN PF (XS1951927158)	EUR	1.540			% 86,4310	1.331.037,40	0,63
3,6250 % Orsted 23/01.03.2026 MTN (XS2591026856)	EUR	810	810		% 100,3560	812.883,60	0,38
4,5000 % Pandora 23/10.04.2028 MTN (XS2596599147)	EUR	420	420		% 100,9180	423.855,60	0,20
1,7500 % ProLogis International Funding II 18/15.03.28 MTN (XS1789176846)	EUR	310			% 88,0740	273.029,40	0,13
4,7500 % Raiffeisen Bank Int 23/26.01.2027 (XS2579606927)	EUR	700	700		% 97,3480	681.436,00	0,32
2,0000 % Royal Schiphol Group 20/06.04.29 MTN (XS2153459123)	EUR	1.170			% 91,5240	1.070.830,80	0,50
0,2500 % Santander Consumer Bank 19/15.10.24 MTN (XS2063659945)	EUR	700	300		% 94,2480	659.736,00	0,31
1,6250 % SAP 18/10.03.31 (DE000A2TSTG3)	EUR	900			% 87,5220	787.698,00	0,37
3,3750 % Schneider Electric 23/06.04.2025 MTN (FR001400H5F4)	EUR	300	300		% 99,8520	299.556,00	0,14
0,1250 % Siemens Financieringsmaatschappij 19/05.09.29 (XS2049616621) <sup>3)</sup>	EUR	840			% 84,0620	706.120,80	0,33
0,8750 % Sika Capital 19/29.04.27 (XS1986416268)	EUR	700			% 89,7720	628.404,00	0,30
0,3750 % Skandinaviska Enskilda Banken 21/21.06.28 MTN (XS2356049069)	EUR	480			% 81,6960	392.140,80	0,18
0,1250 % Slovenska Sporitelna Bratislava 19/12.06.26 MTN (SK4000015400)	EUR	800			% 89,9050	719.240,00	0,34

