DWS Investment GmbH

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Halbjahresbericht 2022/2023

DWS

Investors for a new now

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Inhalt

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

2 / Hinweise

4 / Halbjahresbericht
FOS Strategie-Fonds Nr. 1

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 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.

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

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.

Halbjahresbericht

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertentwicklung im Überblick

ISIN	6 Monate
DE000DWS0TS9	3,1%

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

Stand: 31.3.2023

Angaben auf Euro-Basis

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Vermögensübersicht zum 31.03.2023

	Bestand in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien (Branchen):		
Dauerhafte Konsumgüter	27.682.625,14	8,72
Grundstoffe	14.281.913,58	4,50
Hauptverbrauchsgüter	14.079.215,28	4,43
Versorger	13.439.174,86	4,23
Finanzsektor	13.346.712,76	4,20
Informationstechnologie	11.172.560,10	3,52
Gesundheitswesen	10.728.125,77	3,38
Industrien	10.669.425,23	3,36
Energie	4.267.462,50	1,34
Kommunikationsdienste	3.407.017,45	1,07
Sonstige	27.465.280,09	8,65
Summe Aktien:	**150.539.512,76**	**47,40**
2. Anleihen (Emittenten):		
Institute	32.383.876,88	10,20
Sonst. Finanzierungsinstitutionen	29.161.851,01	9,18
Zentralregierungen	17.976.990,54	5,66
Unternehmen	13.967.766,76	4,40
Sonstige öffentliche Stellen	422.025,00	0,13
Summe Anleihen:	**93.912.510,19**	**29,57**
3. Zertifikate	**19.550.549,38**	**6,15**
4. Investmentanteile	**34.321.982,00**	**10,81**
5. Derivate	**607.912,67**	**0,19**
6. Bankguthaben	**18.091.554,39**	**5,70**
7. Sonstige Vermögensgegenstände	**935.795,67**	**0,29**
II. Verbindlichkeiten		
1. Sonstige Verbindlichkeiten	**-340.840,95**	**-0,11**
III. Fondsvermögen	**317.618.976,11**	**100,00**

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

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Vermögensaufstellung zum 31.03.2023

