

DWS Investment S.A.

DWS Vorsorge

Halbjahresbericht 2019

- DWS Vorsorge Premium
- DWS Vorsorge Premium Balance
- DWS Vorsorge Premium Balance Plus
- DWS Vorsorge Premium Plus
- DWS Vorsorge Rentenfonds 1Y
- DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y
- DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y
- DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y
- DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y
- DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y
- DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

Fonds Luxemburger Rechts



Hinweise für Anleger in der Bundesrepublik Deutschland

Verkaufsprospekt, Verwaltungsreglement, „Wesentliche Anlegerinformationen“, Halbjahres- und Jahresberichte, Ausgabe- und Rücknahmepreise sind kostenlos bei der Verwaltungsgesellschaft sowie den Zahl- und Informationsstellen erhältlich.

Rücknahmeanträge können bei den deutschen Zahlstellen eingereicht werden. Sämtliche Zahlungen (Rücknahmeerlöse, etwaige Ausschüttungen und sonstige Zahlungen) werden durch die deutschen Zahlstellen an die Anleger ausgezahlt.

Die Ausgabe- und Rücknahmepreise der Anteile sowie etwaige Mitteilungen an die Anteilinhaber werden grundsätzlich im Internet unter www.dws.de veröffentlicht. Sofern in einzelnen Fällen eine Veröffentlichung in einer Tageszeitung oder im Recueil Electronique des Sociétés et Associations (RESA) des Handels- und Firmenregisters in Luxemburg gesetzlich vorgeschrieben ist, erfolgt die Veröffentlichung in Deutschland im Bundesanzeiger.

Vertriebs-, Zahl- und Informationsstellen für Deutschland sind:

Deutsche Bank AG
Taunusanlage 12
D-60325 Frankfurt am Main
und deren Filialen

Deutsche Bank Privat- und Geschäftskunden AG
Theodor-Heuss-Allee 72
D-60486 Frankfurt am Main
und deren Filialen

Inhalt

Halbjahresbericht 2019
vom 1.1.2019 bis 30.6.2019

Hinweise	2
Halbjahresbericht DWS Vorsorge DWS Vorsorge Premium	4
DWS Vorsorge Premium Balance	5
DWS Vorsorge Premium Balance Plus	6
DWS Vorsorge Premium Plus	7
DWS Vorsorge Rentenfonds 1Y	8
DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y	9
DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y	10
DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y	11
DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y	12
DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y	13
DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration	14
Vermögensaufstellungen zum Halbjahresabschluss	16
Hinweise für Anleger in der Schweiz	104

Hinweise

Die in diesem Bericht genannten Fonds sind Teilfonds eines Umbrella-fonds nach Luxemburger Recht.

Wertentwicklung

Der Erfolg einer Investment-fondsanlage wird an der Wertentwicklung der Anteile gemessen. Als Basis für die Wertberechnung werden die Anteilwerte (= Rücknahmepreise) herangezogen, unter Hinzurechnung zwischenzeitlicher Ausschüttungen, die z.B. im Rahmen der Investmentkonten bei der DWS Investment S.A. kostenfrei reinvestiert werden. Angaben zur bisherigen Wert-

entwicklung 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 30. Juni 2019** wieder (sofern nichts anderes angegeben ist).

Verkaufsprospekte

Der Kauf von Fondsanteilen erfolgt auf Grundlage des zzt. gültigen Verkaufsprospekts und Verwaltungsreglements sowie des Dokuments „Wesentliche Anlegerinformationen“, ergänzt durch den jeweiligen letzten geprüften Jahresbericht und

zusätzlich durch den jeweiligen Halbjahresbericht, falls ein solcher jüngeren Datums als der letzte Jahresbericht vorliegt.

Ausgabe- und Rücknahmepreise

Die jeweils gültigen Ausgabe- und Rücknahmepreise sowie alle sonstigen Informationen für die Anteilinhaber können jederzeit am Sitz der Verwaltungsgesellschaft sowie bei den Zahlstellen erfragt werden. Darüber hinaus werden die Ausgabe- und Rücknahmepreise in jedem Vertriebsland in geeigneten Medien (z.B. Internet, elektronische Informationssysteme, Zeitungen, etc.) veröffentlicht.

Halbjahresbericht

DWS Vorsorge Premium

DWS Vorsorge Premium Wertentwicklung im Überblick	
ISIN	6 Monate
LU0272367581	8,7%

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

Stand: 30.6.2019

Angaben auf Euro-Basis

DWS Vorsorge Premium Balance

DWS Vorsorge Premium Balance Wertentwicklung im Überblick	
ISIN	6 Monate
LU0504964221	7,4%

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

Stand: 30.6.2019
Angaben auf Euro-Basis

DWS Vorsorge Premium Balance Plus

DWS Vorsorge Premium Balance Plus Wertentwicklung im Überblick	
ISIN	6 Monate
LU0504964494	7,0%

Wertentwicklung nach BVI-Methode, d. h. ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages. Wertentwicklungen der Vergangenheit ermöglichen keine Prognose für die Zukunft.
Stand: 30.6.2019

Angaben auf Euro-Basis

DWS Vorsorge Premium Plus

DWS Vorsorge Premium Plus Wertentwicklung im Überblick	
ISIN	6 Monate
LU0504964148	8,2%

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

Stand: 30.6.2019

Angaben auf Euro-Basis

DWS Vorsorge Rentenfonds 1Y

DWS Vorsorge Rentenfonds 1Y Wertentwicklung im Überblick	
ISIN	6 Monate
LU0659576127	-0,1%

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

Stand: 30.6.2019

Angaben auf Euro-Basis

DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y

DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y Wertentwicklung im Überblick	
ISIN	6 Monate
LU0359921623	0,7%

Wertentwicklung nach BVI-Methode, d. h. ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages. Wertentwicklungen der Vergangenheit ermöglichen keine Prognose für die Zukunft.
Stand: 30.6.2019

Angaben auf Euro-Basis

DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y

DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y Wertentwicklung im Überblick	
ISIN	6 Monate
LU0272369017	2,0%

Wertentwicklung nach BVI-Methode, d. h. ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages. Wertentwicklungen der Vergangenheit ermöglichen keine Prognose für die Zukunft.
Stand: 30.6.2019

Angaben auf Euro-Basis

DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y

DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y Wertentwicklung im Überblick	
ISIN	6 Monate
LU0272368712	3,8%

Wertentwicklung nach BVI-Methode, d. h. ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages. Wertentwicklungen der Vergangenheit ermöglichen keine Prognose für die Zukunft.
Stand: 30.6.2019

Angaben auf Euro-Basis

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y Wertentwicklung im Überblick	
ISIN	6 Monate
LU0272368639	6,5%

Wertentwicklung nach BVI-Methode, d. h. ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages. Wertentwicklungen der Vergangenheit ermöglichen keine Prognose für die Zukunft.
Stand: 30.6.2019

Angaben auf Euro-Basis

DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y

DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y Wertentwicklung im Überblick	
ISIN	6 Monate
LU0272368126	10,7%

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

Stand: 30.6.2019

Angaben auf Euro-Basis

DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration Wertentwicklung im Überblick	
ISIN	6 Monate
LU0414505502	21,9%