## DeAM-Fonds BKN-HR

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
0,2500 % Soci�t� G�n�rale 21/08.07.27 MTN (FR0014004GE5)	EUR	600			% 85,6130	513.678,00	0,24
5,1500 % Spain 13/31.10.28 (ES00000124C5)	EUR	2.380	2.380		% 110,3760	2.626.948,80	1,24
0,5000 % Spain 20/30.04.30 (ES0000012F76)	EUR	3.820	3.820		% 83,4970	3.189.585,40	1,50
1,2500 % Spain 20/31.10.30 (ES0000012G34)	EUR	2.000	2.000		% 87,2050	1.744.100,00	0,82
0,0500 % SpareBank 1 Boligkredit 21/03.11.28 PF (XS2404591161)	EUR	1.310			% 83,5960	1.095.107,60	0,52
0,0100 % SR-Boligkredit 21/10.03.31 MTN PF (XS2312584779)	EUR	1.310			% 77,2560	1.012.053,60	0,48
0,0000 % Stedin Holding 21/16.11.26 MTN (XS2407985220)	EUR	380			% 88,7440	337.227,20	0,16
4,3750 % Stellantis 23/14.03.2030 MTN (XS2597110027) <sup>3)</sup>	EUR	1.260	1.260		% 101,0580	1.273.330,80	0,60
0,0500 % Svenska Handelsbanken (publ) 19/03.09.26 MTN (XS2049582542)	EUR	650			% 87,3480	567.762,00	0,27
0,7500 % Telenor 19/31.05.26 MTN (XS2001737324)	EUR	950			% 91,2480	866.856,00	0,41
0,2500 % UBS Group 21/24.02.28 (CH0595205524)	EUR	340			% 81,1590	275.940,60	0,13
2,7500 % UBS Group 22/15.06.27 MTN (CH1194000340)	EUR	950			% 94,0720	893.684,00	0,42
3,2500 % Unilever Finance Netherlands 23/23.02.2031 MTN (XS2591848275)	EUR	450	450		% 98,7080	444.186,00	0,21
0,8750 % Van Lanschot Kempen 17/15.02.27 MTN PF (XS1565570212)	EUR	1.800	1.800		% 91,0360	1.638.648,00	0,77
4,1250 % Vestas Wind Systems 23/15.06.2026 MTN (XS2597973812)	EUR	270	270		% 100,9950	272.686,50	0,13
0,3750 % Volksbank Wien 19/04.03.26 (AT000B122031)	EUR	1.000			% 91,4050	914.050,00	0,43
<b>Verbriefte Geldmarktinstrumente</b>							
0,1250 % Agence Francaise de Developpement 17/15.11.23 MTN (FR0013296373)	EUR	2.200			% 98,0070	2.156.154,00	1,02
0,3750 % Aktia Bank 18/30.05.23 PF MTN (XS1827629384)	EUR	1.900			% 99,6050	1.892.495,00	0,89
1,7500 % Austria 13/20.10.23 (AT0000A105W3)	EUR	2.050			% 99,3840	2.037.372,00	0,96
0,6250 % Banco BPM 16/08.06.23 MTN PF (IT0005199465)	EUR	1.635			% 99,5480	1.627.609,80	0,77
0,2000 % Belgium 16/22.10.23 S.79 (BE0000339482)	EUR	1.730	2.950	11.420	% 98,5230	1.704.447,90	0,80
0,0000 % BNP Paribas Fortis 16/24.10.23 MTN PF (BE0002265347)	EUR	1.200			% 98,1370	1.177.644,00	0,56
0,8750 % Credit Agricole Italia 15/16.06.23 MTN PF (IT0005121592)	EUR	3.000			% 99,5500	2.986.500,00	1,41
0,3750 % DNB Boligkredit 18/14.11.23 PF MTN (XS1909061597)	EUR	2.140			% 98,2370	2.102.271,80	0,99
0,2500 % DZ HYP 18/30.06.23 R.1203 PF (DE000A2G9HC8)	EUR	3.470			% 99,3620	3.447.861,40	1,63
0,3750 % Erste Group Bank 19/16.04.24 MTN (XS1982725159)	EUR	600			% 96,6540	579.924,00	0,27
1,8750 % European Union 14/04.04.24 MTN (EU000A1ZE225)	EUR	2.070			% 98,7370	2.043.855,90	0,96
0,8500 % Fdo. Tit. Deficit Sist. Elec. 18/17.12.23 (ES0378641320)	EUR	1.800			% 98,2310	1.768.158,00	0,83
0,0000 % Finland 16/15.09.23 (FI4000219787)	EUR	5.880		700	% 98,7240	5.804.971,20	2,74
0,0000 % France 18/25.03.24 (FR0013344751)	EUR	11.000	11.000		% 97,0820	10.679.020,00	5,03
4,2500 % France O.A.T. 06/25.10.23 (FR0010466938)	EUR	2.070	6.270	4.200	% 100,6560	2.083.579,20	0,98
0,2500 % Ibercaja Banco 16/18.10.23 PF (ES0444251047)	EUR	2.800			% 98,3180	2.752.904,00	1,30
3,4000 % Ireland 14/18.03.24 (IE00B6X95T99)	EUR	6.000			% 100,3820	6.022.920,00	2,84
0,1250 % LB Baden-W�rttemberg 18/27.06.23 MTN PF (DE000LB1P9C8)	EUR	1.300			% 99,3560	1.291.628,00	0,61
0,5000 % Lloyds Bank 16/11.04.23 MTN PF (XS1391589626)	EUR	900			% 99,9460	899.514,00	0,42
3,6250 % Mediobanca - Banca Credito Fin. 13/17.10.23 MTN PF (IT0004966716)	EUR	1.860			% 100,1170	1.862.176,20	0,88
0,2500 % OP-Asuntoluottopankki 16/11.05.23 MTN PF (XS1408380803)	EUR	1.700			% 99,7350	1.695.495,00	0,80
1,0000 % Santander Consumer Finance 19/27.02.24 MTN (XS1956025651) <sup>3)</sup>	EUR	800			% 97,5040	780.032,00	0,37
0,0000 % SAP 20/17.05.23 MTN (XS2176715311)	EUR	200			% 99,6190	199.238,00	0,09
0,0000 % Schneider Electric 20/12.06.23 MTN (FR0013517711)	EUR	200			% 99,3990	198.798,00	0,09
2,2500 % UNEDIC 13/05.04.23 MTN (FR0011462746)	EUR	8.200			% 99,9970	8.199.754,00	3,87
0,2500 % UNEDIC 16/24.11.23 MTN (FR0013142809)	EUR	2.000			% 97,9870	1.959.740,00	0,92
0,3750 % Yorkshire Building Society 17/11.04.23 MTN PF (XS1594364033)	EUR	1.250			% 99,9520	1.249.400,00	0,59
<b>Summe Wertpapierverm�gen</b>						<b>210.185.079,37</b>	<b>99,08</b>