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds-vermögen
Börsengehandelte Wertpapiere							**258.251.624,67**	**81,31**
Aktien								
VT5 Acquisition Company (CH1107979838)	Stück	57.290			CHF	9,5000	545.537,01	0,17
Novo-Nordisk B (DK0060534915)	Stück	48.250			DKK	1.082,0000	7.008.618,72	2,21
Orsted (DK0060094928)	Stück	41.000			DKK	577,1000	3.176.455,58	1,00
Accor Acquisition Co. Unit (FR0014003PZ3)	Stück	280.000			EUR	9,8500	2.758.000,00	0,87
Air Liquide (FR0000120073)	Stück	5.500			EUR	153,4200	843.810,00	0,27
ASML Holding (NL0010273215)	Stück	3.500			EUR	619,7000	2.168.950,00	0,68
Aurubis (DE0006766504)	Stück	16.000		15.000	EUR	84,7600	1.356.160,00	0,43
BNP Paribas (FR0000131104)	Stück	40.000			EUR	55,2200	2.208.800,00	0,70
BRAIN Biotech (DE0005203947)	Stück	50.430		21.295	EUR	5,6600	285.433,80	0,09
Covestro (DE0006062144)	Stück	40.500	40.500		EUR	38,2000	1.547.100,00	0,49
CTP (NL00150006R6)	Stück	233.000			EUR	11,7200	2.730.760,00	0,86
Deutsche Post Reg. (DE0005552004)	Stück	72.800			EUR	42,9000	3.123.120,00	0,98
Dr. Ing. h.c. F. Porsche (DE000PAG9113) [6]	Stück	58.309			EUR	116,9000	6.816.322,10	2,15
ENCAVIS (DE0006095003)	Stück	255.000		45.000	EUR	15,5400	3.962.700,00	1,25
Eureking Pref. (FR0014009ON9)	Stück	257.143			EUR	9,9500	2.558.572,85	0,81
European Healthcare Acq.+ Grow Cl.A (NL0015000K10)	Stück	190.043		423	EUR	9,8500	1.871.923,55	0,59
GAG Immobilien pref. (DE0005863534)	Stück	57.967			EUR	63,0000	3.651.921,00	1,15
Infineon Technologies Reg. (DE0006231004)	Stück	120.000		20.000	EUR	37,3550	4.482.600,00	1,41
Kion Group (DE000KGX8881)	Stück	40.000	10.000		EUR	35,4200	1.416.800,00	0,45
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton (C.R.) (FR0000121014)	Stück	2.600			EUR	834,6000	2.169.960,00	0,68
Medios (DE000A1MMCC8)	Stück	30.000		10.000	EUR	19,8800	596.400,00	0,19
OboTech Acquisition Cl.A (LU2334363566)	Stück	390.000			EUR	9,8000	3.822.000,00	1,20
Shop Apotheke Europe (NL0012044747)	Stück	20.000	20.000		EUR	81,9000	1.638.000,00	0,52
Sixt (DE0007231326)	Stück	18.000		10.481	EUR	122,1000	2.197.800,00	0,69
Tion Renewables (DE000A2YN371)	Stück	17.437		4.043	EUR	29,0000	505.673,00	0,16
TotalEnergies (FR0000120271)	Stück	78.750			EUR	54,1900	4.267.462,50	1,34
Verbund AG (AT0000746409)	Stück	46.000		10.000	EUR	77,6500	3.571.900,00	1,12
Wacker Chemie (DE000WCH8881)	Stück	19.000		18.000	EUR	149,7500	2.845.250,00	0,90
Compass Group (GB00BD6K4575)	Stück	155.000			GBP	20,3200	3.576.652,28	1,13
Reckitt Benckiser Group (GB00B24CGK77)	Stück	38.900			GBP	62,4200	2.757.367,70	0,87
Acq Bure (SE0015657788)	Stück	221.875			SEK	95,7000	1.885.824,19	0,59
Fastighets AB Balder (SE0017832488)	Stück	420.000	420.000		SEK	41,7000	1.555.486,48	0,49
RVRC Holding (SE0015962485)	Stück	387.783	20.000		SEK	32,0200	1.102.785,35	0,35
Alibaba Group Holding ADR (US01609W1027)	Stück	35.000			USD	103,3800	3.322.589,53	1,05
Allegro Merger RIGHT (US01749N1292)	Stück	30.000			USD	0,0001	2,75	0,00
Alphabet Cl.C (US02079K1079)	Stück	14.350		19.650	USD	101,3200	1.335.116,62	0,42
Bank of America Corp. (US0605051046)	Stück	156.000			USD	28,3000	4.053.994,49	1,28
Blackstone (US09260D1072) [6]	Stück	22.900			USD	85,7500	1.803.191,00	0,57
Brigade-M3 European Acquisition (KYG137071075)	Stück	400.000			USD	10,0000	3.673.094,58	1,16
Bristol-Myers Squibb Co. (US1101221083)	Stück	30.000			USD	68,2000	1.878.787,88	0,59
Churchill Capital VII Cl.A (US17144M1027)	Stück	142.858			USD	10,1400	1.330.192,95	0,42
Costco Wholesale Corp. (US22160K1051)	Stück	5.000			USD	491,4800	2.256.565,66	0,71
Crowdstrike Holdings Cl.A (US22788C1053)	Stück	11.500			USD	131,7200	1.390.982,55	0,44
Estée Lauder Companies, The Cl.A (US5184391044)	Stück	17.000			USD	246,7200	3.851.460,06	1,21
Freedom Acquisition I Cl.A (KYG3663X1108)	Stück	71.428			USD	10,3000	675.581,63	0,21
Ge Healthcare Tech (US36266G1076)	Stück	16.497	16.497		USD	82,1400	1.244.319,17	0,39
Johnson Controls International (IE00BY7QL619)	Stück	26.650	26.650		USD	59,4400	1.454.615,24	0,46
Las Vegas Sands Corp. (US5178341070)	Stück	105.500			USD	55,5400	5.380.596,88	1,69
McDonald's Corp. (US5801351017)	Stück	14.000			USD	277,7900	3.571.221,30	1,12
Microsoft Corp. (US5949181045)	Stück	12.000			USD	284,0500	3.130.027,55	0,99
Nasdaq (US6311031081)	Stück	42.000		30.000	USD	54,0300	2.083.801,65	0,66
Newmont (US6516391066)	Stück	32.000	32.000		USD	48,8400	1.435.151,52	0,45
Nextera Energy Inc. (US65339F1012)	Stück	31.600			USD	76,5900	2.222.446,28	0,70
NIKE B (US6541061031)	Stück	15.800			USD	120,1000	1.742.497,70	0,55
Papaya Growth Opportunity I Cl.A (US69882P1021)	Stück	42.553			USD	10,4000	406.383,10	0,13
PayPal Holdings (US70450Y1038)	Stück	46.800			USD	74,3900	3.196.925,62	1,01
The Coca-Cola Co. (US1912161007)	Stück	27.200		2.800	USD	61,8500	1.544.830,12	0,49
The Procter & Gamble (US7427181091) [6]	Stück	15.000	10.000		USD	147,4500	2.030.991,74	0,64
Walt Disney Co. (US2546871060)	Stück	23.000			USD	98,1000	2.071.900,83	0,65
Waste Management Inc. (US94106L1098)	Stück	16.700		12.000	USD	161,5300	2.477.089,99	0,78
Wheaton Precious Metals (CA9628791027) [6]	Stück	135.000			USD	48,1500	5.969.008,26	1,88

