

DWS Investment GmbH

# FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Halbjahresbericht 2023



Investors for a new now

# FOS Rendite und Nachhaltigkeit

# Inhalt

**Halbjahresbericht 2023**  
**vom 1.1.2023 bis 30.6.2023 (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 vorhanden – dargestellt. Alle Grafik- und Zahlenangaben geben den **Stand vom 30. Juni 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.

## 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](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.

# Hinweise für Anleger in Luxemburg

## Zahl- und Vertriebsstelle in Luxemburg

---

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](http://www.dws.com) erhältlich,
- Zahlungen an die Anteilhaber weitergeleitet werden.



# Halbjahresbericht

# FOS Rendite und Nachhaltigkeit

## FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertentwicklung der Anteilsklassen (in Euro)

Anteilklasse	ISIN	6 Monate
Klasse A	DE000DWS0XF8	3,4%
Klasse B	DE000DWS2S93	3,4%

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

Stand: 30.6.2023

## 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 30.06.2023

	Bestand in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		
<b>1. Aktien (Branchen):</b>		
Informationstechnologie	23.337.076,60	2,84
Versorger	18.170.369,85	2,22
Finanzsektor	16.215.344,40	1,98
Gesundheitswesen	15.274.171,57	1,86
Industrien	15.174.043,04	1,85
Hauptverbrauchsgüter	11.090.996,38	1,35
Grundstoffe	10.388.200,00	1,27
Dauerhafte Konsumgüter	7.592.712,18	0,93
Sonstige	5.278.706,53	0,64
<b>Summe Aktien:</b>	<b>122.521.620,55</b>	<b>14,94</b>
<b>2. Anleihen (Emittenten):</b>		
Institute	291.456.043,26	35,54
Zentralregierungen	134.211.992,28	16,37
Sonst. Finanzierungsinstitutionen	121.497.067,63	14,82
Unternehmen	39.760.792,59	4,85
Sonstige öffentliche Stellen	24.529.702,67	2,99
Sonstige	1.850.175,30	0,23
<b>Summe Anleihen:</b>	<b>613.305.773,73</b>	<b>74,80</b>
<b>3. Zertifikate</b>	<b>15.843.200,00</b>	<b>1,93</b>
<b>4. Investmentanteile</b>	<b>53.310.299,80</b>	<b>6,50</b>
<b>5. Derivate</b>	<b>-553.827,44</b>	<b>-0,06</b>
<b>6. Bankguthaben</b>	<b>11.901.654,17</b>	<b>1,45</b>
<b>7. Sonstige Vermögensgegenstände</b>	<b>4.215.239,09</b>	<b>0,51</b>
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		
<b>1. Sonstige Verbindlichkeiten</b>	<b>-633.781,50</b>	<b>-0,07</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>819.910.178,40</b>	<b>100,00</b>