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

Stand: 30.6.2019

Angaben auf Euro-Basis

Vermögensaufstellung zum Halbjahresabschluss

DWS Vorsorge Premium

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Investmentanteile						536 668 018,44	94,54
Gruppeneigene Investmentanteile						370 615 996,01	65,29
Deutsche Institutional Cash Plus IC (LU0193172185) (0,050%)	Stück	1 190	1 688	3 108	EUR	11 739,5000	2,46
Deutsche Institutional Money plus IC (LU0099730524) (0,100%)	Stück	991	1 574	2 843	EUR	13 928,4100	2,43
Deutsche Institutional Vario Yield (LU1120400566) (0,100%)	Stück	140 901	199 888	367 976	EUR	99,1400	2,46
Deutsche Institutional Yield (LU0224902659) (0,100%)	Stück	1 240	2 014	3 506	EUR	11 265,6600	2,46
DWS Euro Reserve LC (LU0011254512) (0,300%)	Stück	103 698	165 298	248 880	EUR	133,1400	2,43
DWS Global Growth LD (DE0005152441) (1,450%)	Stück	40 438	46 241	54 150	EUR	125,8100	0,90
DWS Global Value LD (LU0133414606) (1,450%)	Stück	23 387	27 988	41 143	EUR	254,0700	1,05
DWS Global Water (DE000DWSODT1) (1,450%)	Stück	88 531	89 082	129 117	EUR	47,8600	0,75
DWS Health Care Typ O FC (DE000DWS2ED9) (0,850%)	Stück	18 716	14 853	17 483	EUR	262,6700	0,87
DWS Invest CROCI Euro IC (LU1769937829) (0,500%)	Stück	11 328	8 358	17 534	EUR	290,6900	0,58
DWS Invest Emerging Markets Top Dividend FC (LU0329760267) (0,750%)	Stück	38 826	30 588	37 767	EUR	127,4700	0,87
DWS Rendite Optima Four Seasons (LU0225880524) (0,100%)	Stück	138 238	189 657	361 711	EUR	101,0500	2,46
DWS SDG Global Equities LD (DE0005152466) (1,450%)	Stück	43 961	60 992	69 873	EUR	77,2400	0,60
DWS Smart Industrial Technologies LD (DE0005152482) (1,450%)	Stück	29 052	21 817	26 713	EUR	117,6600	0,60
DWS US Growth (DE0008490897) (1,450%)	Stück	53 952	40 146	50 870	EUR	219,8900	2,09
Xtrackers FTSE 100 UCITS ETF 1C (LU0838780707) (0,010%)	Stück	325 996	228 707	282 888	EUR	10,4040	0,60
Xtrackers MSCI Canada UCITS ETF 1C (LU0476289540) (0,150%)	Stück	122 017	142 903	164 862	EUR	47,3150	1,02
Xtrackers MSCI EM Asia Swap UCITS ETF 1C (LU0292107991) (0,450%)	Stück	314 029	263 343	257 082	EUR	43,5150	2,41
Xtrackers MSCI Emerging Markets Swap UCITS ETF 1C (LU0292107645) (0,290%)	Stück	129 012	218 630	89 618	EUR	39,7160	0,90
Xtrackers MSCI Emerging Markets UCITS ETF 1C (IE00BTJRM35) (0,100%)	Stück	329 405	728 613	399 208	EUR	43,1600	2,50
Xtrackers MSCI Japan UCITS ETF 1C (LU0274209740) (0,200%)	Stück	133 834	190 695	310 462	EUR	50,9580	1,20
Xtrackers MSCI Pacific ex Japan UCITS ETF 1C (LU0322252338) (0,300%)	Stück	137 918	116 929	146 489	EUR	56,7700	1,38
Xtrackers MSCI USA Swap UCITS ETF 1C (LU0274210672) (0,200%)	Stück	889 045	794 734	828 030	EUR	70,3400	11,02
Xtrackers MSCI World Cons. Discr. UCITS ETF 1C (IE00BM67HP23) (0,150%)	Stück	170 449	130 341	157 990	EUR	30,1050	0,90
Xtrackers MSCI World Consumer Staples UCITS ETF 1C (IE00BM67HN09) (0,150%)	Stück	161 281	183 717	145 534	EUR	31,3250	0,89
Xtrackers MSCI World Information Tech. UCITS ETF 1C (IE00BM67HT60) (0,150%)	Stück	62 421	43 399	57 934	EUR	27,3950	0,30
Xtrackers MSCI World Quality UCITS ETF 1C (IE00BL25JL35) (0,150%)	Stück	51 077	37 963	47 193	EUR	33,3350	0,30
Xtrackers MSCI World Swap UCITS ETF 1C (LU0274208692) (0,350%)	Stück	549 759	2 703 344	2 153 585	EUR	54,6880	5,30
Xtrackers MSCI World UCITS ETF 1C (IE00BJKDDQ92) (0,090%)	Stück	1 327 335	2 685 505	1 358 170	EUR	55,4780	73 637 891,13
Xtrackers MSCI World Value UCITS ETF 1C (IE00BL25JM42) (0,150%)	Stück	63 399	98 313	103 131	EUR	27,0600	1 715 576,94
DWS Invest Global Real Estate Securities USD FC (LU0507268943) (0,750%)	Stück	10 000	8 158	9 691	USD	188,6700	1 656 598,47
Gruppenfremde Investmentanteile						166 052 022,43	29,25
AXA Rosenberg Equity Alpha Trust B (EUR) (IE0031069051) (1,350%)	Stück	820 238	1 303 225	482 987	EUR	17,8100	14 608 438,78
Parvest Equity Europe Growth - I (LU0823404677) (0,750%)	Stück	42 037	39 769	50 446	EUR	195,0400	8 198 896,48
Parvest Equity Europe Small Cap - IC (LU0212179997) (0,850%)	Stück	63 673	71 998	56 051	EUR	258,2700	16 444 825,71
Parvest SICAV - Equity Innovators I Cap (LU0823414809) (0,750%)	Stück	8 931	7 001	7 509	EUR	550,9200	4 920 266,52
RCGF SICAV-Robeco QI Emerging Cons. Equities D EUR (LU0582533245) (1,250%)	Stück	38 738	42 637	49 651	EUR	170,0500	6 587 396,90
RCGF SICAV-Robeco QI Global Momentum Equities IEUR (LU0803250884) (0,550%)	Stück	8 045	5 937	7 548	EUR	203,0900	1 633 859,05
Robeco BP GI Premium Equities I EUR (LU0233138477) (0,680%)	Stück	102 511	180 183	77 672	EUR	159,6700	16 367 931,37
Robeco Capit. Growth-New World Financials Equities (LU1821197768) (0,000%)	Stück	802	568	768	EUR	10 236,1600	8 209 400,32

DWS Vorsorge Premium

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
Schr. Intl. Selection Fd.- Emerging Asia Acc Eur (LU1751207348) (0,000%)	Stück	282 347	404 138	121 791	EUR	38,7328	10 936 089,88	1,93
Schroder ISF - Euro Equity A (Acc.) Reg. (LU0106235293) (1,250%)	Stück	147 120	227 730	80 610	EUR	35,0978	5 163 588,34	0,91
Schroder ISF Fd. SICAV - US Large Cap A Acc. EUR (LU0248185190) (1,250%)	Stück	61 477	96 621	35 144	EUR	137,3021	8 440 921,20	1,49
Threadneedle Lux- Global Select 1E EUR ACC (LU1864957136) (1,500%)	Stück	5 888 141	9 596 675	3 708 534	EUR	2,7800	16 369 031,98	2,88
Threadneedle (Lux) - Global Focus AU EUR (LU0757431068) (1,500%)	Stück	277 500	458 837	181 337	EUR	59,9600	16 638 900,00	2,93
Schroder Inte.Selection Fund-Japanese Equity A Acc (LU0106239873) (1,250%)	Stück	1 151 950	1 815 707	663 757	JPY	1 093,4650	10 272 524,93	1,81
AXA Rosenb. EA Tr. - US Enh. Eq. Alpha Fd. Cl.A (IE0033609615) (0,350%)	Stück	560 926	417 213	524 579	USD	36,4800	17 966 968,55	3,16
Parvest - US Small Cap I Cap. (LU0823411292) (0,850%)	Stück	12 842	10 276	44 562	USD	292,0400	3 292 982,42	0,58
Summe Wertpapiervermögen							536 668 018,44	94,54
Derivate								
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen								
Swaps							2 213 075,37	0,39
Equity-Swaps								
Swap 75% Gap Risk DWS Vorsorge Premium (DBK) 11.12.2019 (OTC)	EUR	0,100					-228 792,15	-0,04
Total Return Swaps								
Swap 3MEuribor/NDEEWNR IDX 75% Pr(JPM) 13.03.20 (OTC) ⁷⁾	EUR	30 000					27 595,20	0,01
Swap 3MEuribor/NDEEWNR IDX 75% Pr(JPM) 13.03.20 (OTC) ⁷⁾	EUR	36 000					1 207 136,16	0,21
Swap 3MEuribor/NDEEWNR IDX 75% Pr(MLL) 13.03.20 (OTC) ⁷⁾	EUR	36 000					1 207 136,16	0,21
Bankguthaben							29 375 217,26	5,17
Verwahrstelle (täglich fällig)								
EUR - Guthaben	EUR	27 223 165,07			%	100	27 223 165,07	4,80
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen								
Japanische Yen	JPY	47 591 491,00			%	100	388 121,77	0,07
US Dollar	USD	2 008 940,35			%	100	1 763 930,42	0,30
Sonstige Vermögensgegenstände							901,02	0,00
Zinsansprüche	EUR	901,02			%	100	901,02	0,00
Summe der Vermögensgegenstände ¹⁾							568 486 004,24	100,14
Sonstige Verbindlichkeiten							-577 433,50	-0,10
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-555 033,82			%	100	-555 033,82	-0,10
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-22 399,68			%	100	-22 399,68	0,00
Fondsvermögen							567 679 778,59	100,00
Anteilwert							138,96	
Umlaufende Anteile							4 085 315,000	

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

DWS Vorsorge Premium

Marktschlüssel

Terminbörsen

OTC = Over the Counter

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 28.06.2019

Japanische Yen	JPY	122,620000	= EUR	1
US Dollar	USD	1,138900	= EUR	1

Erläuterungen zur Bewertung

Die Anteilswerte werden von der Verwaltungsgesellschaft ermittelt sowie die Bewertung der Vermögenswerte des Fondsvermögens durchgeführt. Die grundsätzliche Kursversorgung sowie die Preisvalidierung erfolgen nach den von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der in den gesetzlichen Bestimmungen/Verordnungen bzw. im Prospekt des Fonds definierten Grundsätze für Bewertungsmethoden eingeführten Verfahren.

Sofern keine handelbaren Kurse vorliegen, werden Bewertungsmodelle zur Preisermittlung (abgeleitete Verkehrswerte) genutzt, die zwischen State Street Bank Luxemburg als externem Price Service Provider und Verwaltungsgesellschaft 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 nicht zu abgeleiteten Verkehrswerten bewertet.