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds-vermögen
			im Berichtszeitraum					
Verzinsliche Wertpapiere								
4,5000 % Aareal Bank 22/25.07.2025 (DE000AAR0355)	EUR	800			%	97,4750	779.800,00	0,25
0,1250 % African Development Bank 16/07.10.26 MTN (XS1501560848)	EUR	500			%	90,1595	450.797,50	0,14
3,3750 % Allianz 14/und. MTN (DE000A13R7Z7) 3)	EUR	2.000	2.000		%	97,6020	1.952.040,00	0,61
1,2500 % Belgium 18/22.04.33 S.86 (BE0000346552)	EUR	2.000	1.000		%	85,2230	1.704.460,00	0,54
0,3750 % Berlin Hyp 21/21.04.31 MTN (DE000BHY0SL9)	EUR	500			%	73,3180	366.590,00	0,12
0,3750 % BNP Paribas 20/14.10.27 MTN (FR00140005J1)	EUR	500			%	87,0860	435.430,00	0,14
0,8000 % Bonos Y Oblig Del Estado 22/30.07.29 (ES0000012K53)	EUR	2.000	2.000		%	86,7680	1.735.360,00	0,55
0,3750 % Caixabank 20/18.11.26 MTN (XS2258971071)	EUR	500			%	89,7600	448.800,00	0,14
0,5000 % Caixabank 21/09.02.29 MTN (XS2297549391)	EUR	500			%	82,0350	410.175,00	0,13
3,0000 % Commerzbank 22/14.09.27 (DE000CZ45W57)	EUR	500			%	92,7900	463.950,00	0,15
3,2500 % Crédit Agricole Home Loan 23/28.09.2026 MTN (FR001400G5S8)	EUR	1.500	1.500		%	99,8860	1.498.290,00	0,47
0,3750 % Credit Agricole London 19/21.10.25 MTN Reg S (XS2067135421)	EUR	500			%	92,0870	460.435,00	0,14
2,2500 % DIC Asset 21/22.09.26 (XS2388910270)	EUR	1.400	1.400		%	64,2150	899.010,00	0,28
0,5000 % Germany 14/15.04.30 INFL (DE0001030559)	EUR	1.000		500	%	104,2610	1.261.453,84	0,40
0,5000 % Germany 18/15.02.28 (DE0001102440) 3)	EUR	3.000	3.000		%	91,5010	2.745.030,00	0,86
0,0000 % Germany 20/15.08.30 (DE0001030708)	EUR	2.500			%	84,8120	2.120.300,00	0,67
0,1000 % Germany 21/15.04.33 INFL (DE0001030583)	EUR	2.000			%	101,6830	2.335.251,78	0,74
0,7500 % Intesa Sanpaolo 21/16.03.28 MTN (XS2317069685)	EUR	520			%	84,7910	440.913,20	0,14
0,6250 % Intesa Sanpaolo 21/24.02.26 MTN (XS2304664167)	EUR	520			%	90,0820	468.426,40	0,15
1,3500 % Ireland 18/18.03.31 (IE00BFZRQ242)	EUR	1.000	1.000		%	90,2980	902.980,00	0,28
0,8750 % Iren 19/14.10.29 MTN (XS2065601937) 3)	EUR	500			%	82,2470	411.235,00	0,13
0,2500 % Iren 20/17.01.31 MTN (XS2275029085) 3)	EUR	1.000			%	74,2850	742.850,00	0,23
1,2500 % Italy B.T.P. 16/01.12.26 (IT0005210650)	EUR	1.000			%	92,4330	924.330,00	0,29
1,3000 % Italy B.T.P. 17/15.05.28 INFL (IT0005246134)	EUR	1.000			%	99,8460	1.193.938,50	0,38
1,6000 % Italy B.T.P. 22/28.06.2030 S.ICPI INFL (IT0005497000)	EUR	1.000			%	98,8025	1.080.316,42	0,34
1,3750 % La Banque Postale 19/24.04.29 MTN (FR0013415692)	EUR	1.000			%	84,3120	843.120,00	0,27
0,2500 % LB Baden-Württemberg 21/21.07.28 MTN (DE000LB2V7C3)	EUR	1.000			%	80,9410	809.410,00	0,25
0,7500 % NatWest Group19/15.11.25 (XS2080205367)	EUR	1.000			%	94,2920	942.920,00	0,30
5,3750 % Porr 20/Und (XS2113662063)	EUR	2.500			%	88,8260	2.220.650,00	0,70
0,3750 % Raiffeisen Bank International 19/25.09.26 MTN (XS2055627538)	EUR	500			%	85,1140	425.570,00	0,13
0,7500 % Snam 22/20.06.29 MTN (XS2433211310)	EUR	1.000			%	81,9630	819.630,00	0,26
0,8750 % Societe Generale 20/22.09.28 Mtn (FR0013536661)	EUR	1.000			%	85,3500	853.500,00	0,27
0,0100 % Sparebanken Vest Boligkreditt 20/28.06.27 MTN PF (XS2199484929)	EUR	1.000			%	87,1630	871.630,00	0,27
2,9160 % Sydbank 04/Und. (XS0205055675)	EUR	2.500			%	77,3340	1.933.350,00	0,61
0,8750 % TenneT Holding 19/03.06.30 MTN (XS2002491780)	EUR	1.000			%	85,6250	856.250,00	0,27
0,0000 % Unedic 20/25.11.28 MTN (FR0014000667)	EUR	500			%	84,4050	422.025,00	0,13
2,1250 % UniCredit 16/24.10.26 MTN (XS1508450688)	EUR	500			%	94,1350	470.675,00	0,15
4,0000 % Vossloh 21/Und. (DE000A3H2VA6)	EUR	700			%	95,0925	665.647,50	0,21
2,5000 % ZF Europe Finance 19/23.10.27 (XS2010039977)	EUR	1.100			%	87,3410	960.751,00	0,30
2,0000 % ZF Finance 21/06.05.27 MTN Reg S (XS2338564870)	EUR	500			%	86,4260	432.130,00	0,14
13,6250 % Bank of Scotland 91/und. (GB0000394915)	GBP	1.000			%	162,0000	1.839.654,78	0,58
5,6250 % NatWest Markets 02/und. MTN (XS0154144132)	GBP	500			%	100,6875	571.698,27	0,18
1,5060 % AEGON 95/und. (NL0000120004) 3)	NLG	3.000			%	83,4315	1.135.786,92	0,36
8,1510 % Dresdner Funding Tr I 99/30.06.31 Reg S (XS0097772965) 3)	USD	1.000			%	102,6470	942.580,35	0,30
0,1000 % European Bank for Rec. & Dev.20/20.11.30 INFL (XS2259635170)	USD	1.000			%	96,2000	1.015.629,95	0,32
4,7500 % ZF North America Capital 15/29.04.25 Reg S (USU98737AC03) 3)	USD	2.000			%	96,7530	1.776.914,60	0,56