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

# FOS Rendite und Nachhaltigkeit

## Vermögensaufstellung zum 30.06.2023

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>737.602.511,25</b>	<b>89,95</b>	
<b>Aktien</b>								
Novo-Nordisk B (DK0060534915) (N)	Stück	33.800		6.200	DKK	1.083,6000	4.918.278,20	0,60
Orsted (DK0060094928) (N)	Stück	40.000		10.300	DKK	646,2000	3.470.997,80	0,42
Air Liquide (FR0000120073) (N)	Stück	11.000			EUR	164,7000	1.811.700,00	0,22
ASML Holding (NL0010273215) (N)	Stück	6.000			EUR	657,9000	3.947.400,00	0,48
Aurubis (DE0006766504) (N)	Stück	20.000		20.000	EUR	78,4600	1.569.200,00	0,19
BEFESA (LU1704650164) (N)	Stück	70.000		50.000	EUR	34,4600	2.412.200,00	0,29
BNP Paribas (FR0000131104) (N) <sup>6)</sup>	Stück	72.000		13.000	EUR	57,9500	4.172.400,00	0,51
Compagnie de Saint-Gobain (C.R.) (FR0000125007) (N)	Stück	50.000			EUR	55,8400	2.792.000,00	0,34
Covestro (DE0006062144) (N)	Stück	100.000	15.000		EUR	47,6000	4.760.000,00	0,58
Credit Agricole (FR0000045072) (N)	Stück	270.000			EUR	10,9280	2.950.560,00	0,36
CTP (NL00150006R6)	Stück	396.898	7.571		EUR	11,8600	4.707.210,28	0,57
Deutsche Post Reg. (DE0005552004) (N)	Stück	90.000		20.000	EUR	44,9100	4.041.900,00	0,49
ENCAVIS (DE0006095003) (N)	Stück	335.000		95.000	EUR	15,0750	5.050.125,00	0,62
European Healthcare Acq.+ Grow C.I.A (NL0015000K10)	Stück	58.615		285.721	EUR	9,7500	571.496,25	0,07
Infineon Technologies Reg. (DE0006231004) (N) <sup>6)</sup>	Stück	100.500		24.500	EUR	37,2450	3.743.122,50	0,46
Kering (FR0000121485) (N)	Stück	6.900		1.300	EUR	502,7000	3.468.630,00	0,42
Kion Group (DE000KGX8881) (N) <sup>6)</sup>	Stück	60.000			EUR	36,6900	2.201.400,00	0,27
L'Oreal (FR0000120321) (N)	Stück	11.500		2.200	EUR	425,1500	4.889.225,00	0,60
Merck (DE0006599905) (N)	Stück	33.500			EUR	150,5000	5.041.750,00	0,61
Michelin (N)	Stück	70.000	70.000		EUR	26,7900	1.875.300,00	0,23
Verbund AG (AT0000746409) (N)	Stück	71.100	10.100		EUR	73,0000	5.190.300,00	0,63
Wacker Chemie (DE000WCH8881) (N)	Stück	18.000			EUR	124,8500	2.247.300,00	0,27
Nordea Bank (FI4000297767) (N)	Stück	240.000			SEK	117,6400	2.390.732,96	0,29
American Water Works Co. (US0304201033) (N)	Stück	18.500			USD	140,4700	2.397.541,29	0,29
Bristol-Myers Squibb Co. (US1101221083) (N)	Stück	90.000	40.000		USD	64,0000	5.314.143,37	0,65
Johnson Controls International (IE00BY7QL619) (N)	Stück	60.000			USD	67,3200	3.726.543,04	0,45
Microsoft Corp. (US5949181045) (N)	Stück	21.000		3.000	USD	335,0500	6.491.419,87	0,79
NIKE B (US6541061031) (N)	Stück	21.500			USD	113,3700	2.248.782,18	0,27
NVIDIA Corp. (US67066G1040) (N)	Stück	15.000		14.200	USD	408,2200	5.649.321,89	0,69
Ormat Technologies (US6866881021)	Stück	28.010			USD	79,7700	2.061.405,76	0,25
Palo Alto Networks (US6974351057) (N)	Stück	15.000			USD	253,3300	3.505.812,34	0,43
The Procter & Gamble (US7427181091) (N) <sup>6)</sup>	Stück	45.000			USD	149,3800	6.201.771,38	0,76
VISA C.I.A (US92826C8394) (N)	Stück	31.000		7.000	USD	234,3200	6.701.651,44	0,82
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								
4,5000 % Aareal Bank 22/25.07.2025 (DE000AAR0355) (N)	EUR	8.000			%	97,1050	7.768.400,00	0,95
3,3750 % Allianz 14/und. MTN (DE000A13R7Z7) (N)	EUR	2.000			%	97,4940	1.949.880,00	0,24
2,9000 % Austria 23/25.05.2029 (AT0000A33SH3) (N)	EUR	13.000	13.000		%	99,5880	12.946.440,00	1,58
1,1250 % Banco Santander 20/23.06.27 MTN (XS2194370727) (N)	EUR	10.000			%	88,7410	8.874.100,00	1,08
0,1250 % Bayerische Landesbank 21/10.02.28 MTN (DE000BLB6JJ0)	EUR	2.800			%	83,4980	2.337.944,00	0,29
1,2500 % Belgium 18/22.04.33 S.86 (BE0000346552) (N) <sup>3)</sup>	EUR	15.000	3.000		%	85,2680	12.790.200,00	1,56
0,3750 % Berlin Hyp 21/21.04.31 MTN (DE000BHY0SL9)	EUR	8.000			%	74,2630	5.941.040,00	0,72
3,0000 % Berlin Hyp 23/10.01.2033 MTN (DE000BHY0GM2) <sup>3)</sup>	EUR	5.000	5.000		%	98,6710	4.933.550,00	0,60
0,1250 % Berlin Hyp Ag 21/18.01.30 (DE000BHY0H34)	EUR	2.000			%	81,9860	1.639.720,00	0,20
0,3750 % BNP Paribas 20/14.10.27 MTN (FR00140005J1) (N)	EUR	6.000			%	87,8530	5.271.180,00	0,64
4,3750 % BNP Paribas 23/13.01.2029 MTN (FR001400DCZ6) (N)	EUR	3.500	3.500		%	99,3940	3.478.790,00	0,42
0,8000 % Bonos Y Oblig Del Estado 22/30.07.29 (ES0000012K53)	EUR	2.000	2.000		%	86,5010	1.730.020,00	0,21
1,8000 % Bundesrepublik Deutschland 23/15.08.2053 S.G (DE0001030757) (N)	EUR	2.000	2.000		%	86,9110	1.738.220,00	0,21
0,0000 % Caisse d'Amort de la Dette Sociale 20/25.02.28 MTN (FR00140002P5) (N)	EUR	5.000			%	86,2490	4.312.450,00	0,53
0,7500 % Caixabank 20/10.07.26 MTN (XS2200150766) (N)	EUR	5.000			%	93,0300	4.651.500,00	0,57
0,3750 % Caixabank 20/18.11.26 MTN (XS2258971071) (N)	EUR	5.000			%	90,1480	4.507.400,00	0,55
0,5000 % Caixabank 21/09.02.29 MTN (XS2297549391) <sup>3)</sup> (N)	EUR	5.000			%	82,9350	4.146.750,00	0,51
3,0000 % Commerzbank 22/14.09.27 (DE000CZ45W57) (N)	EUR	5.300			%	93,8460	4.973.838,00	0,61
3,3750 % Commerzbank 23/12.12.2025 MTN (DE000CZ43Z15) (N)	EUR	2.000	2.000		%	99,1470	1.982.940,00	0,24

## FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
4,0000 % Coöp. Rabobank (Utrecht Br.) 23/10.01.2030 MTN (XS2572996606) .....	EUR	4.700	4.700		%	97,9300	4.602.710,00	0,56
0,0500 % Crédit Agricole Home Loan 19/06.12.29 MTN (FR0013465010) (N) .....	EUR	3.000			%	80,9450	2.428.350,00	0,30
3,2500 % Crédit Agricole Home Loan 23/28.09.2026 MTN (FR001400G5S8) (N) .....	EUR	5.000	5.000		%	98,9640	4.948.200,00	0,60
0,0100 % De Volksbank 19/16.09.24 MTN (XS2052503872) .....	EUR	2.000			%	95,1460	1.902.920,00	0,23
1,8750 % Deutsche Bank 22/23.02.28 MTN (DE000DL19WL7) (N) .....	EUR	10.000	5.000		%	88,5120	8.851.200,00	1,08
0,7500 % Deutsche Kreditbank 17/26.09.24 (DE000GRN0016) .....	EUR	6.000			%	95,8490	5.750.940,00	0,70
0,6250 % DNB Boligkredit 18/19.06.25 MTN PF (XS1839888754) (N) .....	EUR	5.050			%	93,9690	4.745.434,50	0,58
0,1250 % Estonia 20/10.06.30 (XS2181347183) (N) .....	EUR	5.000			%	80,3870	4.019.350,00	0,49
0,1500 % EUROFIMA 19/10.10.34 MTN (XS2055744689) .....	EUR	5.000			%	71,5580	3.577.900,00	0,44
1,2500 % European Investment Bank 14/13.11.26 MTN (XS1107718279) <sup>3)</sup> .....	EUR	2.000			%	93,7380	1.874.760,00	0,23
2,7500 % European Investment Bank 28/28.07.2028 S.EARN (XS2587298204) .....	EUR	7.240	7.240		%	98,2455	7.112.974,20	0,87
0,5000 % Germany 14/15.04.30 INFL (DE0001030559) (N) <sup>3)</sup> .....	EUR	6.000			%	102,0070	7.577.630,80	0,92
0,5000 % Germany 18/15.02.28 (DE0001102440) (N) <sup>3)</sup> .....	EUR	2.000	2.000		%	91,1190	1.822.380,00	0,22
0,0000 % Germany 20/15.08.30 (DE0001030708) (N) <sup>3)</sup> .....	EUR	10.000	1.000		%	84,5800	8.458.000,00	1,03
0,1000 % Germany 21/15.04.33 INFL (DE0001030583) (N) <sup>3)</sup> .....	EUR	5.000			%	100,1520	5.884.180,38	0,72
1,3000 % Germany 22/15.10.2027 S.G (DE0001030740) (N) .....	EUR	9.000	9.000		%	94,8870	8.539.830,00	1,04
2,3000 % Germany 23/15.02.2033 S.G (DE000BU3Z005) (N) .....	EUR	10.000	10.000		%	99,1190	9.911.900,00	1,21
3,0000 % Hamburger Hochbahn 23/15.09.2028 (DE000A351M80) .....	EUR	4.600	4.600		%	98,4140	4.527.044,00	0,55
0,7500 % Intesa Sanpaolo 19/04.12.24 MTN (XS2089368596) (N) .....	EUR	2.000			%	95,1490	1.902.980,00	0,23
0,7500 % Intesa Sanpaolo 21/16.03.28 MTN (XS2317069685) (N) <sup>3)</sup> .....	EUR	10.000			%	85,1870	8.518.700,00	1,04
5,0000 % Intesa Sanpaolo 23/08.03.2028 MTN (XS2592650373) (N) .....	EUR	5.000	5.000		%	99,8010	4.990.050,00	0,61
1,3500 % Ireland 18/18.03.31 (IE00BFZRQ242) (N) .....	EUR	10.000	6.000		%	90,1340	9.013.400,00	1,10
3,0000 % Ireland Govt. 22/18.10.2043 (IE000GVLBXU6) (N) .....	EUR	10.000	10.000		%	97,5910	9.759.100,00	1,19
0,8750 % Iren 19/14.10.29 MTN (XS2065601937) (N) <sup>3)</sup> .....	EUR	3.000			%	82,3220	2.469.660,00	0,30
1,3000 % Italy B.T.P. 17/15.05.28 INFL (IT0005246134) (N) .....	EUR	2.000		3.000	%	98,1330	2.401.589,28	0,29
1,6000 % Italy B.T.P. 22/28.06.2030 S.ICPI INFL (IT0005497000) (N) .....	EUR	4.000		3.000	%	96,6495	4.066.083,12	0,50
1,3750 % La Banque Postale 19/24.04.29 MTN (FR0013415692) <sup>3)</sup> .....	EUR	5.000			%	85,3250	4.266.250,00	0,52
0,3750 % LB Baden-Württemberg 19/29.07.26 MTN (DE000LB2CLH7) <sup>3)</sup> .....	EUR	5.000			%	87,8760	4.393.800,00	0,54
0,3750 % LB Baden-Württemberg 20/18.02.27 MTN (DE000LB2CRG6) <sup>3)</sup> .....	EUR	8.000			%	86,4370	6.914.960,00	0,84
0,2500 % LB Baden-Württemberg 21/21.07.28 MTN (DE000LB2V7C3) .....	EUR	7.000			%	82,1010	5.747.070,00	0,70
0,2500 % Lettland Republik 21/23.01.30 MTN (XS2420426038) <sup>3)</sup> .....	EUR	5.000	2.000		%	79,6710	3.983.550,00	0,49
0,7500 % NatWest Group 19/15.11.25 (XS2080205367) (N) .....	EUR	10.000			%	94,7330	9.473.300,00	1,16
0,5000 % Netherlands 19/15.01.40 (NL0013552060) (N) <sup>3)</sup> .....	EUR	10.000	3.000		%	69,8460	6.984.600,00	0,85
0,5000 % Netherlands Government 22/15.07.32 (NL0015000RP1) (N) <sup>3)</sup> .....	EUR	15.000	15.000		%	82,3080	12.346.200,00	1,51
0,0000 % NIBC Bank 03/10.02.43 MTN (XS0161702914) .....	EUR	590			%	317,5000	1.873.250,00	0,23
4,5000 % NN Group 14/und (XS1028950290) (N) .....	EUR	3.000			%	96,8140	2.904.420,00	0,35
0,0000 % Nordic Investment Bank 19/25.09.26 MTN (XS2055786763) .....	EUR	2.000			%	89,6920	1.793.840,00	0,22
0,0100 % Oberösterreichische 21/15.09.28 MTN (AT0000A2SUL3) .....	EUR	5.000	3.000		%	83,7830	4.189.150,00	0,51
5,3750 % Porr 20/Und (XS2113662063) (N) .....	EUR	1.500			%	90,1290	1.351.935,00	0,16
7,5000 % Porr 21/und. (XS2408013709) (N) .....	EUR	2.000			%	87,6250	1.752.500,00	0,21
0,3750 % Raiffeisen Bank International 19/25.09.26 MTN (XS2055627538) (N) .....	EUR	6.000			%	86,5130	5.190.780,00	0,63
0,5000 % SBAB 20/13.05.25 MTN (XS2173114542) (N) .....	EUR	4.000			%	93,6220	3.744.880,00	0,46
4,8750 % SBAB 23/26.06.2026 MTN (XS2641720987) (N) .....	EUR	5.000	5.000		%	99,7210	4.986.050,00	0,61
0,8750 % Societe Generale 20/22.09.28 Mtn (FR0013536661) (N) .....	EUR	7.000			%	85,4480	5.981.360,00	0,73
0,6500 % Spain 17/30.11.27 INFL (ES00000128S2) (N) .....	EUR	8.000		2.000	%	98,3990	9.613.188,70	1,17
1,0000 % Spain 21/30.07.42 (ES0000012J07) (N) .....	EUR	1.000	1.000		%	62,6130	626.130,00	0,08
0,0100 % Sparebanken Vest Boligkredit 20/28.06.27 MTN PF (XS2199484929) (N) .....	EUR	11.000			%	86,9880	9.568.680,00	1,17
0,0100 % Sparebanken Vest Boligkredit (N) 21/11.11.26 MTN PF (XS2397352233) .....	EUR	6.000	3.000		%	88,6690	5.320.140,00	0,65
0,3750 % Swisscom Finance 20/14.11.28 (XS2169243479) (N) <sup>3)</sup> .....	EUR	3.000			%	84,3400	2.530.200,00	0,31

## FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
1,0000 % TenneT Holding 16/13.06.26 MTN (XS1432384664)	EUR	7.000			% 93,0980	6.516.860,00	0,79
0,8750 % TenneT Holding 19/03.06.30 MTN (XS2002491780)	EUR	5.000			% 85,3070	4.265.350,00	0,52
0,7500 % Terna Rete Elettrica Nazionale 20/24.07.32 MTN (XS2209023402) (N) <sup>3)</sup>	EUR	2.000			% 76,4280	1.528.560,00	0,19
0,0000 % Unedic 20/25.11.28 MTN (FR0014000667)	EUR	10.000	5.000		% 84,5030	8.450.300,00	1,03
0,0100 % UniCredit Bank 21/28.09.26 MTN (DE000HV2AYN4) (N)	EUR	5.000			% 89,2790	4.463.950,00	0,54
4,0000 % Vossloh 21/Und. (DE000A3H2VA6) (N)	EUR	1.000			% 96,7325	967.325,00	0,12
2,0000 % ZF Finance 21/06.05.27 MTN Reg S (XS2338564870) <sup>3)</sup>	EUR	5.000			% 87,1560	4.357.800,00	0,53
5,6250 % NatWest Markets 02/und. MTN (XS0154144132) (N)	GBP	2.167			% 95,8318	2.416.985,59	0,29
10,0625 % Santander Uk 95/Und. (XS0060837068) (N)	GBP	1.000			% 147,0470	1.711.440,88	0,21
11,7500 % Ulster Bank Ireland 98/Und. (IE0004325514)	GBP	1.973	1.973		% 160,5000	3.685.597,07	0,45
1,5060 % AEGON 95/und. (NL0000120004) (N)	NLG	10.000			% 79,4670	3.606.055,24	0,44
2,1250 % Caisse Amortism. Dette Soc. 22/26.01.32 Reg S (XS2436433333) (N) <sup>3)</sup>	USD	15.000			% 85,0280	11.766.952,67	1,44
8,1510 % Dresdner Funding Tr I 99/30.06.31 Reg S (XS009772965)	USD	1.425	175		% 106,9100	1.405.542,49	0,17
0,1000 % European Bank for Rec. & Dev. 20/20.11.30 INFL (XS2259635170)	USD	18.500			% 93,0000	18.506.922,78	2,26
0,1034 % European Bank for Rec. & Dev. 21/18.10.31 INFL (XS2398388046)	USD	5.100			% 90,8500	4.743.893,81	0,58
0,7500 % European Investment Bank (EIB) 20/23.09.30 (US298785JH03) <sup>3)</sup>	USD	10.000	5.000		% 79,3780	7.323.369,31	0,89
3,5000 % Intl Bk Recon & Develop. 23/12.07.2028 (US459058KT95)	USD	5.000	5.000		% 96,5158	4.452.248,09	0,54
4,7500 % ZF North America Capital 15/29.04.25 Reg S (USU98737AC03)	USD	4.000			% 97,4748	3.597.187,93	0,44
<b>Verbriefte Geldmarktinstrumente</b>							
2,8364 % AEGON 04/und. (NL0000116150) (N)	EUR	5.000			% 77,2520	3.862.600,00	0,47
3,5400 % AXA 03/und. MTN (XS0179060974) (N) <sup>3)</sup>	EUR	5.000			% 80,5780	4.028.900,00	0,49
3,1290 % AXA 03/und. MTN (XS0181369454) (N)	EUR	8.000			% 79,8470	6.387.760,00	0,78
3,1390 % AXA 04/und. MTN (XS0203470157) (N)	EUR	5.000		4.000	% 81,0650	4.053.250,00	0,49
3,0000 % Axa 23/Und. MTN (XS0210434782) (N) <sup>3)</sup>	EUR	1.000	1.000		% 91,2460	912.460,00	0,11
4,7740 % Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 07/und. S.1 (ES0214974075) (N)	EUR	4.650	3.700		% 90,9900	4.231.035,00	0,52
3,0390 % Banco Santander 04/Und. (XS0202197694) (N)	EUR	10.000			% 76,8580	7.685.800,00	0,94
0,0643 % Banesto Financial Products 20/21.09.2030 MTN (XS2231046140)	EUR	600	600		% 80,0000	480.000,00	0,06
0,5000 % Berlin Hyp 16/26.09.23 IHS (DE000BHYOGU5)	EUR	5.000		2.000	% 99,2420	4.962.100,00	0,61
0,6250 % BPCE 18/26.09.23 MTN (FR0013367406)	EUR	5.000			% 99,3000	4.965.000,00	0,61
3,0160 % Compagnie De Saint-Gobain 18/25.5.33 MTN (XS1824277641) (N)	EUR	10.000			% 85,4965	8.549.650,00	1,04
2,0000 % Coöperatieve Rabobank 06/29.02.2035 MTN (XS0211284491)	EUR	2.500	2.500		% 87,5805	2.189.512,50	0,27
2,9540 % Deutsche Postbank Funding Trust I 04/und. pref. (DE000A0DEN75)	EUR	15.000			% 70,1400	10.521.000,00	1,28
3,1250 % Deutsche Postbank Funding Trust III 05/und. pref. (DE000A0D2421)	EUR	10.220			% 70,0690	7.161.051,80	0,87
0,5000 % DZ Bank 18/02.10.23 IHS MTN (DE000DDA0NB1)	EUR	4.500			% 99,1865	4.463.392,50	0,54
1,7710 % European Investment Bank 05/17.08.30 MTN (XS0224480722)	EUR	2.275	225		% 88,1800	2.006.095,00	0,24
0,3750 % LB Baden-Württemberg 19/24.05.24 MTN S.806 (DE000LB2CHW4) <sup>3)</sup>	EUR	4.000			% 96,7910	3.871.640,00	0,47
2,9983 % LB Hessen-Thüringen 09/05.02.29 (DE000HLB1Q05)	EUR	1.000			% 96,7500	967.500,00	0,12
0,2500 % Nederlandse Waterschapsbank 17/07.06.24 MTN (XS1626191107) <sup>3)</sup>	EUR	5.000			% 96,7110	4.835.550,00	0,59
2,8500 % NIBC Bank 05/21.02.40 MTN (XS0210781828)	EUR	2.000			% 58,2500	1.165.000,00	0,14
3,0890 % NIBC Bank 06/Und. (XS0249580357)	EUR	9.000			% 74,1260	6.671.340,00	0,81
0,1250 % Nordic Investment Bank 16/10.06.24 MTN (XS1431730388)	EUR	4.000			% 96,5805	3.863.220,00	0,47
6,5000 % Stichting AK Rabobank Certificaten 13/Und. (XS1002121454) <sup>3)</sup>	EUR	5.000			% 92,9410	4.647.050,00	0,57
4,0900 % UniCredit Bank Austria 01/27.12.31 MTN (XS0140394817) (N)	EUR	6.600			% 92,7000	6.118.200,00	0,75
0,4960 % AEGON 96/und. (NL0000120889) (N)	NLG	7.000			% 64,3780	2.044.942,39	0,25
1,4250 % AEGON 96/und. (NL0000121416) (N)	NLG	5.000			% 71,8355	1.629.876,44	0,20

## FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
3,5150 % AEGON 04/und. (NL0000116168) (N) <sup>3)</sup> . . . . .	USD	6.000			%	75,9840	4.206.144,48	0,51
3,7800 % AXA 04/Und. MTN (XS0184718764) (N) . . . . .	USD	2.000			%	82,2240	1.517.187,93	0,19
3,3940 % AXA 04/und. MTN (XS0185672291) (N) <sup>3)</sup> . . . . .	USD	5.000	1.000		%	83,5040	3.852.015,87	0,47
5,2846 % BNP Paribas 86/und (FR0008131403) (N) . . . . .	USD	6.000			%	92,3160	5.110.213,12	0,62
5,4375 % CW Bank of Australia 86/und. (GB0008424284) . . . . .	USD	4.000		6.400	%	99,6190	3.676.317,00	0,45
5,3601 % DNB Bank 86/und. (GB0040940875) (N) . . . . .	USD	6.000			%	83,4710	4.620.592,31	0,56
3,5000 % KBC Ifima 05/07.02.25 MTN (XS0210976329) (N) . . . . .	USD	2.000			%	94,4890	1.743.500,32	0,21
0,0000 % Natixis 13/27.12.33 MTN (US63873HJT23) . . . . .	USD	300			%	76,0375	210.455,30	0,03
0,0000 % Natixis 13/29.08.33 MTN (US63873HLN25) . . . . .	USD	2.000			%	59,4125	1.096.272,72	0,13
3,7150 % NIBC Bank 05/und. MTN (XS0215294512) . . . . .	USD	8.000			%	77,6860	5.733.813,08	0,70
5,3688 % Westpac Banking 86/und (GB0009573998) (N) . . . . .	USD	12.000			%	92,7010	10.263.050,10	1,25
<b>Zertifikate</b>								
UBS London/Equity Basket 29.03.28 TrackerCert. (CH0575775371) . . . . .	Stück	160.000			EUR	99,0200	15.843.200,00	1,93
						<b>12.623.137,69</b>	<b>1,54</b>	
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>								
<b>Verbriefte Geldmarktinstrumente</b>								
0,0000 % Bank of Nova Scotia 13/29.07.33 (US064159CP95) . . . . .	USD	5.850			%	66,2360	3.574.874,07	0,44
5,7500 % DNB Bank 85/Und. S.OLD (LU0001344653) . . . . .	USD	2.000			%	83,6560	1.543.611,03	0,19
6,1703 % HSB Group 97/15.07.27 (US40428NAC39) . . . . .	USD	8.800	1.000	200	%	92,4351	7.504.652,59	0,92
						<b>1.444.945,34</b>	<b>0,18</b>	
<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>								
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								
0,0000 % Intl Bk Recon & Develop 14/30.06.2034 MTN (US45905UPL25) . . . . .	USD	410	410		%	67,9500	257.030,17	0,03
<b>Verbriefte Geldmarktinstrumente</b>								
0,0000 % Int. Bank for Rec. and Develop. 14/31.07.34 MTN (US45905UPQ12) . . . . .	USD	2.150			%	59,8875	1.187.915,17	0,14
						<b>53.310.299,80</b>	<b>6,50</b>	
<b>Investmentanteile</b>								
<b>Gruppeneigene Investmentanteile (inkl. KVG-eigene Investmentanteile)</b>								
Xtrackers MSCI EM Asia ESG Screened UCITS ETF (LU0292107991) (0,450%) . . . . .	Stück	200.000			EUR	48,1550	9.631.000,00	1,17
Xtrackers MSCI Japan ESG UCITS ETF 1C (IE00BG36TC12) (0,100%) . . . . .	Stück	800.000		50.000	EUR	18,1860	14.548.800,00	1,77
						<b>29.130.499,80</b>	<b>3,55</b>	
<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>								
FSGU-Stewart Inv.APAC Sus. VI EUR Accu. (IE00BFY86394) (0,850%) . . . . .	Stück	8.200.000			EUR	3,5525	29.130.499,80	3,55
						<b>804.980.894,08</b>	<b>98,17</b>	
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								
<b>Derivate</b>								
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen								
						<b>-760.213,54</b>	<b>-0,09</b>	
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>								
<b>Wertpapier-Optionsrechte</b> (Forderungen / Verbindlichkeiten)								
<b>Optionsrechte auf Aktien</b>								
Call BNP Paribas 09/2023 Strike 60,00 (EURX) . . . . .	Stück	-12.000			EUR	1,6600	-19.920,00	0,00
Call Kion Group 09/2023 Strike 40,00 (EURX) . . . . .	Stück	-30.000			EUR	1,2500	-37.500,00	0,00
JUL23 IFX C @ 35,00 (EURX) . . . . .	Stück	-30.000			EUR	2,5700	-77.100,00	-0,01
Put Bechtle 12/2023 Strike 38,00 (EURX) . . . . .	Stück	-50.000			EUR	3,6750	-183.750,00	-0,02
Put BEFESA 09/2023 Strike 44,00 (EURX) . . . . .	Stück	-30.000			EUR	10,1600	-304.800,00	-0,04
Put Carl Zeiss Meditec 09/2023 Strike 100,00 (EURX) . . . . .	Stück	-18.500			EUR	7,0250	-129.962,50	-0,02
Put Covestro 07/2023 Strike 41,50 (EURX) . . . . .	Stück	-70.000			EUR	0,4850	-33.950,00	0,00
Put Kion Group 09/2023 Strike 32,00 (EURX) . . . . .	Stück	-30.000			EUR	0,8500	-25.500,00	0,00
Call The Procter & Gamble 07/2023 Strike 160,00 (USS) . . . . .	Stück	-15.000			USD	0,0500	-691,95	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 Fondsvermögen
<b>Wertpapier-Optionsscheine</b>							
<b>Optionsscheine auf Aktien</b>							
EHC 16.11.26 (NL0015000K28)	Stück	107.930			EUR 0,2500	26.982,50	0,00
Pyrophyte Acquisition 17.12.23 WRT (KYG7308P1274)	Stück	285.000			USD 0,0988	25.978,41	0,00
<b>Devisen-Derivate</b>						<b>206.386,10</b>	<b>0,03</b>
<b>Devisentermingeschäfte</b>							
EUR/USD FUTURE (EUREX) SEP 23 (EURX)	USD	64.000				206.386,10	0,03
<b>Bankguthaben und nicht verbriefte Geldmarktinstrumente</b>						<b>11.901.654,17</b>	<b>1,45</b>
<b>Bankguthaben</b>							
<b>Verwahrstelle (täglich fällig)</b>						<b>11.901.654,17</b>	<b>1,45</b>
EUR - Guthaben	EUR	7.230.795,81		% 100		7.230.795,81	0,88
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR	1.415,10		% 100		1.415,10	0,00
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>							
Australische Dollar	AUD	157,11		% 100		95,92	0,00
Kanadische Dollar	CAD	158,46		% 100		110,26	0,00
Schweizer Franken	CHF	24.124,95		% 100		24.697,94	0,00
Britische Pfund	GBP	8.595,71		% 100		10.004,32	0,00
Japanische Yen	JPY	7.645,00		% 100		48,77	0,00
Mexikanische Peso	MXN	2.330,43		% 100		125,71	0,00
US Dollar	USD	5.023.183,17		% 100		4.634.360,34	0,57
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>						<b>4.215.239,09</b>	<b>0,51</b>
Zinsansprüche	EUR	4.051.562,00		% 100		4.051.562,00	0,49
Dividenden-/Ausschüttungsansprüche	EUR	99.577,51		% 100		99.577,51	0,01
Quellensteueransprüche	EUR	40.250,22		% 100		40.250,22	0,00
Sonstige Ansprüche	EUR	23.849,36		% 100		23.849,36	0,00
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>						<b>-633.781,50</b>	<b>-0,07</b>
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-607.126,67		% 100		-607.126,67	-0,07
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-26.654,83		% 100		-26.654,83	0,00
<b>Fondsvermögen</b>						<b>819.910.178,40</b>	<b>100,00</b>