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

Fußnoten

- 1) Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.
 7) Swaps im Sinne der EU-Verordnung 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012

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 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
-----------------------	-------------------------------	--------------------------	-----------------------------

Investmentanteile

Gruppeneigene Investmentanteile

DWS Invest Top Euroland FC (LU0145647722) (0,750%)	Stück	8 137	35 134
DWS Rendite Optima (LU0069679222) (0,100%)	Stück		244 149

Gruppenfremde Investmentanteile

AXA Rosenberg Eq. Alpha Tr. - Global Equity A EUR (IE00B1VJ6602) (0,700%)	Stück	214 884	1 013 054
Robeco BP Global Premium Equities Cl.D EUR (LU0203975437) (1,250%)	Stück	3 000	73 559
Schroder Int. Selection Fund Emerging Asia C (LU0248173857) (1,000%)	Stück	102 827	413 560
Schroder ISF - Euro Equity C (Acc.) Reg. (LU0106235459) (0,750%)	Stück	49 318	213 973
Schroder ISF US Large Cap C Acc. (LU0248185604) (0,750%)	Stück	20 275	79 972
Threadneedle - Lux - SICAV-Gl. Select 8E EUR Acc. (LU1864957300) (0,000%)	Stück	6 094 664	6 094 664
Threadneedle - Global Select Fund 1 (EUR) Acc. (GB00B3KZX518) (1,000%)	Stück	322 395	5 459 244
Schroder ISF - Japanese Equity C (Acc.) (LU0106240533) (0,750%)	Stück	486 036	1 507 106
Threadneedle (Lux) - Global Focus ZU USD (LU0957791311) (0,750%)	Stück	483 969	1 909 798

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

Volumen in 1000

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Verkaufte Kontrakte: EUR 33 037
 (Basiswerte: MSCI World Net Return Index)

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

Volumen in 1000
 unbefristet EUR 14 825

Gattung: Xtrackers MSCI EM Asia Swap UCITS ETF 1C (LU0292107991), Xtrackers MSCI Emerging Markets UCITS ETF 1C (IE00BJRMP35)

DWS Vorsorge Premium Balance

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Investmentanteile						19 877 909,00	96,35
Gruppeneigene Investmentanteile						19 877 909,00	96,35
DWS Akkumula LC (DE0008474024) (1,450%)	Stück	579	492	100	EUR	1 145,4500	3,21
DWS Convertibles LD (DE0008474263) (0,850%)	Stück	3 281	2 195	379	EUR	125,6400	2,00
DWS Emerging Markets Bonds (Short) LC (LU0599900635) (0,600%)	Stück	1 995	549	2 067	EUR	103,5700	1,00
DWS European Opportunities TFC (DE000DWS2NN9) (0,800%)	Stück	896	671	154	EUR	324,5400	1,41
DWS Global Hybrid Bond Fund LD (DE0008490988) (0,850%)	Stück	7 692	2 189	8 800	EUR	40,3000	1,50
DWS Global Value LD (LU0133414606) (1,450%)	Stück	1 646	1 506	491	EUR	254,0700	2,03
DWS Global Water (DE000DWS0DT1) (1,450%)	Stück	3 979	3 956	1 534	EUR	47,8600	0,92
DWS Health Care Typ O FC (DE000DWS2ED9) (0,850%)	Stück	362	323	85	EUR	262,6700	0,46
DWS Invest Asian Bonds FCH (LU0813324794) (0,600%)	Stück	6 948	2 975	931	EUR	134,1400	4,52
DWS Invest Emerging Markets Corporates FCH (LU0507270097) (0,600%)	Stück	2 186	696	3 124	EUR	142,3600	1,51
DWS Invest Euro Corporate Bonds FC (LU0300357802) (0,600%)	Stück	8 413	1 991	1 209	EUR	172,1000	7,02
DWS Invest Euro High Yield Corporates FC (LU0616840772) (0,650%)	Stück	3 370	2 576	380	EUR	160,0400	2,61
DWS Invest Euro-Gov. Bonds FC (LU0145654009) (0,350%)	Stück	9 151	2 183	1 433	EUR	211,5800	9,38
DWS Invest Gold and Precious Metals Equities FC (LU0273148212) (0,750%)	Stück	1 175	1 140	414	EUR	84,2800	0,48
DWS Invest II US Top Dividend FC (LU0781239156) (0,750%)	Stück	872	753	180	EUR	216,3100	0,91
DWS Invest Top Dividend FC (LU0507266228) (0,750%)	Stück	840	742	188	EUR	226,4100	0,92
DWS Invest Top Euroland FC (LU0145647722) (0,750%)	Stück	1 318	1 273	719	EUR	231,9200	1,48
DWS SDG Global Equities LD (DE0005152466) (1,450%)	Stück	2 459	2 123	482	EUR	77,2400	0,92
DWS Smart Industrial Technologies LD (DE0005152482) (1,450%)	Stück	1 139	889	278	EUR	117,6600	0,65
DWS Top Europe LD (DE0009769729) (1,400%)	Stück	1 311	1 111	226	EUR	146,2100	0,93
DWS US Growth (DE0008490897) (1,450%)	Stück	1 713	1 449	327	EUR	219,8900	1,83
DWS Vermögensbildungsfonds I LD (DE0008476524) (1,450%)	Stück	5 097	4 317	868	EUR	167,0100	4,13
Xtr. II iBoxx Euroz. Gov. Bond Y.PI. UCITS ETF 1C (LU0524480265) (0,050%)	Stück	2 268	542	335	EUR	181,8650	2,00
Xtrackers II Global Gov.Bond UCITS ETF 1C-EUR Hed. (LU0378818131) (0,150%)	Stück	5 723	1 827	891	EUR	233,9800	6,49
Xtrackers II USD EM Bond UCITS ETF 1C - EUR Hed. (LU0321462953) (0,300%)	Stück	938	1 046	108	EUR	331,5600	1,51
Xtrackers MSCI AC Asia ex Japan Swap UCITS ETF 1C (LU0322252171) (0,450%)	Stück	17 367	15 501	1 869	EUR	38,8200	3,27
Xtrackers MSCI Canada UCITS ETF 1C (LU0476289540) (0,150%)	Stück	3 216	2 758	602	EUR	47,3150	0,74
Xtrackers MSCI Emerging Markets Swap UCITS ETF 1C (LU0292107645) (0,290%)	Stück	12 114	10 197	1 742	EUR	39,7160	2,33
Xtrackers MSCI Europe Small Cap UCITS ETF 1C (LU0322253906) (0,200%)	Stück	11 239	11 959	720	EUR	42,7550	2,33
Xtrackers MSCI Japan UCITS ETF 1C (LU0274209740) (0,200%)	Stück	9 317	8 138	2 755	EUR	50,9580	2,30
Xtrackers MSCI Pacific ex Japan UCITS ETF 1C (LU0322252338) (0,300%)	Stück	3 380	2 947	668	EUR	56,7700	0,93
Xtrackers MSCI USA Swap UCITS ETF 1C (LU0274210672) (0,200%)	Stück	16 140	13 902	2 636	EUR	70,3400	5,50
Xtrackers MSCI World Communica. Serv. UCITS ETF 1C (IE00BM67HR47) (0,150%)	Stück	4 560			EUR	11,6100	0,26
Xtrackers MSCI World Cons. Discr. UCITS ETF 1C (IE00BM67HP23) (0,150%)	Stück	4 409	4 219	848	EUR	30,1050	0,64
Xtrackers MSCI World Energy UCITS ETF 1C (IE00BM67HM91) (0,150%)	Stück	6 803	5 832	1 118	EUR	28,2800	0,93
Xtrackers MSCI World Financials UCITS ETF 1C (IE00BM67HL84) (0,150%)	Stück	17 246	14 631	2 885	EUR	16,5860	1,39
Xtrackers MSCI World Information Tech. UCITS ETF 1C (IE00BM67HT60) (0,150%)	Stück	3 476	2 830	572	EUR	27,3950	0,46
Xtrackers S&P 500 Swap UCITS ETF 1C (LU0490618542) (0,050%)	Stück	24 079	20 308	4 140	EUR	47,1480	5,50
Xtrackers USD Corporate Bond UCITS ETF 1D (IE00BZ036H21) (0,060%)	Stück	61 290	15 115	10 900	EUR	13,4090	3,98
Xtrackers USD EM Bd.Qual.Weighted UCITS ETF 1D (IE00BD4DX952) (0,400%)	Stück	69 706	17 527	11 251	EUR	11,7370	3,97

DWS Vorsorge Premium Balance

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
DWS Invest Global High Yield Corporates USD FC (LU1506496097) (0,650%)	Stück	4 030	2 676	1 446	USD 116,0500	410 643,16	1,99
Summe Wertpapiervermögen						19 877 909,00	96,35
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Swaps						-4 921,79	-0,02
Equity-Swaps							
Swap 75% Gap Risk DWS Vorsorge Premium Balance (UBS) 17.01.2020 (OTC)	EUR	0,100				-4 921,79	-0,02
Bankguthaben						769 442,80	3,73
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	752 765,82			% 100	752 765,82	3,65
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							
Japanische Yen	JPY	313 062,00			% 100	2 553,11	0,01
US Dollar	USD	16 085,67			% 100	14 123,87	0,07
Summe der Vermögensgegenstände ¹⁾						20 647 351,80	100,08
Sonstige Verbindlichkeiten							
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-10 289,61			% 100	-10 289,61	-0,06
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-846,13			% 100	-846,13	0,00
Fondsvermögen						20 631 294,27	100,00
Anteilwert						136,76	
Umlaufende Anteile						150 854,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

OTC = Over the Counter

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 28.06.2019

Japanische Yen	JPY	122,620000	= EUR	1
US Dollar	USD	1,138900	= EUR	1

DWS Vorsorge Premium Balance

Erläuterungen zur Bewertung

Die Anteilwerte werden von der Verwaltungsgesellschaft ermittelt sowie die Bewertung der Vermögenswerte des Fondsvermögens durchgeführt. Die grundsätzliche Kursversorgung sowie die Preisvalidierung erfolgen nach den von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der in den gesetzlichen Bestimmungen/Verordnungen bzw. im Prospekt des Fonds definierten Grundsätze für Bewertungsmethoden eingeführten Verfahren.