## DeAM-Fonds BKN-HR

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
<b>Derivate</b>							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
<b>Zins-Derivate</b> (Forderungen / Verbindlichkeiten)						<b>-117.646,80</b>	<b>-0,06</b>
<b>Zinsterminkontrakte</b>							
EURO-BOBL JUN 23 (EURX) .....	EUR	-39.700				-7.088,49	0,00
EURO-BUND JUN 23 (EURX) .....	EUR	-4.900				-110.558,31	-0,05
<b>Bankguthaben und nicht verbriefte Geldmarktinstrumente</b>						<b>760.066,59</b>	<b>0,36</b>
<b>Bankguthaben</b>							
<b>Verwahrstelle (täglich fällig)</b>							
EUR - Guthaben .....	EUR	760.066,59		%	100	760.066,59	0,36
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							
Zinsansprüche .....	EUR	1.344.322,33		%	100	1.344.322,33	0,63
Sonstige Ansprüche .....	EUR	11.355,47		%	100	11.355,47	0,01
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen .....	EUR	-36.122,06		%	100	-36.122,06	-0,02
Andere sonstige Verbindlichkeiten .....	EUR	-3.406,65		%	100	-3.406,65	0,00
<b>Fondsvermögen</b>						<b>212.143.648,25</b>	<b>100,00</b>

Anteilwert bzw. umlaufende Anteile	Stück bzw. Whg.	Anteilwert in der jeweiligen Whg.
<b>Anteilwert</b>		
Klasse RC .....	EUR	52,47
Klasse FC .....	EUR	95,65
<b>Umlaufende Anteile</b>		
Klasse RC .....	Stück	2.501.428,000
Klasse FC .....	Stück	845.765,000

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

### Marktschlüssel

#### Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

### Fußnoten

3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 11.243.695,80.

## DeAM-Fonds BKN-HR

### 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
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>			
2,1000 % Bundanl.V.22/15.11.2029 (DE0001102622) .....	EUR	1.670	1.670
0,0000 % Bundesrepub. Deutschland 21/15.08.31 (DE0001030732) .....	EUR	7.000	7.070
0,0000 % Bundesrepub. Deutschland 22/15.02.32 (DE0001102580) .....	EUR	14.140	14.140
2,3000 % Bundesrepublik Deutschland 23/15.02.2033 (DE000BU2Z007) .....	EUR	18.520	18.520
0,0000 % Deutschland, Bundesrepublik 20/15.11.27 (DE0001102523) .....	EUR	2.460	2.460
0,0000 % Deutschland, Bundesrepublik 19/15.08.50 (DE0001102481) .....	EUR	3.570	3.570
1,7000 % Deutschland, Bundesrepublik 22/15.08.2032 (DE0001102606) .....	EUR	12.650	12.650
5,7500 % France O.A.T. 00/25.10.32 (FR0000187635) .....	EUR	1.670	1.670
4,7500 % France O.A.T. 03/25.04.35 (FR0010070060) .....	EUR	1.730	1.730
0,5000 % Germany 18/15.02.28 (DE0001102440) .....	EUR	9.730	9.790
0,0100 % Hypo Tirol Bank 21/11.03.31 MTN (AT0000A2QDQ2) .....	EUR		1.500
0,0100 % Medio Banca di Credito Finanziario 21/03.02.31 (IT0005433757) .....	EUR		2.110
0,8750 % Raiffeis.lb. Niederösterreich-Wien 18/24.01.28 MTN (XS1756364474) .....	EUR		1.600
0,6960 % TotalEnergies Capital Intern. 19/31.05.28 MTN (XS2004381674) .....	EUR		400
0,9520 % TotalEnergies Capital Intern. 20/18.05.31 MTN (XS2176605306) .....	EUR		800
0,6250 % UniCredit Bank Austria19/16.01.26 PF (AT000B049739) .....	EUR		1.000
<b>Verbriefte Geldmarktinstrumente</b>			
0,0000 % Austria 16/15.07.23 (AT0000A1PE50) ..	EUR	2.130	10.910
0,0000 % Austria 20/20.04.23 MTN (AT0000A2EJZ6) .....	EUR	6.000	6.000
2,2500 % Belgium 13/22.06.23 (BE0000328378) ..	EUR	2.130	11.710
0,8750 % Caixa Económica Montepio Geral 17/17.10.22 MTN PF (PTCMGTOM0029) .....	EUR		700
1,0000 % Caixabank 16/14.03.23 PF (ES0413307127) .....	EUR		2.800
0,0000 % Deutschland, Bundesrepublik 21/16.06.23 (DE0001104842) .....	EUR	11.000	11.000
1,7500 % France O.A.T. 12/25.05.23 (FR0011486067) .....	EUR		9.610
2,2500 % France O.A.T. 12/25.10.22 (FR0011337880) .....	EUR		4.200
8,5000 % France O.A.T. 92/25.04.23 (FR0000571085) .....	EUR		9.930
0,0000 % France O.A.T.17/25.03.23 (FR0013283686) .....	EUR	4.840	10.840
0,0000 % Germany 18/14.04.23 S.177 (DE0001141778) .....	EUR	2.170	2.170
0,0000 % Ireland 17/18.10.22 (IE00BDHDPQ37) .....	EUR		6.500
3,7500 % Netherlands 06/15.01.23 (NL0000102275) .....	EUR		1.240
1,7500 % Netherlands 13/15.07.23 (NL0010418810) .....	EUR	4.310	4.310
0,8750 % UNEDIC 14/25.10.22 MTN (FR0012143451) .....	EUR		1.400