Anteilwert bzw. umlaufende Anteile	Stück bzw. Whg.	Anteilwert in der jeweiligen Whg.
<b>Anteilwert</b>		
Klasse A	EUR	111,59
Klasse B	EUR	112,04
<b>Umlaufende Anteile</b>		
Klasse A	Stück	6.427.133,151
Klasse B	Stück	916.641,357

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 30.06.2023

Australische Dollar	AUD	1,637950	= EUR	1
Kanadische Dollar	CAD	1,437100	= EUR	1
Schweizer Franken	CHF	0,976800	= EUR	1
Dänische Kronen	DKK	7,446850	= EUR	1
Britische Pfund	GBP	0,859200	= EUR	1
Japanische Yen	JPY	156,770000	= EUR	1
Mexikanische Peso	MXN	18,538650	= EUR	1
Niederländische Gulden	NLG	2,203710	= EUR	1
Schwedische Kronen	SEK	11,809600	= EUR	1
US Dollar	USD	1,083900	= EUR	1

### Fußnoten

- 3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 77.457.289,33.  
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	Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				<b>1,0000 % Valéo 21/03.08.28 MTN (FR0014004UE6)</b>			
<b>Aktien</b>				EUR 7.000			
Geberit Reg. Disp. (CH0030170408)	Stück		9.300	2,5000 % ZF Europe Finance 19/23.10.27 (XS2010039977)	EUR		4.000
BMW Ord. (DE0005190003)	Stück		60.000	3,0000 % ZF Europe Finance 19/23.10.29 Reg S (XS2010039894)	EUR		7.000
Henkel Pref. (DE0006048432)	Stück		69.000	<b>Verbriefte Geldmarktinstrumente</b>			
OboTech Acquisition Cl.A (LU2334363566)	Stück		930.000	3,5910 % LB Baden-Württemberg 00/17.01.30 MTN (XS0105748205)	EUR		2.000
Tion Renewables (DE000A2YN371)	Stück		35.890	<b>Sonstige Beteiligungswertpapiere</b>			
Svenska Cellulosa B (Free) (SE0000112724)	Stück		305.000	Roche Holding Profitsch. (CH0012032048)	Stück		22.000
Baxter International (US0718131099)	Stück		37.000	<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>			
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>				<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>			
0,0000 % Deutsche Bank 96/28.10.26 (DE0001345759)	DEM		15.000	7,4500 % Munich Re America 96/15.12.26 S.B (US029163AD49)	USD		1.060
0,5000 % Apple 19/15.11.31 (XS2079716937)	EUR		3.000	<b>Nicht notierte Wertpapiere</b>			
0,3340 % Becton Dickinson Euro Finance 21/13.08.28 (XS2375844144)	EUR		5.000	<b>Aktien</b>			
0,5000 % BNP Paribas 19/04.06.26 MTN (FR0013465358)	EUR		2.000	ESG Core Investments (NL0015000603)	Stück		500.000
0,3750 % Credit Agricole London 19/21.10.25 MTN Reg S (XS2067135421)	EUR		3.000	<b>Investmentanteile</b>			
1,7500 % Intesa Sanpaolo 18/20.03.28 MTN (XS1785340172)	EUR		5.000	<b>Gruppenfremde Investmentanteile</b>			
0,2500 % Iren 20/17.01.31 MTN (XS2275029085)	EUR		5.100	Fisch U.F. SICAV-FISCH Convert.Global Sustai.Fd BE (LU1130246231) (1,200%)	Stück		50.000
1,5000 % Italy 21/30.04.45 (IT0005438004)	EUR		2.000	Lyxor MSCI Water ESG F. (DR) UCITS ETF Dist. (FR0010527275) (0,600%)	Stück		165.000
0,5000 % Kellogg 21/20.05.29 (XS2343510520)	EUR		5.000				
0,8750 % KPN 21/15.11.33 MTN (XS2406890066)	EUR		10.000				
0,8750 % L'Oreal 22/29.06.26 (FR0014009EJ8)	EUR		5.000				
0,6110 % Nordea Bank 16/18.08.26 MTN (XS1477568106)	EUR		5.000				
0,3750 % Red Eléctrica Financiaciones 20/24.07.28 MTN (XS2103013210)	EUR		5.000				
0,0000 % Snam 20/07.12.28 MTN (XS2268340010)	EUR		10.000				
0,7500 % Snam 22/20.06.29 MTN (XS2433211310)	EUR		2.000				
1,0000 % Spain 14/30.11.30 INFL (ES00000127C8)	EUR		10.000				
2,8750 % Statkraft 22/13.09.2029 MTN (XS2532312548)	EUR	1.180	3.000				
3,7500 % Teva Pharmaceutical Industries 21/09.05.27 (XS2406607098)	EUR		8.000				