Sofern keine handelbaren Kurse vorliegen, werden Bewertungsmodelle zur Preisermittlung (abgeleitete Verkehrswerte) genutzt, die zwischen State Street Bank Luxemburg als externem Price Service Provider und Verwaltungsgesellschaft 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.

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

Fußnoten

1) Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.

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 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
Investmentanteile			
Gruppeneigene Investmentanteile			
Deutsche Institutional Cash Plus IC (LU0193172185) (0,050%)	Stück	11	75
Deutsche Institutional Money plus IC (LU0099730524) (0,100%)	Stück	9	63
Deutsche Institutional Vario Yield (LU1120400566) (0,100%)	Stück	1 320	8 896
Deutsche Institutional Yield (LU0224902659) (0,100%)	Stück	12	79
DWS Euro Reserve LC (LU0011254512) (0,300%)	Stück	983	6 620
DWS Invest Multi Asset Balance FC (LU1054338832) (0,650%)	Stück	246	4 108
DWS Rendite Optima (LU0069679222) (0,100%)	Stück	1 189	8 010
DWS Rendite Optima Four Seasons (LU0225880524) (0,100%)	Stück	1 289	8 687

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

	Volumen in 1000	
unbefristet	EUR	2 285

Gattung: Xtrackers II Global Gov.Bond UCITS ETF 1C-EUR
Hed. (LU0378818131)

DWS Vorsorge Premium Balance Plus

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Wgh. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Investmentanteile						654 912,30	96,89
Gruppeneigene Investmentanteile						654 912,30	96,89
DWS Akkumula LC (DE0008474024) (1,450%)	Stück	19	19	4	EUR 1 145,4500	21 763,55	3,22
DWS Convertibles LD (DE0008474263) (0,850%)	Stück	108	94	19	EUR 125,6400	13 569,12	2,01
DWS Emerging Markets Bonds (Short) LC (LU0599900635) (0,600%)	Stück	66	42	55	EUR 103,5700	6 835,62	1,01
DWS European Opportunities TFC (DE000DWS2NN9) (0,800%)	Stück	30	28	8	EUR 324,5400	9 736,20	1,44
DWS Global Hybrid Bond Fund LD (DE0008490988) (0,850%)	Stück	254	186	253	EUR 40,3000	10 236,20	1,51
DWS Global Value LD (LU0133414606) (1,450%)	Stück	54	55	15	EUR 254,0700	13 719,78	2,03
DWS Global Water (DE000DWS0DT1) (1,450%)	Stück	131	147	51	EUR 47,8600	6 269,66	0,93
DWS Health Care Typ O FC (DE000DWS2ED9) (0,850%)	Stück	12	12	3	EUR 262,6700	3 152,04	0,47
DWS Invest Asian Bonds FCH (LU0813324794) (0,600%)	Stück	230	167	47	EUR 134,1400	30 852,20	4,56
DWS Invest Emerging Markets Corporates FCH (LU0507270097) (0,600%)	Stück	72	54	86	EUR 142,3600	10 249,92	1,52
DWS Invest Euro Corporate Bonds FC (LU0300357802) (0,600%)	Stück	278	163	56	EUR 172,1000	47 843,80	7,08
DWS Invest Euro High Yield Corporates FC (LU0616840772) (0,650%)	Stück	111	103	18	EUR 160,0400	17 764,44	2,63
DWS Invest Euro-Gov Bonds FC (LU0145654009) (0,350%)	Stück	302	181	67	EUR 211,5800	63 897,16	9,45
DWS Invest Gold and Precious Metals Equities FC (LU0273148212) (0,750%)	Stück	39	43	13	EUR 84,2800	3 286,92	0,49
DWS Invest II US Top Dividend FC (LU0781239156) (0,750%)	Stück	29	29	7	EUR 216,3100	6 272,99	0,93
DWS Invest Top Dividend FC (LU0507266228) (0,750%)	Stück	28	29	7	EUR 226,4100	6 339,48	0,94
DWS Invest Top Euroland FC (LU0145647722) (0,750%)	Stück	44	49	22	EUR 231,9200	10 204,48	1,51
DWS SDG Global Equities LD (DE0005152466) (1,450%)	Stück	81	82	19	EUR 77,2400	6 256,44	0,93
DWS Smart Industrial Technologies LD (DE0005152482) (1,450%)	Stück	38	35	9	EUR 117,6600	4 471,08	0,66
DWS Top Europe LD (DE0009769729) (1,400%)	Stück	43	42	8	EUR 146,2100	6 287,03	0,93
DWS US Growth (DE0008490897) (1,450%)	Stück	57	55	11	EUR 219,8900	12 533,73	1,85
DWS Vermögensbildungsfonds I LD (DE0008476524) (1,450%)	Stück	168	166	35	EUR 167,0100	28 057,68	4,15
Xtr. II iBoxx Euroz. Gov. Bond Y.Pl. UCITS ETF 1C (LU0524480265) (0,050%)	Stück	75	45	16	EUR 181,8650	13 639,88	2,02
Xtrackers II Global Gov.Bond UCITS ETF 1C-EUR Hed. (LU0378818131) (0,150%)	Stück	189	123	40	EUR 233,9800	44 222,22	6,54
Xtrackers II USD EM Bond UCITS ETF 1C - EUR Hed. (LU0321462953) (0,300%)	Stück	31	37	6	EUR 331,5600	10 278,36	1,52
Xtrackers MSCI AC Asia ex Japan Swap UCITS ETF 1C (LU0322252171) (0,450%)	Stück	574	574	83	EUR 38,8200	22 282,68	3,30
Xtrackers MSCI Canada UCITS ETF 1C (LU0476289540) (0,150%)	Stück	106	107	25	EUR 47,3150	5 015,39	0,74
Xtrackers MSCI Emerging Markets Swap UCITS ETF 1C (LU0292107645) (0,290%)	Stück	400	388	69	EUR 39,7160	15 886,40	2,35
Xtrackers MSCI Europe Small Cap UCITS ETF 1C (LU0322253906) (0,200%)	Stück	371	418	47	EUR 42,7550	15 862,11	2,35
Xtrackers MSCI Japan UCITS ETF 1C (LU0274209740) (0,200%)	Stück	308	264	43	EUR 50,9580	15 695,06	2,32
Xtrackers MSCI Pacific ex Japan UCITS ETF 1C (LU0322252338) (0,300%)	Stück	112	112	24	EUR 56,7700	6 358,24	0,94
Xtrackers MSCI USA Swap UCITS ETF 1C (LU0274210672) (0,200%)	Stück	533	528	103	EUR 70,3400	37 491,22	5,55
Xtrackers MSCI World Cons. Discr. UCITS ETF 1C (IE00BM67HP23) (0,150%)	Stück	146	153	30	EUR 30,1050	4 395,33	0,65
Xtrackers MSCI World Energy UCITS ETF 1C (IE00BM67HM91) (0,150%)	Stück	225	221	42	EUR 28,2800	6 363,00	0,94
Xtrackers MSCI World Financials UCITS ETF 1C (IE00BM67HL84) (0,150%)	Stück	570	562	114	EUR 16,5860	9 454,02	1,40
Xtrackers MSCI World Information Tech. UCITS ETF 1C (IE00BM67HT60) (0,150%)	Stück	115	107	19	EUR 27,3950	3 150,43	0,47
Xtrackers S&P 500 Swap UCITS ETF 1C (LU0490618542) (0,050%)	Stück	795	777	158	EUR 47,1480	37 482,66	5,55
Xtrackers USD Corporate Bond UCITS ETF 1D (IE00BZ036H21) (0,060%)	Stück	2 025	1 193	436	EUR 13,4090	27 153,23	4,02
Xtrackers USD EM Bd.Qual.Weighted UCITS ETF 1D (IE00BD4DX952) (0,400%)	Stück	2 303	1 367	473	EUR 11,7370	27 030,31	4,00

DWS Vorsorge Premium Balance Plus

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Wgh. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
DWS Invest Global High Yield Corporates USD FC (LU1506496097) (0,650%)	Stück	133	114	45	USD 116,0500	13 552,24	2,00
Summe Wertpapiervermögen						654 912,30	96,89
Bankguthaben						21 370,13	3,16
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	20 935,65			% 100	20 935,65	3,10
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							
Japanische Yen	JPY	5 303,00			% 100	43,25	0,01
US Dollar	USD	445,57			% 100	391,23	0,06
Summe der Vermögensgegenstände ¹⁾						676 282,43	100,05
Sonstige Verbindlichkeiten						-356,98	-0,05
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-320,78			% 100	-320,78	-0,05
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-36,20			% 100	-36,20	-0,01
Fondsvermögen						675 925,45	100,00
Anteilwert						133,34	
Umlaufende Anteile						5 069,000	

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 28.06.2019

Japanische Yen	JPY	122,620000	= EUR	1
US Dollar	USD	1,138900	= EUR	1

Erläuterungen zur Bewertung

Die Anteilwerte werden von der Verwaltungsgesellschaft ermittelt sowie die Bewertung der Vermögenswerte des Fondsvermögens durchgeführt. Die grundsätzliche Kursversorgung sowie die Preisvalidierung erfolgen nach den von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der in den gesetzlichen Bestimmungen/Verordnungen bzw. im Prospekt des Fonds definierten Grundsätze für Bewertungsmethoden eingeführten Verfahren.