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

	Volumen in 1.000
<b>Terminkontrakte</b>	
<b>Zinsterminkontrakte</b>	
Verkaufte Kontrakte: (Basiswerte: EURO BUXL 30YR BOND MAR 23, EURO-BOBL DEC 22, EURO-BOBL MAR 23, EURO-BUND DEC 22, EURO-BUND MAR 23, EURO-SCHATZ DEC 22, EURO-SCHATZ MAR 23)	EUR 554.072

## DeAM-Fonds BKN-HR

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

unbefristet

Volumen in 1.000  
EUR 57.743

Gattung: 0,7500 % ABB Finance 17/16.05.24 MTN (XS1613121422), 4,2500 % ABN AMRO Bank22/21.02.2030 MTN (XS2536941656), 3,8750 % Acea 23/24.01.2031 MTN (XS2579284469), 0,7500 % Avinor 20/01.10.30 MTN (XS2239067379), 0,2500 % Banco Santander 19/19.06.24 MTN (XS2014287937), 3,6250 % Banque Fédérative Crédit Mu. 22/14.09.2032 MTN (FR001400CMZ7), 0,1000 % Banque Federative Crédit Mut. 20/08.10.27 MTN (FR00140003P3), 0,2500 % Banque Fédérative Crédit Mut. 21/29.06.28 MTN (FR0014004750), 0,8750 % BASF 17/15.11.27 MTN (XS1718418103), 0,1250 % Belfius Bank 21/08.02.28 MTN (BE6326784566), 0,2000 % Belgium 16/22.10.23 S.79 (BE0000339482), 0,8750 % BMW Finance 17/03.04.25 MTN (XS1589881785), 3,1250 % BPCE SFH 22/24.01.2028 (FR001400DGZ7), 3,0000 % Caisse d'Amortism. Dette Sociale 23/25.05.2028 MTN (FR001400F5U5), 3,0000 % Caisse Francaise Fin. Local 13/02.10.28 MTN ÖPF (FR0011580588), 1,2500 % Caixabank 17/11.01.27 PF (ES0440609339), 1,7500 % Cloverie 14/16.09.24 MTN (XS1109950755), 0,3750 % Cofiroute 16/07.02.25 MTN (FR0013201126), 3,3750 % Crédit Agricole 22/28.07.2027 MTN (FR001400E7J5), 0,8750 % Credit Agricole Home Loan SFH 22/31.08.27 MTN PF (FR0014009ED1), 0,1250 % Deutsche Börse 21/22.02.31 (DE000A3H2465), 0,3750 % DNB Boligkreditt 18/14.11.23 PF MTN (XS1909061597), 0,0100 % DNB Boligkreditt 21/21.01.31 (XS2289593670), 0,5000 % DZ HYP 18/13.11.25 MTN PF (DE000A2G9HE4), 0,1250 % Euroclear Bank 20/07.07.25 MTN (BE6322991462), 0,0000 % European Union 21/04.07.31 MTN (EU000A3KSXE1), 1,1250 % Hannover Rück 18/18.04.28 (XS1808482746), 0,8750 % HSBC Holdings 16/06.09.24 MTN (XS1485597329), 2,7500 % ING Bank 22/21.11.2025 MTN PF (XS2557551889), 5,2500 % ING Groep 22/14.11.2033 MTN (XS2554745708), 0,3750 % Intesa Sanpaolo 16/14.09.26 MTN PF (IT0005215147), 0,7500 % Kering 20/13.05.28 MTN (FR0013512407), 1,1250 % Knorr-Bremse 18/13.06.25 MTN (XS1837288494), 0,2500 % Linde Finance 20/19.05.27 (XS2177021271), 0,2500 % LSEG Netherlands 21/06.04.28 MTN (XS2327299298), 1,8750 % Merck Financial Services 22/15.06.2026 MTN (XS2491029208), 1,5000 % Nestlé Finance Internationa 20/01.04.30 MTN (XS2148390755), 0,8750 % Nestlé Finance International 22/29.03.27 MTN (XS2462321212), 1,1250 % Novo Nordisk Finance (Netherlands) 22/30.09.27 MTN (XS2449330179), 1,0000 % Santander Consumer Finance 19/27.02.24 MTN (XS1956025651), 1,6250 % SAP 18/10.03.31 (DE000A2TSTG3), 0,8750 % Sika Capital 19/29.04.27 (XS1986416268), 0,0000 % Stedin Holding 21/16.11.26 MTN (XS2407985220), 4,3750 % Stellantis 23/14.03.2030 MTN (XS2597110027), 0,0500 % Svenska Handelsbanken (publ) 19/03.09.26 MTN (XS2049582542), 0,7500 % Telenor 19/31.05.26 MTN (XS2001737324), 0,6960 % TotalEnergies Capital Intern. 19/31.05.28 MTN (XS2004381674), 0,9520 % TotalEnergies Capital Intern. 20/18.05.31 MTN (XS2176605306), 2,7500 % UBS Group 22/15.06.27 MTN (CH1194000340)