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs		Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds-vermögen
			im Berichtszeitraum					
Verbriefte Geldmarktinstrumente								
2,5890 % AEGON 04/und. (NL0000116150)	EUR	2.000			%	77,6890	1.553.780,00	0,49
4,6870 % American International Group 07/15.03.67 MTN (XS0291642154)	EUR	650			%	88,4975	575.233,75	0,18
3,2000 % AXA 03/und. MTN (XS0179060974)	EUR	1.000			%	79,1730	791.730,00	0,25
3,0820 % AXA 04/und. MTN (XS0203470157)	EUR	1.000			%	80,8610	808.610,00	0,25
3,0000 % Axa 23/Und. MTN (XS0210434782)	EUR	2.000	2.000		%	92,6750	1.853.500,00	0,58
3,0390 % Banco Santander 04/Und. (XS0202197694)	EUR	1.500			%	76,1530	1.142.295,00	0,36
2,0000 % Coöperatieve Rabobank 06/29.02.2035 MTN (XS0211284491)	EUR	1.000	1.000		%	88,0995	880.995,00	0,28
2,6670 % Deutsche Postbank Funding Trust I 04/und. pref. (DE000A0DEN75)	EUR	5.000			%	66,5340	3.326.700,00	1,05
2,0810 % Deutsche Postbank Funding Trust III 05/und. pref. (DE000A0D24Z1)	EUR	5.000			%	66,5500	3.327.500,00	1,05
4,8460 % Ethias Vie 05/und. (BE0930906947)	EUR	500			%	89,3375	446.687,50	0,14
0,0000 % German Treasury Bill 22/20.09.2023 (DE0001030880)	EUR	2.000	2.000		%	98,6785	1.973.570,00	0,62
3,0890 % NIBC Bank 06/Und. (XS0249580357)	EUR	1.500			%	75,2090	1.128.135,00	0,36
3,4700 % UniCredit Bank Austria 01/27.12.31 MTN (XS0140394817)	EUR	2.000			%	89,4670	1.789.340,00	0,56
0,4960 % AEGON 96/und. (NL0000120889)	NLG	3.835			%	65,6140	1.141.845,75	0,36
1,4250 % AEGON 96/und. (NL0000121416)	NLG	1.000			%	77,7265	352.707,48	0,11
3,5840 % AEGON 04/und. (NL0000116168)	USD	1.800			%	80,5780	1.331.867,77	0,42
3,3940 % AXA 04/und. MTN (XS0185672291)	USD	1.000			%	83,0290	762.433,43	0,24
0,0000 % Bank of America 10/15.10.30 MTN (US06048WEE66)	USD	1.880			%	67,8350	1.171.072,54	0,37
0,0000 % Bank of Nova Scotia 13/29.07.33 (US064159CP95)	USD	1.000			%	60,6650	557.070,71	0,18
5,2846 % BNP Paribas 86/und (FR0008131403)	USD	2.000			%	73,4140	1.348.282,83	0,42
5,0000 % CW Bank of Australia 86/und. (GB0008424284)	USD	4.000			%	84,3095	3.096.767,68	0,97
5,3601 % DNB Bank 86/und. (GB0040940875)	USD	1.000			%	66,0120	606.170,80	0,19
5,0625 % Hongkong & Shanghai Banking 86/und. S.3 (GB0004355490)	USD	2.000			%	73,3480	1.347.070,71	0,42
5,5000 % HSBC Bank 85/und. (XS0015190423)	USD	1.000			%	73,2780	672.892,56	0,21
3,5000 % KBC Ifima 05/07.02.25 MTN (XS0210976329)	USD	2.500	2.500		%	93,6330	2.149.517,91	0,68
3,7150 % NIBC Bank 05/und. MTN (XS0215294512)	USD	2.500			%	74,5690	1.711.868,69	0,54
6,3124 % Standard Chartered 06/und. Reg S (USG84228AT58)	USD	1.500			%	84,4820	1.163.663,91	0,37
5,5000 % Standard Chartered 85/Und. (XS0010826633)	USD	500	500		%	86,4660	396.997,25	0,12
5,3596 % Westpac Banking 86/und (GB0009573998)	USD	6.000			%	67,3650	3.711.570,25	1,17
Zertifikate								
UBS London/Equity Basket 29.03.28 TrackerCert. (CH0575775371)	Stück	75.000			EUR	103,5700	7.767.750,00	2,45
XTrackers ETC/Gold 21.05.80 (DE000A2T5DZ1)	Stück	447.913		150.000	EUR	26,3060	11.782.799,38	3,71
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere							**4.978.393,66**	**1,57**
Verbriefte Geldmarktinstrumente								
5,7024 % HSB Group 97/15.07.27 (US40428NAC39)	USD	5.000			%	91,0668	4.181.212,76	1,32
5,4517 % Standard Chartered 85/und. S.3 (XS0010159159)	USD	1.000			%	86,8130	797.180,90	0,25
Nicht notierte Wertpapiere							**772.554,00**	**0,24**
Verzinsliche Wertpapiere								
3,0000 % Jefferies Financial Group 17/13.12.47 MTN (XS1725887944)	EUR	1.200			%	64,3795	772.554,00	0,24
Investmentanteile							**34.321.982,00**	**10,81**
Gruppeneigene Investmentanteile (inkl. KVG-eigene Investmentanteile)							**19.201.590,00**	**6,05**
Xtrackers MSCI EM Asia ESG Screened UCITS ETF (LU0292107991) (0,450%)	Stück	394.000	50.000		EUR	48,7350	19.201.590,00	6,05