Sofern keine handelbaren Kurse vorliegen, werden Bewertungsmodelle zur Preisermittlung (abgeleitete Verkehrswerte) genutzt, die zwischen State Street Bank Luxemburg als externem Price Service Provider und Verwaltungsgesellschaft 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.

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

Fußnoten

1) Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.

DWS Vorsorge Premium Balance Plus

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 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
-----------------------	-------------------------------	--------------------------	-----------------------------

Investmentanteile

Gruppeneigene Investmentanteile

Deutsche Institutional Cash Plus IC (LU0193172185) (0,050%)	Stück	1	2
Deutsche Institutional Money plus IC (LU0099730524) (0,100%)	Stück		1
Deutsche Institutional Vario Yield (LU1120400566) (0,100%)	Stück	22	199
Deutsche Institutional Yield (LU0224902659) (0,100%)	Stück	1	2
DWS Euro Reserve LC (LU0011254512) (0,300%)	Stück	74	148
DWS Invest Multi Asset Balance FC (LU1054338832) (0,650%)	Stück	36	123
DWS Rendite Optima (LU0069679222) (0,100%)	Stück	27	179
DWS Rendite Optima Four Seasons (LU0225880524) (0,100%)	Stück	21	194

DWS Vorsorge Premium Plus

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
Investmentanteile						14 913 706,68	95,76	
Gruppeneigene Investmentanteile						14 913 706,68	95,76	
DWS Akkumula LC (DE0008474024) (1,450%)	Stück	563	66	75	EUR	1 145,4500	644 888,35	4,14
DWS European Opportunities TFC (DE000DWS2NN9) (0,800%)	Stück	429	38	212	EUR	324,5400	139 227,66	0,89
DWS Global Value LD (LU0133414606) (1,450%)	Stück	1 433	197	530	EUR	254,0700	364 082,31	2,34
DWS Health Care Typ O FC (DE000DWS2ED9) (0,850%)	Stück	367	48	25	EUR	262,6700	96 399,89	0,62
DWS Invest CROCI Euro IC (LU1769937829) (0,500%)	Stück	809	196	44	EUR	290,6900	235 168,21	1,51
DWS Invest CROCI Global Dividends IC (LU1769943553) (0,650%)	Stück	1 860	338	61	EUR	177,2300	329 647,80	2,12
DWS Invest Emerging Markets Top Dividend FC (LU0329760267) (0,750%)	Stück	1 121	149	142	EUR	127,4700	142 893,87	0,92
DWS Invest Global Emerging Markets Equities FC (LU0210302369) (0,750%)	Stück	1 363	166	189	EUR	274,7800	374 525,14	2,40
DWS Invest II US Top Dividend FC (LU0781239156) (0,750%)	Stück	867	92	60	EUR	216,3100	187 540,77	1,20
DWS Invest Top Dividend FC (LU0507266228) (0,750%)	Stück	625	77	61	EUR	226,4100	141 506,25	0,91
DWS Invest Top Euroland FC (LU0145647722) (0,750%)	Stück	376	52	764	EUR	231,9200	87 201,92	0,56
DWS Qi European Equity FC (DE000DWS1742) (0,750%)	Stück	718	73	68	EUR	135,1000	97 001,80	0,62
DWS Smart Industrial Technologies LD (DE0005152482) (1,450%)	Stück	1 197	99	136	EUR	117,6600	140 839,02	0,90
DWS Top Europe LD (DE0009769729) (1,400%)	Stück	1 356	126	455	EUR	146,2100	198 260,76	1,27
DWS Top World (DE0009769794) (1,450%)	Stück	2 943	353	449	EUR	111,8900	329 292,27	2,11
DWS US Growth (DE0008490897) (1,450%)	Stück	1 760	164	233	EUR	219,8900	387 006,40	2,48
DWS Vermögensbildungsfonds I LD (DE0008476524) (1,450%)	Stück	3 354	387	432	EUR	167,0100	560 151,54	3,60
Xtrackers FTSE 100 UCITS ETF 1C (LU0838780707) (0,010%)	Stück	8 792	955	1 346	EUR	10,4040	91 471,97	0,59
Xtrackers MSCI AC Asia ex Japan Swap UCITS ETF 1C (LU0322252171) (0,450%)	Stück	12 022	1 769	529	EUR	38,8200	466 694,04	3,00
Xtrackers MSCI Canada UCITS ETF 1C (LU0476289540) (0,150%)	Stück	2 958	387	523	EUR	47,3150	139 957,77	0,90
Xtrackers MSCI Emerging Markets Swap UCITS ETF 1C (LU0292107645) (0,290%)	Stück	3 575	1 369	144	EUR	39,7160	141 984,70	0,91
Xtrackers MSCI Emerging Markets UCITS ETF 1C (IE00BJRMP35) ³⁾ (0,100%)	Stück	15 933	16 660	727	EUR	43,1600	687 668,28	4,42
Xtrackers MSCI Europe Small Cap UCITS ETF 1C (LU0322253906) (0,200%)	Stück	5 383	5 745	362	EUR	42,7550	230 150,17	1,48
Xtrackers MSCI Japan UCITS ETF 1C (LU0274209740) (0,200%)	Stück	7 520	1 055	4 826	EUR	50,9580	383 204,16	2,46
Xtrackers MSCI Pacific ex Japan UCITS ETF 1C (LU0322252338) (0,300%)	Stück	4 237	438	571	EUR	56,7700	240 534,49	1,54
Xtrackers MSCI USA Swap UCITS ETF 1C (LU0274210672) (0,200%)	Stück	16 690	1 895	2 147	EUR	70,3400	1 173 974,60	7,54
Xtrackers MSCI World Cons. Discr. UCITS ETF 1C (IE00BM67HP23) (0,150%)	Stück	4 694	558	667	EUR	30,1050	141 312,87	0,91
Xtrackers MSCI World Consumer Staples UCITS ETF 1C (IE00BM67HN09) (0,150%)	Stück	2 951	439	447	EUR	31,3250	92 440,08	0,59
Xtrackers MSCI World Energy UCITS ETF 1C (IE00BM67HM91) (0,150%)	Stück	3 219	424	349	EUR	28,2800	91 033,32	0,58
Xtrackers MSCI World Financials UCITS ETF 1C (IE00BM67HL84) (0,150%)	Stück	16 879	2 057	2 466	EUR	16,5860	279 955,09	1,80
Xtrackers MSCI World Information Tech. UCITS ETF 1C (IE00BM67HT60) (0,150%)	Stück	3 485	294	535	EUR	27,3950	95 471,58	0,61
Xtrackers MSCI World Momentum UCITS ETF 1C (IE00BL25JP72) (0,150%)	Stück	1 501	175	199	EUR	31,7500	47 656,75	0,31
Xtrackers MSCI World Quality UCITS ETF 1C (IE00BL25JL35) (0,150%)	Stück	1 412	149	195	EUR	33,3350	47 069,02	0,30
Xtrackers MSCI World Swap UCITS ETF 1C (LU0274208692) (0,350%)	Stück	40 748	44 689	3 941	EUR	54,6880	2 228 426,62	14,31
Xtrackers MSCI World UCITS ETF 1C (IE00BJOKDQ92) (0,090%)	Stück	49 636	54 448	4 812	EUR	55,4780	2 753 706,01	17,68
Xtrackers MSCI World Value UCITS ETF 1C (IE00BL25JM42) (0,150%)	Stück	1 717	223	154	EUR	27,0600	46 462,02	0,30
Xtrackers S&P 500 Swap UCITS ETF 1C (LU0490618542) (0,050%)	Stück	21 917	2 512	2 843	EUR	47,1480	1 033 342,72	6,63
DWS Invest Global Real Estate Securities USD FC (LU0507268943) (0,750%)	Stück	275	45	51	USD	188,6700	45 556,46	0,29
Summe Wertpapiervermögen						14 913 706,68	95,76	

DWS Vorsorge Premium Plus

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Bankguthaben						674 166,02	4,33
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	664 814,46			% 100	664 814,46	4,27
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							
Japanische Yen	JPY	347 815,00			% 100	2 836,53	0,02
US Dollar	USD	7 419,97			% 100	6 515,03	0,04
Sonstige Vermögensgegenstände							
Sonstige Ansprüche	EUR	64,80			% 100	64,80	0,00
Summe der Vermögensgegenstände 1)						15 587 937,50	100,09
Sonstige Verbindlichkeiten							
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-12 200,22			% 100	-12 200,22	-0,08
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-1 061,23			% 100	-1 061,23	-0,01
Fondsvermögen						15 574 676,05	100,00
Anteilwert						143,00	
Umlaufende Anteile						108 914,000	

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 28.06.2019

Japanische Yen	JPY	122,620000	= EUR	1
US Dollar	USD	1,138900	= EUR	1

Erläuterungen zur Bewertung

Die Anteilwerte werden von der Verwaltungsgesellschaft ermittelt sowie die Bewertung der Vermögenswerte des Fondsvermögens durchgeführt. Die grundsätzliche Kursversorgung sowie die Preisvalidierung erfolgen nach den von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der in den gesetzlichen Bestimmungen/Verordnungen bzw. im Prospekt des Fonds definierten Grundsätze für Bewertungsmethoden eingeführten Verfahren.