## FOS Rendite und Nachhaltigkeit

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

	Zugänge	Abgänge
<b>Optionsscheine</b>		
<b>Wertpapier-Optionsscheine</b>		
<b>Optionsscheine auf Aktien</b>		
OboTech Acquisition 30.04.26 (LU2334364374) . . . Stück		310.000
		Volumen in 1.000
<b>Terminkontrakte</b>		
<b>Devisentermingeschäfte</b>		
Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: EUR/USD FUTURE (EUREX) JUN 23)	EUR	64.295
<b>Optionsrechte</b>		
<b>Wertpapier-Optionsrechte</b>		
<b>Optionsrechte auf Aktien</b>		
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswerte: BMW Ord., Kion Group, The Procter & Gamble, VISA Cl.A)	EUR	8.077
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: Air Liquide, ASML Holding, Covestro, ENCAVIS, Kion Group, Michelin, NVIDIA Corp., Ormat Technologies, Orsted, Qiagen, The Procter & Gamble, Verbund AG)	EUR	21.356

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

	Volumen in 1.000 EUR
unbefristet	182.303
Gattung: 3,3750 % Allianz 14/und. MTN (DE000A13R7Z7), 0,5000 % Apple 19/15.11.31 (XS2079716937), 3,5400 % AXA 03/und. MTN (XS0179060974), 3,0390 % Banco Santander 04/Und. (XS0202197694), 1,1250 % Banco Santander 20/23.06.27 MTN (XS2194370727), 0,1250 % Bayerische Landebank 21/10.02.28 MTN (DE000BLB6J0), 0,3340 % Becton Dickinson Euro Finance 21/13.08.28 (XS2375844144), 0,5000 % Berlin Hyp 16/26.09.23 IHS (DE000BHY0GU5), 0,1250 % Berlin Hyp Ag 21/18.01.30 (DE000BHY0H34), 0,5000 % BNP Paribas 19/04.06.26 MTN (FR0013465358), 0,3750% BNP Paribas 20/14.10.27 MTN (FR00140005J1), 4,3750% BNP Paribas 23/13.01.2029 MTN (FR001400DCZ6), 0,0000% Caisse d'Amort de la Dette Sociale 20/25.02.28 MTN (FR00140002P5), 0,7500 % Caixabank 20/10.07.26 MTN (XS2200150766), 0,3750 % Caixabank 20/18.11.26 MTN(XS2258971071), 0,5000 % Caixabank 21/09.02.29 MTN (XS2297549391), 3,0000 % Commerzbank 22/14.09.27 (DE000CZ45W57),0,0100 % De Volksbank 1 9/16.09.24 MTN (XS2052503872),0,6250 % DNB Boligkredit 18/19.06.25 MTN PF (XS1839888754),0,1500 % EUROFIMA 19/10.10.34 MTN (XS2055744689),1,7710 % European Investment Bank 05/17.08.30 MTN(XS0224480722), 1,2500 % European Investment Bank14/13.11.26 MTN (XS1107718279), 2,7500 % European Investment Bank 28/28.07.2028 S.EARN (XS2587298204),1,7500 % Intesa Sanpaolo 18/20.03.28 MTN (XS1785340172),0,7500 % Intesa Sanpaolo 19/04.12.24 MTN (XS2089368596),0,7500 % Intesa Sanpaolo 21/16.03.28 MTN (XS2317069685),5,0000 % Intesa Sanpaolo23/08.03.2028 MTN (XS2592650373),0,8750 % Iren 19/14.10.29 MTN (XS2065601937), 0,2500% Iren 20/17.01.31 MTN (XS2275029085), Italy B.T.P. 17/15.05.28 INFL (IT0005246134), 0,8750 % KPN 21/15.11.33 MTN (XS2406890066), 0,8750 % L'Oreal 22/29.06.26 (FR0014009EJ8), 0,3750 % LB Baden-Württemberg 19/24.05.24 MTN S.806 (DE000LB2CHW4), 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), 0,2500 % Nederlandse Waterschapsbank 17/07.06.24 MTN (XS1626191107), 0,3750 % Red Eléctrica Financiaciones 20/24.07.28 MTN (XS2103013210), 0,5000 % SBAB 20/13.05.25 MTN (XS2173114542), 0,0000 % Snam 20/07.12.28 MTN (XS2268340010), 0,7500 % Snam 22/20.06.29 MTN (XS2433211310), 0,8750% Societe Generale 20/22.09.28 Mtn (FR0013536661),0,0100 % Sparebanken Vest Boligkredit 20/28.06.27 MTN PF (XS2199484929), 2,8750 % Statkraft 22/13.09.2029 MTN (XS2532312548), 6,5000 % Stichting AK Rabobank Certificaten 13/Und. (XS1002121454), 0,3750 % Swisscom Finance 20/14.11.28 (XS2169243479), 0,7500 % Terna Rete Elettrica Nazionale 20/24.07.32 MTN (XS2209023402), 3,7500 % Teva Pharmaceutical Industries 21/09.05.27(XS2406607098), 1,0000 % Valéo 21/03.08.28 MTN (FR0014004UE6),4,0000 % Vossloh 21/Und. (DE000A3H2VA6), 2,5000 %ZF Europe Finance 19/23.10.27 (XS2010039977), 3,0000% ZF Europe Finance 19/23.10.29 Reg S (XS2010039894), 2,0000 % ZF Finance 21/06.05.27 MTN Reg S (XS2338564870), 2,1250 % Caisse Amortism. Dette Soc. 22/26.01.32 Reg S (XS2436433333), 5,7500 % DNB Bank 85/Und. S.OLD(LU0001344653), 5,3601 % DNB Bank 86/und. (GB0040940875)	