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds-vermögen
Gruppenfremde Investmentanteile							**15.120.392,00**	**4,76**
Multi Units Luxembourg Sicav - (LU1781541252) [3] (1,350%)	Stück	800.000			EUR	13,3965	10.717.200,00	3,37
UBS Fdso.-CMCI Ex-Agri. SF U. ETF (h EUR) A-Acc. (IE00BYT5CV85) (0,370%)	Stück	27.700	27.700		EUR	158,9600	4.403.192,00	1,39
Summe Wertpapiervermögen							**298.324.554,33**	**93,93**
Derivate Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen								
Derivate auf einzelne Wertpapiere							**-579.130,94**	**-0,18**
Wertpapier-Optionsrechte (Forderungen / Verbindlichkeiten)								
Optionsrechte auf Aktien								
Call Dr. Ing. h.c. F. Porsche 06/2023 Strike 110,00 (EURX)	Stück	-20.000			EUR	11,6250	-232.500,00	-0,07
Put Aurubis 06/2023 Strike 60,00 (EURX)	Stück	-10.000			EUR	0,5350	-5.350,00	0,00
Put BNP Paribas 09/2023 Strike 50,00 (EURX)	Stück	-15.000			EUR	3,3850	-50.775,00	-0,02
Put Covestro 05/2023 Strike 38,00 (EURX)	Stück	-40.000			EUR	1,7050	-68.200,00	-0,02
Put Covestro 06/2023 Strike 36,00 (EURX)	Stück	-44.000			EUR	1,4000	-61.600,00	-0,02
Put Dr. Ing. h.c. F. Porsche 06/2023 Strike 80,00 (EURX)	Stück	-10.000			EUR	0,4650	-4.650,00	0,00
Put Kion Group 06/2023 Strike 30,00 (EURX)	Stück	-15.000			EUR	1,0250	-15.375,00	0,00
Put Michelin 06/2023 Strike 30,00 (EURX)	Stück	-55.000			EUR	3,1500	-173.250,00	-0,05
Call Blackstone 06/2023 Strike 95,00 (USS)	Stück	-22.900			USD	2,6500	-55.725,44	-0,02
Call The Procter & Gamble 04/2023 Strike 160,00 (USS)	Stück	-15.000			USD	0,0800	-1.101,93	0,00
Call Wheaton Precious Metals 06/2023 Strike 55,00 (USS)	Stück	-60.000			USD	1,0500	-57.851,24	-0,02
Put Nextera Energy Inc. 09/2023 Strike 65,00 (USS)	Stück	-30.000			USD	1,7000	-46.831,96	-0,01
Put The Procter & Gamble 04/2023 Strike 140,00 (USS)	Stück	-10.000			USD	0,7500	-6.887,05	0,00
Put Wheaton Precious Metals 06/2023 Strike 39,00 (USS)	Stück	-25.000			USD	0,5000	-11.478,42	0,00
Wertpapier-Optionsscheine								
Optionsscheine auf Aktien								
Accor Acquisition 03.06.23 WRT (FR0014003QK3)	Stück	280.000			EUR	0,0000	0,28	0,00
EHC 16.11.26 (NL0015000K28)	Stück	63.489			EUR	0,2500	15.872,25	0,00
Eureking 12.05.27 (FR0014009OX8)	Stück	257.143			EUR	0,3250	83.571,48	0,03
OboTech Acquisition 30.04.26 (LU2334364374)	Stück	130.000			EUR	0,1000	13.000,00	0,00
Altimar Acquisition 31.12.28 Cl.A (KYG0370U1168)	Stück	23.660			USD	0,0200	434,53	0,00
Brigade-M3 European Acquisition 17.01.27 WRT (KYG137071232)	Stück	200.000			USD	0,3500	64.279,16	0,02
Catcha Investment 31.12.27 Cl.A (KYG1962Y1109)	Stück	47.619			USD	0,0112	489,74	0,00
Freedom Acquisition I 31.12.27 Cl.A (KYG3663X1280)	Stück	17.857			USD	0,2171	3.559,92	0,00
Papaya Growth Opportunity 31.12.2028 Cl.A (US69882P1104)	Stück	21.276			USD	0,0250	488,43	0,00
Pyrophyte Acquisition 17.12.23 WRT (KYG7308P1274)	Stück	115.000			USD	0,1200	12.672,18	0,00
Semper Paratus Acquisition 04.11.26 (KYG8028L1317)	Stück	120.000			USD	0,0678	7.471,07	0,00
StoneBridge Acquisition 31.03.2028 (KYG850941298)	Stück	140.000			USD	0,0825	10.606,06	0,00
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)							**426.003,04**	**0,13**
Zinsterminkontrakte								
EURO-BUND JUN 23 (EURX)	EUR	2.000					80.360,00	0,03
US 10YR NOTE JUN 23 (CBT)	USD	6.100					176.838,73	0,06
US 2YR NOTE JUN 23 (CBT)	USD	7.200					67.036,88	0,02
US 5YR NOTE JUN 23 (CBT)	USD	5.200					101.767,43	0,03
Devisen-Derivate							**761.040,57**	**0,24**
Devisentermingeschäfte								
EUR/USD FUTURE (EUREX) JUN 23 (EURX)	USD	40.000					761.040,57	0,24