Sofern keine handelbaren Kurse vorliegen, werden Bewertungsmodelle zur Preisermittlung (abgeleitete Verkehrswerte) genutzt, die zwischen State Street Bank Luxemburg als externem Price Service Provider und Verwaltungsgesellschaft 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.

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

Fußnoten

- 1) Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.
 3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 43 634,76.

DWS Vorsorge Premium Plus

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 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
Investmentanteile			
Gruppeneigene Investmentanteile			
Deutsche Institutional Cash Plus IC (LU0193172185) (0,050%)	Stück		68
Deutsche Institutional Money plus IC (LU0099730524) (0,100%)	Stück		41
Deutsche Institutional Vario Yield (LU1120400566) (0,100%)	Stück		7 995
Deutsche Institutional Yield (LU0224902659) (0,100%)	Stück		71
DWS Euro Reserve LC (LU0011254512) (0,300%)	Stück		5 919
DWS Rendite Optima (LU0069679222) (0,100%)	Stück		7 389
DWS Rendite Optima Four Seasons (LU0225880524) (0,100%)	Stück		7 810

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

Volumen in 1000

Terminkontrakte

Aktienindex-Terminkontrakte

Verkaufte Kontrakte: EUR 934
(Basiswerte: MSCI World Net Return Index)

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

Volumen in 1000
unbefristet EUR 900

Gattung: Xtrackers MSCI AC Asia ex Japan Swap UCITS
ETF 1C (LU0322252171), Xtrackers MSCI Emerging Markets
UCITS ETF 1C (IE00BTJRM35)

DWS Vorsorge Rentenfonds 1Y

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Wfhg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						171 654 815,00	89,00
Verzinsliche Wertpapiere							
3,8750 % Bank Nederlandse Gemeenten 09/04.11.19 MTN (XS0463097237)	EUR	1 000			101,5150	1 015 150,00	0,53
1,5000 % Berlin Hyp 13/08.08.19 S.176 PF (DE000BHY1422)	EUR	3 500			100,1960	3 506 860,00	1,82
0,0000 % Caisse Francaise Fin. Local 05/15.12.20 MTN ÖPF (FR0010261412)	EUR	1 000			100,2000	1 002 000,00	0,52
0,3750 % Danske Bank 15/08.09.20 MTN PF (XS1287931601)	EUR	5 000			100,9450	5 047 250,00	2,62
0,3750 % DNB Boligkredit 14/07.10.19 MTN PF (XS1117515871)	EUR	3 600			100,2190	3 607 884,00	1,87
0,0000 % DNB Boligkredit 14/17.11.21 MTN PF (XS1137512742)	EUR	1 000			100,7000	1 007 000,00	0,52
0,0000 % DZ HYP 14/08.07.19 R.654 MTN ÖPF (DE000A12TY05)	EUR	1 300			100,0045	1 300 058,50	0,67
4,3750 % EUROFIMA 04/21.10.19 MTN (XS0203879126)	EUR	5 200			101,5560	5 280 912,00	2,74
0,0000 % EUROFIMA 15/15.10.30 MTN (XS1307863081)	EUR	1 000			100,6635	1 006 635,00	0,52
0,5710 % European Investment Bank 05/24.03.20 MTN (XS0212859515)	EUR	1 000			99,9750	999 750,00	0,52
4,3750 % German Postal Pensions 2 06/18.01.22 Cl.C (XS0256171777)	EUR	15 000	15 000		112,2400	16 836 000,00	8,73
0,0000 % Germany 09/04.01.20 PO Strip (DE0001108579)	EUR	8 500			100,4415	8 537 527,50	4,43
0,0000 % Germany 09/04.07.19 PO Strip (DE0001108561)	EUR	10 000			100,0835	10 008 350,00	5,19
0,0000 % Germany 10/04.07.20 PO Strip (DE0001108587)	EUR	3 500			100,6930	3 524 255,00	1,83
0,0000 % Germany 11/04.07.21 PO Strip (DE0001108629)	EUR	4 000	4 000		101,5080	4 060 320,00	2,11
0,0000 % Germany 13/15.08.19 IO Strip (DE0001143535)	EUR	6 800			100,0785	6 805 338,00	3,53
0,0000 % Germany 13/15.08.20 IO Strip (DE0001143543)	EUR	8 000			100,6695	8 053 560,00	4,18
0,0000 % Germany 97/04.01.20 Coupons (DE0001142537)	EUR	4 000			100,3430	4 013 720,00	2,08
0,0000 % Germany 97/04.01.21 Coupons (DE0001142545)	EUR	6 000			100,9145	6 054 870,00	3,14
0,0000 % Germany 97/04.07.19 Coupons (DE0001143220)	EUR	4 000			99,9330	3 997 320,00	2,07
0,0000 % Germany 97/04.07.20 Coupons (DE0001143238)	EUR	4 000			100,4515	4 018 060,00	2,08
0,0000 % Germany 97/04.07.21 Coupons (DE0001143246)	EUR	3 000	3 000		101,0320	3 030 960,00	1,57
0,0000 % Hamburg 15/28.07.25 A.4 LSA (DE000A1YCOF7)	EUR	3 000			102,3720	3 071 160,00	1,59
0,0000 % Landwirts. Rentenbank 15/13.04.21 S.1068 MTN (XS0875263724)	EUR	2 000			100,4885	2 009 770,00	1,04
0,3750 % LB Hessen-Thüringen 16/10.03.20 S.H291 IHS MTN (XS1377695652)	EUR	7 000			100,3850	7 026 950,00	3,64
0,6250 % Llyods Bank 15/20.04.20 MTN (XS1219428957)	EUR	6 000			100,7450	6 044 700,00	3,13
0,0000 % Münchener Hypothekenbk. 14/11.07.19 S.1653 MTN PF (DE000MHB2267)	EUR	3 700			100,0100	3 700 370,00	1,92
3,8750 % National Westminster Bank 10/19.10.20 MTN PF (XS0551478844)	EUR	4 000			105,5600	4 222 400,00	2,19
0,1250 % Nationwide Building Society 16/25.01.21 MTN PF (XS1374414891)	EUR	5 000	5 000		100,8360	5 041 800,00	2,61
2,0000 % Nordea Bank 14/17.02.21 MTN (XS1032997568)	EUR	7 000	7 000		103,7020	7 259 140,00	3,76
0,1890 % Nykredit Realkredit 17/01.10.22 PF (DK0009515603)	EUR	2 000			101,2040	2 024 080,00	1,05
2,0000 % OP Yrityspankki 14/03.03.21 MTN (XS1040272533)	EUR	8 000	8 000		103,7930	8 303 440,00	4,31
3,3750 % SpareBank 1 Boligkredit 11/07.09.21 MTN PF (XS0674396782)	EUR	5 000			108,3450	5 417 250,00	2,81
0,6250 % Stadshypotek 14/10.11.21 MTN PF (XS1135318431)	EUR	5 000			102,5150	5 125 750,00	2,66
2,2500 % Svenska Handelsbanken 13/27.08.20 MTN (XS0965050197)	EUR	5 000			102,9440	5 147 200,00	2,67
0,3750 % Swedish Covered Bond 15/05.10.20 MTN PF (XS1300812077)	EUR	4 500			101,0450	4 547 025,00	2,36
Summe Wertpapiervermögen						171 654 815,00	89,00

DWS Vorsorge Rentenfonds 1Y

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						680,00	0,00
Zinsterminkontrakte							
EURO-SCHATZ SEP 19 (EURX)	EUR	400				680,00	0,00
Bankguthaben						20 236 937,90	10,49
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	20 236 937,90		%	100	20 236 937,90	10,49
Sonstige Vermögensgegenstände						1 040 636,93	0,54
Zinsansprüche	EUR	1 038 669,32		%	100	1 038 669,32	0,54
Sonstige Ansprüche	EUR	1 967,61		%	100	1 967,61	0,00
Summe der Vermögensgegenstände ¹⁾						192 933 069,83	100,04
Sonstige Verbindlichkeiten						-68 130,26	-0,03
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-44 164,82		%	100	-44 164,82	-0,02
Verbindlichkeiten aus Steuern	EUR	-23 316,13		%	100	-23 316,13	-0,01
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-649,31		%	100	-649,31	0,00
Fondsvermögen						192 864 939,57	100,00
Anteilwert						97,31	
Umlaufende Anteile						1 982 025,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

Erläuterungen zur Bewertung

Die Anteilwerte werden von der Verwaltungsgesellschaft ermittelt sowie die Bewertung der Vermögenswerte des Fondsvermögens durchgeführt. Die grundsätzliche Kursversorgung sowie die Preisvalidierung erfolgen nach den von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der in den gesetzlichen Bestimmungen/Verordnungen bzw. im Prospekt des Fonds definierten Grundsätze für Bewertungsmethoden eingeführten Verfahren.