## DeAM-Fonds BKN-HR

---

### Anhang gemäß § 7 Nr. 9 KARBV

#### Sonstige Angaben

Anteilwert Klasse RC: EUR 52,47  
Anteilwert Klasse FC: EUR 95,65

Umlaufende Anteile Klasse RC: 2.501.428,000  
Umlaufende Anteile Klasse FC: 845.765,000

#### 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. Preisankünfte Dritter werden durch andere Preisquellen, modellhafte Rechnungen oder durch andere geeignete Verfahren auf Plausibilität geprüft.

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

## DeAM-Fonds BKN-HR

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

Angaben in Fondswährung	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
<b>1. Verwendete Vermögensgegenstände</b>			
absolut	11.243.695,80	-	-
in % des Fondsvermögens	5,30	-	-
<b>2. Die 10 größten Gegenparteien</b>			
<b>1. Name</b>	Deutsche Bank AG, Frankfurt am Main		
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>	11.243.695,80		
<b>Sitzstaat</b>	Bundesrepublik Deutschland		
<b>2. Name</b>			
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>			
<b>Sitzstaat</b>			
<b>3. Name</b>			
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>			
<b>Sitzstaat</b>			
<b>4. Name</b>			
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>			
<b>Sitzstaat</b>			
<b>5. Name</b>			
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>			
<b>Sitzstaat</b>			
<b>6. Name</b>			
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>			
<b>Sitzstaat</b>			
<b>7. Name</b>			
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>			
<b>Sitzstaat</b>			
<b>8. Name</b>			
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>			
<b>Sitzstaat</b>			



## DeAM-Fonds BKN-HR

<b>9. Name</b>			
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>			
<b>Sitzstaat</b>			

<b>10. Name</b>			
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>			
<b>Sitzstaat</b>			

### 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	11.243.695,80	-	-

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

<b>Art(en):</b>			
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	12.647.811,64	-	-
Aktien	-	-	-
Sonstige	-	-	-

#### 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.

## DeAM-Fonds BKN-HR

Währung(en):	6. Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten		
	EUR	-	-

	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	12.647.811,64	-

	8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich) *		
	Ertragsanteil des Fonds		
	absolut	20.792,00	-
	in % der Bruttoerträge	69,00	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	

	Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft		
	absolut	9.483,84	-
	in % der Bruttoerträge	31,00	-
	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	11.243.695,80
Anteil	5,35	

	11. Die 10 größten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps		
	1. Name	International Development Association	
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4.408.911,13		
2. Name	European Union		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3.777.811,10		