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1.000	Bestand	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds-vermögen
			im Berichtszeitraum					
Bankguthaben und nicht verbriefte Geldmarktinstrumente							**18.091.554,39**	**5,70**
Bankguthaben							**18.091.554,39**	**5,70**
Verwahrstelle (täglich fällig)								
EUR - Guthaben	EUR	9.434.904,01			%	100	9.434.904,01	2,97
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR	11.091,30			%	100	11.091,30	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen								
Australische Dollar	AUD	4,72			%	100	2,90	0,00
Kanadische Dollar	CAD	116,42			%	100	78,86	0,00
Schweizer Franken	CHF	768,26			%	100	770,07	0,00
Chinesische Renminbi/Yuan	CNY	4.071,16			%	100	543,99	0,00
Britische Pfund	GBP	371,50			%	100	421,87	0,00
Hongkong Dollar	HKD	57,83			%	100	6,76	0,00
Japanische Yen	JPY	600,00			%	100	4,13	0,00
Mexikanische Peso	MXN	1.137,21			%	100	57,71	0,00
Russische Rubel	RUB	1.294,00			%	100	15,39	0,00
US Dollar	USD	9.412.942,53			%	100	8.643.657,05	2,72
Südafrikanische Rand	ZAR	6,73			%	100	0,35	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände							**935.795,67**	**0,29**
Zinsansprüche	EUR	812.474,72			%	100	812.474,72	0,26
Dividenden-/Ausschüttungsansprüche	EUR	92.993,93			%	100	92.993,93	0,03
Quellensteueransprüche	EUR	21.863,02			%	100	21.863,02	0,01
Sonstige Ansprüche	EUR	8.464,00			%	100	8.464,00	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten							**-340.840,95**	**-0,11**
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-338.301,75			%	100	-338.301,75	-0,11
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-2.539,20			%	100	-2.539,20	0,00
Fondsvermögen							**317.618.976,11**	**100,00**
Anteilwert							13.913,92	
Umlaufende Anteile							22.827,423	

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
CBT	=	Chicago Board of Trade (CBOT)

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 31.03.2023

Australische Dollar	AUD	1,628550	=	EUR	1
Kanadische Dollar	CAD	1,476250	=	EUR	1
Schweizer Franken	CHF	0,997650	=	EUR	1
Chinesische Renminbi/Yuan	CNY	7,483850	=	EUR	1
Dänische Kronen	DKK	7,448900	=	EUR	1
Britische Pfund	GBP	0,880600	=	EUR	1
Hongkong Dollar	HKD	8,548550	=	EUR	1
Japanische Yen	JPY	145,365000	=	EUR	1
Mexikanische Peso	MXN	19,705050	=	EUR	1
Niederländische Gulden	NLG	2,203710	=	EUR	1
Russische Rubel	RUB	84,081700	=	EUR	1
Schwedische Kronen	SEK	11,259500	=	EUR	1
US Dollar	USD	1,089000	=	EUR	1
Südafrikanische Rand	ZAR	19,402500	=	EUR	1