# FOS Rendite und Nachhaltigkeit

---

## Anhang gemäß § 7 Nr. 9 KARBV

### Sonstige Angaben

Anteilwert Klasse A: EUR 111,59  
Anteilwert Klasse B: EUR 112,04

Umlaufende Anteile Klasse A: 6.427.133,151  
Umlaufende Anteile Klasse B: 916.641,357

#### 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. Preisankünfte 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

Angaben in Fondswährung	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
<b>1. Verwendete Vermögensgegenstände</b>			
absolut	77.457.289,33	-	-
in % des Fondsvermögens	9,45	-	-
<b>2. Die 10 größten Gegenparteien</b>			
<b>1. Name</b>	Barclays Bank Ireland PLC, Dublin		
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>	22.104.745,09		
<b>Sitzstaat</b>	Irland		
<b>2. Name</b>	UBS AG London Branch, London		
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>	18.356.972,00		
<b>Sitzstaat</b>	Großbritannien		
<b>3. Name</b>	BNP Paribas S.A. Arbitrage, Paris		
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>	12.794.391,41		
<b>Sitzstaat</b>	Frankreich		
<b>4. Name</b>	J.P. Morgan SE, Frankfurt am Main		
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>	6.157.654,00		
<b>Sitzstaat</b>	Bundesrepublik Deutschland		
<b>5. Name</b>	Deutsche Bank AG, Frankfurt am Main		
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>	5.941.495,00		
<b>Sitzstaat</b>	Bundesrepublik Deutschland		
<b>6. Name</b>	Goldman Sachs AG, Frankfurt am Main		
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>	3.505.120,40		
<b>Sitzstaat</b>	Bundesrepublik Deutschland		
<b>7. Name</b>	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, Paris		
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>	2.249.005,00		
<b>Sitzstaat</b>	Frankreich		
<b>8. Name</b>	BofA Securities Europe S.A., Paris		
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>	2.095.380,00		
<b>Sitzstaat</b>	Frankreich		

## FOS Rendite und Nachhaltigkeit

<b>9. Name</b>	Zürcher Kantonalbank, Zürich		
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>	1.882.712,43		
<b>Sitzstaat</b>	Schweiz		

<b>10. Name</b>	Nomura Financial Products Europe GmbH, Frankfurt am Main		
<b>Bruttovolumen offene Geschäfte</b>	1.218.594,00		
<b>Sitzstaat</b>	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	77.457.289,33	-	-

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

<b>Art(en):</b>			
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	42.743.598,32	-	-
Aktien	38.798.686,34	-	-
Sonstige	1.477.684,01	-	-

#### 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

<b>6. Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten</b>			
Währung(en):	EUR; GBP; USD; CHF; DKK; JPY; SEK; AUD	-	-
<b>7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)</b>			
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	83.019.968,67	-	-
<b>8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich) *</b>			
<b>Ertragsanteil des Fonds</b>			
absolut	100.360,22	-	-
in % der Bruttoerträge	70,00	-	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	-
<b>Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft</b>			
absolut	43.162,93	-	-
in % der Bruttoerträge	30,00	-	-
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft	-	-	-
<b>Ertragsanteil Dritter</b>			
absolut	-	-	-
in % der Bruttoerträge	-	-	-
Kostenanteil Dritter	-	-	-
<b>9. Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps</b>			
absolut			-
<b>10. Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds</b>			
Summe	77.457.289,33		
Anteil	9,62		
<b>11. Die 10 größten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps</b>			
1. Name	French Republic		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	10.159.226,10		
2. Name	International Development Association		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	6.264.791,37		

## FOS Rendite und Nachhaltigkeit

<b>3. Name</b>	Nestlé S.A.		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	2.539.581,52		
<b>4. Name</b>	Daimler Truck International Finance B.V.		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	2.079.093,70		
<b>5. Name</b>	European Financial Stability Facility (EFSF)		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	1.962.922,57		
<b>6. Name</b>	NRW.BANK		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	1.948.867,59		
<b>7. Name</b>	European Investment Bank (EIB)		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	1.947.772,95		
<b>8. Name</b>	UniCredit Bank Austria AG		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	1.939.635,55		
<b>9. Name</b>	Union Nationale Interprofessionnelle pour l'Emploi		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	1.798.144,16		
<b>10. Name</b>	Établissements Franz Colruyt S.A.		
<b>Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)</b>	1.764.159,89		
<b>12. Wiederangelegte 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>	-		-

## 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)		
--	--	--

\* 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  
Oy-Mittelberg

Holger Naumann (seit dem 1.7.2023)  
DWS Group GmbH & Co. KGaA,  
Frankfurt am Main

Prof. Christian Strenger (bis zum 29.5.2023)  
The Germany Funds,  
New York

Elisabeth Weisenhorn  
Portikus Investment GmbH,  
Frankfurt am Main

Gerhard Wiesheu  
Vorstandssprecher  
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

Sprecher 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

## Verwahrstelle

State Street Bank International GmbH  
Brienner Straße 59  
80333 München  
Eigenmittel am 31.12.2022:  
2.928,6 Mio. Euro  
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital am  
31.12.2022: 109,4 Mio. Euro

## Gesellschafter der DWS Investment GmbH

DWS Beteiligungs GmbH,  
Frankfurt am Main

Stand: 1.7.2023

**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)