## DeAM-Fonds BKN-HR

<b>3. Name</b>	Action Logement Services SAS		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	988.917,80		
<b>4. Name</b>	Comunidad Autónoma de Madrid		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	811.318,55		
<b>5. Name</b>	Slovakia, Republic of		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	744.620,00		
<b>6. Name</b>	Nordrhein-Westfalen, Land		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	741.418,57		
<b>7. Name</b>	Slovenia, Republic of		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	629.781,61		
<b>8. Name</b>	European Investment Bank (EIB)		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	446.296,54		
<b>9. Name</b>	International Bank for Reconstruction and Developm		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	98.736,34		
<b>10. Name</b>			
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>			
<b>12. Wiedergelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps</b>			
<b>Anteil</b>			-
<b>13. Verwahrart begebener Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps (In % aller begebenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps)</b>			
<b>gesonderte Konten / Depots</b>	-		-
<b>Sammelkonten / Depots</b>	-		-
<b>andere Konten / Depots</b>	-		-
<b>Verwahrart bestimmt Empfänger</b>	-		-

## DeAM-Fonds BKN-HR

---

### 14. Verwahrer/Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps

<b>Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer</b>	1	-	-
<b>1. Name</b>	State Street Bank International GmbH (Custody Operations)		
<b>verwahrter Betrag absolut</b>	12.647.811,64		

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

## Kapitalverwaltungsgesellschaft

DWS Investment GmbH  
60612 Frankfurt am Main  
Eigenmittel am 31.12.2022: 452,6 Mio. Euro  
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital  
am 31.12.2022: 115,0 Mio. Euro

## Aufsichtsrat

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

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

Hans-Theo Franken  
Vorsitzender des Aufsichtsrats  
Deutsche Vermögensberatung AG,  
Frankfurt am Main

Dr. Alexander Ilgen  
Deutsche Bank AG,  
Frankfurt am Main

Dr. Stefan Marcinowski  
Ludwigshafen

Prof. Christian Strenger  
The Germany Funds,  
New York

Elisabeth Weisenhorn  
Portikus Investment GmbH,  
Frankfurt am Main

Gerhard Wiesheu  
Mitglied des Vorstandes Bankhaus  
Metzler seel. Sohn & Co. AG,  
Frankfurt am Main

Susanne Zeidler  
Frankfurt am Main

## Geschäftsführung

Manfred Bauer  
Sprecher der Geschäftsführung

Mitglied der Geschäftsführung der  
DWS Management GmbH  
(Persönlich haftende Gesellschafterin der  
DWS Group GmbH & Co. KGaA),  
Frankfurt am Main  
Mitglied der Geschäftsführung der  
DWS Beteiligungs GmbH,  
Frankfurt am Main  
Mitglied des Aufsichtsrats der  
DWS Investment S.A.,  
Luxemburg

Dr. Matthias Liermann

Mitglied der Geschäftsführung der  
DWS International GmbH,  
Frankfurt am Main  
Mitglied der Geschäftsführung der  
DWS Beteiligungs GmbH,  
Frankfurt am Main  
Mitglied des Aufsichtsrats der  
DWS Investment S.A.,  
Luxemburg

Petra Pflaum

Mitglied der Geschäftsführung der  
DWS Beteiligungs GmbH,  
Frankfurt am Main

Gero Schomann (seit dem 4.4.2023)

Mitglied der Geschäftsführung der  
DWS International GmbH,  
Frankfurt am Main  
Mitglied der Geschäftsführung der  
DWS Beteiligungs GmbH,  
Frankfurt am Main

Vincenzo Vedda (seit dem 17.2.2023)  
Mitglied der Geschäftsführung der  
DWS Beteiligungs GmbH,  
Frankfurt am Main  
Mitglied des Aufsichtsrats der  
MorgenFund GmbH,  
Frankfurt am Main

Dirk Görgen (bis zum 31.12.2022)

Mitglied der Geschäftsführung der  
DWS Management GmbH  
(Persönlich haftende Gesellschafterin der  
DWS Group GmbH & Co. KGaA),  
Frankfurt am Main

Stefan Kreuzkamp (bis zum 31.12.2022)  
Frankfurt am Main

## Verwahrstelle

State Street Bank International GmbH  
Brienner Straße 59  
80333 München  
Eigenmittel am 31.12.2021:  
2.071,9 Mio. Euro  
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital  
am 31.12.2021: 109,4 Mio. Euro

## Gesellschafter der DWS Investment GmbH

DWS Beteiligungs GmbH,  
Frankfurt am Main

Stand: 4.4.2023

**DWS Investment GmbH**  
60612 Frankfurt am Main  
Tel.: +49 (0) 69-910-12371  
Fax: +49 (0) 69-910-19090  
[www.dws.de](http://www.dws.de)