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Fußnoten

3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 8.451.638,67.
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			
Coloplast B (DK0060448595)	Stück		32.000
flatexDEGIRO (DE000FTG1111)	Stück		220.000
Shell (GB00BP6MXD84)	Stück		142.000
va-Q-tec Reg. (DE0006636681)	Stück		20.709
Volkswagen Pref. (DE0007664039)	Stück		40.500
Altimar Acquisition III Cl.A (KYG0370U1085)	Stück		94.643
Baxter International (US0718131099)	Stück		28.000
Catcha Investment Cl.A (KYG1962Y1026)	Stück		142.858
Constellation Acquisition Cl.A (KYG2R18K1053)	Stück		50.000
Conx (US2128731039)	Stück		283.019
Emerson Electric Co. (US2910111044)	Stück		40.000
Forest Road Acquisition II Cl.A (US34619V1035)	Stück		54.762
FORTRESS VALUE ACQUIS IV Cl.A (US34964K1088)	Stück		191.667
Fortress Value Acquisition III Cl.A (US34964G1076)	Stück		48.214
FTAC Hera Acquisition Cl.A (KYG3728Y1035)	Stück		47.322
General Electric (US3696043013)	Stück	49.492	98.984
Northern Revival Acquis. Corp. (KYG6546R1011)	Stück		200.000
Oyster Enterprises Acquisition Cl.A (US69242M1045)	Stück		200.000
Paramount Group (US69924R1086)	Stück		420.000
Periphas Capital Partnering Cl.A (US7138951006)	Stück		31.035
Semper Paratus Acquisition Cl.A (KYG8028L1077)	Stück		240.000
SVF Investment Cl.A (KYG8601L1023)	Stück		142.857
Tastemaker Acquisition Cl.A (US8765451047)	Stück		240.000
The Music Acquisition Cl.A (US62752R1005)	Stück		35.714
Thunder Bridge Capital Partners III Cl.A (US88605T1007)	Stück		53.572
Twilio (US90138F1021)	Stück		24.000
TZP Strategies Acquisition Cl.A (KYG915951019)	Stück		47.945
Verzinsliche Wertpapiere			
0,3340 % Becton Dickinson Euro Finance 21/13.08.28 (XS2375844144)	EUR		2.000
0,3750 % Red Eléctrica Financiaciones 20/24.07.28 MTN (XS2103013210)	EUR		400
3,7500 % Teva Pharmaceutical Industries 21/09.05.27 (XS2406607098)	EUR		1.130
Verbriefte Geldmarktinstrumente			
2,7730 % LB Baden-Württemberg 00/17.01.30 MTN (XS0105748205)	EUR		2.000

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			
CHURCHILL CAPITAL CORP VII-A 29.02.28 (US17144M1100)	Stück		28.571
Constellation Acquisition Cl.A 31.12.27 (KYG2R18K1137)	Stück		16.666
Conx 30.10.27 (US2128731112)	Stück		70.754
Forest Road Acquisition II 15.01.26 (US34619V1118)	Stück		10.952
Fortress Value Acquisition 31.12.27 WRT (US34964G1159)	Stück		9.642
Fortress Value Acquisition IV 18.03.28 (US34964K1161)	Stück		23.958
FTAC Hera Acquisition 31.12.27 (KYG3728Y1118)	Stück		11.830
Noble Rock Acquisition 31.12.27 (KYG6546R1193)	Stück		66.666
Oyster Enterprises Acquisition 31.12.27 WRT (US69242M1128)	Stück		100.000
Periphas Capital Partnering 10.12.28 WRT (US7138951188)	Stück		7.758
SVF Investment Cl.A 31.12.27 (KYG8601L1288)	Stück		28.571
Tastemaker Acquisition 31.12.25 WRT (US8765451120)	Stück		35.714
The Music Acquisition 05.02.28 (US62752R1187)	Stück		17.857
Thunder Bridge Capital Partners 15.02.28 Cl.A (US88605T1189)	Stück		10.714
TZP Strategies Acquisition Cl.A 31.12.27 (KYG915951191)	Stück		15.981
			Volumen in 1.000
Terminkontrakte			
Aktienindex-Terminkontrakte			
Verkaufte Kontrakte: (Basiswerte: DAX 40 (Performanceindex))	EUR		36.275
Zinsterminkontrakte			
Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: EURO-BUND MAR 23, US 10YR NOTE MAR 23, US 2YR NOTE MAR 23, US 5YR NOTE MAR 23)	EUR		26.864
Verkaufte Kontrakte: (Basiswerte: EURO-BUND MAR 23)	EUR		665
Devisentermingeschäfte			
Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: EUR/USD FUTURE (CME) MAR 23)	EUR		56.730

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

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

		Zugänge	Abgänge
Optionsrechte			
Wertpapier-Optionsrechte			
Optionsrechte auf Aktien			
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswerte: Aurubis, Blackstone, Dr. Ing. h.c. F. Porsche, Kion Group, Wacker Chemie)	EUR	7.800	
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: Air Liquide, ASML Holding, Covestro, Dr. Ing. h.c. F. Porsche, Kion Group, Las Vegas Sands Corp., Newmont, Sartorius Pref., Sika Reg., The Procter & Gamble, Wacker Chemie)	EUR	23.003	
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate			
Optionsrechte auf Aktienindices			
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: DAX 40 (Performanceindex))	EUR	88.900	
Optionsrechte auf Zins-Derivate			
Optionsrechte auf Zinsterminkontrakte			
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: EURO-BUND MAR 23)	EUR	3.960	

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

		Volumen in 1.000
unbefristet	EUR	44.459

Gattung: Multi Units Luxembourg Sicav - (LU1781541252), Xtrackers MSCI EM Asia ESG Screened UCITS ETF (LU0292107991), 3,3750 % Allianz 14/und. MTN (DE000A13R7Z7), 3,0390 % Banco Santander 04/Und. (XS0202197694), 0,3340 % Becton Dickinson Euro Finance 21/13.08.28 (XS2375844144), 0,3750 % BNP Paribas 20/14.10.27 MTN (FR00140005J1), 0,5000 % Caixabank 21/09.02.29 MTN (XS2297549391), 0,3750 % Credit Agricole London 19/21.10.25 MTN Reg S (XS2067135421), 2,2500 % DIC Asset 21/22.09.26 (XS2388910270), Germany 14/15.04.30 INFL (DE0001030559), 0,7500 % Intesa Sanpaolo 21/16.03.28 MTN (XS2317069685), 0,6250 % Intesa Sanpaolo 21/24.02.26 MTN (XS2304664167), 0,8750 % Iren 19/14.10.29 MTN (XS2065601937), 1,3750 % La Banque Postale 19/24.04.29 MTN (FR0013415692), 0,2500 % LB Baden-Württemberg 21/21.07.28 MTN (DE000LB2V7C3), 0,7500 % NatWest Group 19/15.11.25 (XS2080205367), 0,7500 % Snam 22/20.06.29 MTN (XS2433211310), 0,8750 % Societe Generale 20/22.09.28 Mtn (FR0013536661), 0,0100 % Sparebanken Vest Boligkreditt 20/28.06.27 MTN PF (XS2199484929), 3,7500 % Teva Pharmaceutical Industries 21/09.05.27 (XS2406607098), 0,0000 % Unedic 20/25.11.28 MTN (FR0014000667), 2,1250 % UniCredit 16/24.10.26 MTN (XS1508450688), 2,5000 % ZF Europe Finance 19/23.10.27 (XS2010039977), 5,2846 % BNP Paribas 86/und (FR0008131403), 5,3601 % DNB Bank 86/und. (GB0040940875), 5,5000 % HSBC Bank 85/und. (XS0015190423), 6,3124 % Standard Chartered 06/und. Reg S (USG84228AT58)

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Anhang gemäß § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert: EUR 13.913,92

Umlaufende Anteile: 22.827,423

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände:

Die Bewertung erfolgt durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft 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 geringfügigem Umfang zu abgeleiteten Verkehrswerten bewertet.

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 Strategie-Fonds Nr. 1

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
1. Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	8.451.638,67	-	-
in % des Fondsvermögens	2,66	-	-
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name	Credit Agricole Corporate and Investment Bank, Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	2.745.030,00		
Sitzstaat	Frankreich		
2. Name	Deutsche Bank AG, Frankfurt am Main		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1.740.116,17		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
3. Name	UniCredit Bank AG, München		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1.677.241,80		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
4. Name	Barclays Bank Ireland PLC, Dublin		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1.598.313,65		
Sitzstaat	Irland		
5. Name	Morgan Stanley Europe S.E., Frankfurt am Main		
Bruttovolumen offene Geschäfte	501.639,23		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
6. Name	Credit Suisse Bank (Europe) S.A., Madrid		
Bruttovolumen offene Geschäfte	189.297,82		
Sitzstaat	Spanien		
7. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
8. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

9. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

10. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

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	8.451.638,67	-	-

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

Art(en):			
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	9.329.733,72	-	-
Aktien	424.273,00	-	-
Sonstige	547,65	-	-

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 Strategie-Fonds Nr. 1

6. Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten

Währung(en):	USD; EUR; 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	9.754.554,37	-	-

8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich) *

	Ertragsanteil des Fonds		
absolut	41.256,91	-	-
in % der Bruttoerträge	68,00	-	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	-
	Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft		
absolut	19.445,39	-	-
in % der Bruttoerträge	32,00	-	-
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. Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgegenstände des Fonds

Summe	8.451.638,67
Anteil	2,83

11. Die 10 größten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps

1. Name	French Republic		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3.368.058,97		
2. Name	LfA Förderbank Bayern		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1.147.529,16		

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

3. Name	International Development Association		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	948.862,08		
4. Name	NRW.BANK		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	647.449,81		
5. Name	Slovenia, Republic of		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	553.560,00		
6. Name	Brussels Capital, Region		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	513.877,00		
7. Name	Slovakia, Republic of		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	375.209,57		
8. Name	Netherlands, Kingdom of the		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	171.395,44		
9. Name	Deutschland, Bundesrepublik		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	151.640,93		
10. Name	European Investment Bank (EIB)		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	151.399,03		

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 Strategie-Fonds Nr. 1

	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	9.754.554,37		

* 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 Aufsichtsrates 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