Sofern keine handelbaren Kurse vorliegen, werden Bewertungsmodelle zur Preisermittlung (abgeleitete Verkehrswerte) genutzt, die zwischen State Street Bank Luxemburg als externem Price Service Provider und Verwaltungsgesellschaft 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.

Fußnoten

1) Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.

DWS Vorsorge Rentenfonds 1Y

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 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere			
Verzinsliche Wertpapiere			
0,2840 % Dexia Credit Local 17/07.03.19 MTN (XS1575798860)	EUR		3 000
0,0000 % Germany 08/04.01.19 PO Strip (DE0001108553)	EUR		3 800
0,0000 % Germany 97/04.01.19 Coupons (DE0001142529)	EUR		1 500
0,3750 % LB Baden-Württemberg 16/29.01.19 S.757 IHS MTN (XS1353555003)	EUR		3 500
0,7500 % Nationwide Building Society 14/25.06.19 MTN PF (XS1081041557) . .	EUR		2 500
0,0000 % Niedersachsen 14/09.01.19 A.579 LSA (DE000A1YC665)	EUR		400
0,0000 % Nordea Kredit Realkreditakt. 14/01.01.19 PF (LU1110205314)	EUR		941
2,0000 % Skandin. Enskilda Banken 13/18.03.19 MTN (XS0972089568)	EUR		4 500

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

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: EURO-SCHATZ JUN 19)	EUR	447
---	-----	-----

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

	Volumen in 1000	
unbefristet	EUR	13 584
Gattung: 0,0000 % Germany 09/04.07.19 PO Strip (DE0001108561), 2,0000 % Nordea Bank 14/17.02.21 MTN (XS1032997568), 0,3750 % Swedish Covered Bond 15/05.10.20 MTN PF (XS1300812077)		

DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						382 108 622,20	95,69
Verzinsliche Wertpapiere							
4,7500 % Bank of Scotland 07/08.06.22 MTN PF (XS0304459026)	EUR	9 500			% 114,8550	10 911 225,00	2,73
1,5000 % Berlin Hyp 13/08.08.19 S.176 PF (DE000BHY1422)	EUR	5 500			% 100,1960	5 510 780,00	1,38
0,0000 % Caisse Francaise Fin. Local 05/15.12.20 MTN ÖPF (FR0010261412)	EUR	3 500			% 100,2000	3 507 000,00	0,88
0,2500 % Danske Bank 15/04.06.20 MTN PF (XS1197037515)	EUR	6 800			% 100,6160	6 841 888,00	1,71
0,0000 % DNB Boligkredit 14/17.11.21 MTN PF (XS1137512742)	EUR	4 000			% 100,7000	4 028 000,00	1,01
0,2500 % DNB Boligkredit 18/23.01.23 MTN PF (XS1756428469)	EUR	8 000			% 102,0650	8 165 200,00	2,04
0,0000 % DZ HYP 14/08.07.19 R.654 MTN ÖPF (DE000A12TY05)	EUR	2 700			% 100,0045	2 700 121,50	0,68
3,1250 % EUROFIMA 10/15.11.22 MTN (XS0557553533)	EUR	10 620			% 112,0960	11 904 595,20	2,98
0,5710 % European Investment Bank 05/24.03.20 MTN (XS0212859515)	EUR	3 000			% 99,9750	2 999 250,00	0,75
1,5000 % European Investment Bank 14/15.04.21 MTN (XS1044744032) ³⁾	EUR	6 000			% 103,8330	6 229 980,00	1,56
4,3750 % German Postal Pensions 2 06/18.01.22 Cl.C (XS0256171777)	EUR	4 000			% 112,2400	4 489 600,00	1,12
0,0000 % Germany 09/04.01.20 PO Strip (DE0001108579) ³⁾	EUR	6 300			% 100,4415	6 327 814,50	1,58
0,0000 % Germany 09/04.07.19 PO Strip (DE0001108561)	EUR	6 200			% 100,0835	6 205 177,00	1,55
0,0000 % Germany 10/04.01.21 PO Strip (DE0001108611) ³⁾	EUR	11 000			% 101,3575	11 149 325,00	2,79
0,0000 % Germany 10/04.07.20 PO Strip (DE0001108587) ³⁾	EUR	11 000			% 100,6930	11 076 230,00	2,77
0,0000 % Germany 11/04.01.22 PO Strip (DE0001108645) ³⁾	EUR	10 000			% 101,9235	10 192 350,00	2,55
0,0000 % Germany 11/04.07.21 PO Strip (DE0001108629) ³⁾	EUR	13 000			% 101,5080	13 196 040,00	3,30
0,0000 % Germany 12/04.07.22 PO Strip (DE0001108652) ³⁾	EUR	14 500			% 102,3115	14 835 167,50	3,72
0,0000 % Germany 13/15.08.20 IO Strip (DE0001143543)	EUR	7 900			% 100,6695	7 952 890,50	1,99
0,0000 % Germany 13/15.08.21 IO Strip (DE0001143550)	EUR	10 000			% 101,3205	10 132 050,00	2,54
0,0000 % Germany 13/15.08.22 IO Strip (DE0001143568)	EUR	10 000			% 102,0935	10 209 350,00	2,56
0,0000 % Germany 13/15.08.23 S.AU23 (DE0001108702)	EUR	10 000			% 103,4025	10 340 250,00	2,59
0,0000 % Germany 94/04.01.24 (DE0001142008) ³⁾	EUR	10 000	2 500		% 103,3460	10 334 600,00	2,59
0,0000 % Germany 97/04.01.20 Coupons (DE0001142537)	EUR	2 700			% 100,3430	2 709 261,00	0,68
0,0000 % Germany 97/04.01.23 Coupons (DE0001142560) ³⁾	EUR	10 000			% 102,4445	10 244 450,00	2,57
0,0000 % Germany 97/04.07.19 Coupons (DE0001143220)	EUR	2 000			% 99,9330	1 998 660,00	0,50
0,0000 % Germany 97/04.07.20 Coupons (DE0001143238)	EUR	6 400			% 100,4515	6 428 896,00	1,61
0,0000 % Germany 97/04.07.23 Coupons (DE0001143261) ³⁾	EUR	10 000			% 102,1510	10 215 100,00	2,56
0,0000 % Germany 97/04.07.24 Coupons (DE0001143279) ³⁾	EUR	10 000	10 000		% 102,5895	10 258 950,00	2,57
0,1250 % Hessen 15/14.10.19 S.1516 LSA (DE000A1RQCC8)	EUR	3 600			% 100,1640	3 605 904,00	0,90
0,0000 % Invest.bk. Schleswig Holstein 14/20.11.19 S.1 IHS (DE000A13SL42)	EUR	2 900			% 100,1470	2 904 263,00	0,73
0,1250 % KfW 18/24.02.23 (DE000A2GSNV2) ³⁾	EUR	17 000			% 102,3450	17 398 650,00	4,36
0,5000 % Lloyds Bank 15/22.07.20 MTN PF (XS1263854801)	EUR	5 000			% 100,9490	5 047 450,00	1,26
0,5000 % Lloyds Bank 16/11.04.23 MTN PF (XS1391589626)	EUR	5 000			% 102,7190	5 135 950,00	1,29
0,0000 % Münchener Hypothekenbk. 14/11.07.19 S.1653 MTN PF (DE000MHB2267)	EUR	800			% 100,0100	800 080,00	0,20
3,8750 % National Westminster Bank 10/19.10.20 MTN PF (XS0551478844)	EUR	8 300			% 105,5600	8 761 480,00	2,19
0,5000 % National Westminster Bank 17/15.05.24 MTN PF (XS1612958253)	EUR	16 000	16 000		% 102,9470	16 471 520,00	4,12
0,1250 % Nationwide Building Society 16/25.01.21 MTN PF (XS1374414891)	EUR	9 000			% 100,8360	9 075 240,00	2,27

DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
0,0500 % Nationwide Building Society 19/03.06.24 MTN (XS2004366287)	EUR	5 000	5 000		% 100,8250	5 041 250,00	1,26
0,3750 % Niedersachsen 16/19.01.23 A.860 LSA (DE000A2AAKB1)	EUR	7 000			% 102,9080	7 203 560,00	1,80
0,3750 % NRW.BANK 16/25.01.23 IHS A.17F (DE000NWB17F3)	EUR	8 000			% 102,8390	8 227 120,00	2,06
0,6250 % OP-Asuntoluottopankki 15/04.09.22 MTN PF (XS1285892870) ³⁾	EUR	12 000			% 103,3350	12 400 200,00	3,11
4,1250 % Skandin. Enskilda Banken 11/07.04.21 MTN PF (XS0614401197)	EUR	5 400			% 108,1010	5 837 454,00	1,46
0,7500 % SpareBank 1 Boligkreditt 15/05.09.22 MTN PF (XS1285867419)	EUR	12 000			% 103,5400	12 424 800,00	3,11
0,6250 % Stadshypotek 14/10.11.21 MTN PF (XS1135318431)	EUR	11 000			% 102,5150	11 276 650,00	2,82
0,4000 % Swedbank Hypotek 17/08.05.24 MTN PF (XS1606633912)	EUR	10 000	10 000		% 103,0880	10 308 800,00	2,58
0,3750 % Swedish Covered Bond 15/05.10.20 MTN PF (XS1300812077)	EUR	9 000			% 101,0450	9 094 050,00	2,28
Summe Wertpapiervermögen						382 108 622,20	95,69
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Zins-Derivate							
(Forderungen / Verbindlichkeiten)							
						115 780,00	0,03
Zinsterminkontrakte							
EURO-BOBL SEP 19 (EURX)	EUR	28 600				115 780,00	0,03
Bankguthaben							
						16 246 712,06	4,07
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	16 246 712,06			% 100	16 246 712,06	4,07
Sonstige Vermögensgegenstände							
Zinsansprüche	EUR	974 844,88			% 100	974 844,88	0,24
Sonstige Ansprüche	EUR	28 567,08			% 100	28 567,08	0,01
Summe der Vermögensgegenstände ¹⁾							
						399 474 526,22	100,04
Sonstige Verbindlichkeiten							
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-106 618,81			% 100	-106 618,81	-0,03
Verbindlichkeiten aus Steuern	EUR	-48 227,47			% 100	-48 227,47	-0,01
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-9 427,14			% 100	-9 427,14	0,00
Fondsvermögen							
						399 310 252,80	100,00
Anteilwert						114,53	
Umlaufende Anteile						3 486 607,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y

Erläuterungen zur Bewertung

Die Anteilwerte werden von der Verwaltungsgesellschaft ermittelt sowie die Bewertung der Vermögenswerte des Fondsvermögens durchgeführt. Die grundsätzliche Kursversorgung sowie die Preisvalidierung erfolgen nach den von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der in den gesetzlichen Bestimmungen/Verordnungen bzw. im Prospekt des Fonds definierten Grundsätze für Bewertungsmethoden eingeführten Verfahren.

Sofern keine handelbaren Kurse vorliegen, werden Bewertungsmodelle zur Preisermittlung (abgeleitete Verkehrswerte) genutzt, die zwischen State Street Bank Luxemburg als externem Price Service Provider und Verwaltungsgesellschaft 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.

Fußnoten

- 1) Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.
 3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 97 982 336,50.

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. VWhg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere			
Verzinsliche Wertpapiere			
0,0000 % Germany 08/04.01.19 PO Strip (DE0001108553)	EUR		2 600
0,0000 % Germany 97/04.01.19 Coupons (DE0001142529)	EUR		3 300
0,0000 % Niedersachsen 14/09.01.19 A.579 LSA (DE000A1YC665)	EUR		1 000

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

Volumen in 1000

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: EUR 50 997
 (Basiswerte: EURO-BOBL JUN 19, EURO-BOBL MAR 19)

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

Volumen in 1000
 unbefristet EUR 48 997

Gattung: 4,7500 % Bank of Scotland 07/08.06.22 MTN PF (XS0304459026), 3,1250 % EUROFIMA 10/15.11.22 MTN (XS0557553533), 1,5000 % European Investment Bank 14/15.04.21 MTN (XS1044744032), 0,0000 % Germany 12/04.07.22 PO Strip (DE0001108652), 0,0000 % Germany 94/04.01.24 (DE0001142008), 0,0000 % Germany 97/04.01.20 Coupons (DE0001142537), 0,0000 % Germany 97/04.07.20 Coupons (DE0001143238), 0,1250 % Hessen 15/14.10.19 S.1516 LSA (DE000A1RQCQ8), 0,6250 % OP-Asuntoluottopankki 15/04.09.22 MTN PF (XS1285892870)

DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Wgh. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						520 902 380,26	95,91
Verzinsliche Wertpapiere							
4,7500	% Bank of Scotland 07/08.06.22 MTN PF (XS0304459026) ³⁾	EUR	12 000		% 114,8550	13 782 600,00	2,54
0,0000	% Caisse Francaise Fin. Local 05/15.12.20 MTN ÖPF (FR0010261412)	EUR	5 000		% 100,2000	5 010 000,00	0,92
0,3750	% DNB Boligkredit 17/20.11.24 MTN PF (XS1719108463) ³⁾	EUR	10 301		% 102,9760	10 607 557,76	1,95
0,0000	% DZ HYP 14/08.07.19 R.654 MTN ÖPF (DE000A12TY05)	EUR	6 500		% 100,0045	6 500 292,50	1,20
3,1250	% EUROFIMA 10/15.11.22 MTN (XS0557553533)	EUR	7 000		% 112,0960	7 846 720,00	1,44
0,5710	% European Investment Bank 05/24.03.20 MTN (XS0212859515)	EUR	5 500		% 99,9750	5 498 625,00	1,01
0,1250	% European Investment Bank 15/15.04.25 MTN (XS1207449684) ³⁾	EUR	10 000		% 102,8680	10 286 800,00	1,89
1,0000	% European Stability Mechanism 15/23.09.25 MTN (EU000A1U9894) ³⁾	EUR	9 000		% 108,0490	9 724 410,00	1,79
0,5000	% European Stability Mechanism 16/02.03.26 MTN (EU000A1U9944) ³⁾	EUR	25 000	25 000	% 105,0480	26 262 000,00	4,84
0,0000	% Germany 11/04.01.22 PO Strip (DE0001108645) ³⁾	EUR	10 000		% 101,9235	10 192 350,00	1,88
0,0000	% Germany 12/04.07.22 PO Strip (DE0001108652) ³⁾	EUR	20 500		% 102,3115	20 973 857,50	3,86
0,0000	% Germany 13/15.08.22 IO Strip (DE0001143568)	EUR	6 500		% 102,0935	6 636 077,50	1,22
0,0000	% Germany 13/15.08.23 IO Strip (DE0001143576)	EUR	10 000		% 102,5185	10 251 850,00	1,89
0,0000	% Germany 14/15.08.24 S.AU46 (DE0001143584)	EUR	15 000		% 102,6995	15 404 925,00	2,84
0,0000	% Germany 14/15.08.25 IO Strip S.AU46 (DE0001143592)	EUR	11 000		% 102,7370	11 301 070,00	2,08
0,0000	% Germany 14/15.08.26 S.AU46 (DE0003811444) ³⁾	EUR	8 400	8 400	% 102,7930	8 634 612,00	1,59
0,0000	% Germany 94/04.01.24 (DE0001142008) ³⁾	EUR	35 000		% 103,3460	36 171 100,00	6,66
0,0000	% Germany 97/04.01.22 Coupons (DE0001142552) ³⁾	EUR	14 600		% 101,5460	14 825 716,00	2,73
0,0000	% Germany 97/04.01.23 Coupons (DE0001142560) ³⁾	EUR	11 000		% 102,4445	11 268 895,00	2,07
0,0000	% Germany 97/04.07.22 Coupons (DE0001143253) ³⁾	EUR	3 800	7 700	% 101,8455	3 870 129,00	0,71
0,0000	% Germany 97/04.07.23 Coupons (DE0001143261) ³⁾	EUR	10 000		% 102,1510	10 215 100,00	1,88
0,0000	% Germany 97/04.07.24 Coupons (DE0001143279) ³⁾	EUR	17 000		% 102,5895	17 440 215,00	3,21
0,0000	% Germany 97/04.07.25 Coupons (DE0001143287) ³⁾	EUR	16 000		% 102,8770	16 460 320,00	3,03
0,0000	% Germany 97/04.07.26 Coupons (DE0001143295)	EUR	15 000	15 000	% 102,8545	15 428 175,00	2,84
0,0000	% Germany 98/04.01.25 Coupons (DE0001142586) ³⁾	EUR	16 000		% 102,9610	16 473 760,00	3,03
0,0000	% Germany 98/04.01.26 Coupons (DE0001142594)	EUR	12 100		% 102,9570	12 457 797,00	2,29
0,2500	% Hessen 15/10.06.25 S.1512 LSA (DE000A1RQCPO) ³⁾	EUR	15 000		% 103,0130	15 451 950,00	2,85
0,3750	% L-Bank B-V-Förderbank 16/13.04.23 S.5559 MTN (DE000A13R9M1) ³⁾	EUR	20 000	20 000	% 103,9730	20 794 600,00	3,83
0,0500	% Niedersachsen 17/20.09.23 A.874 LSA (DE000A2GSD76) ³⁾	EUR	10 500		% 101,8920	10 698 660,00	1,97
0,5000	% Niedersachsen 18/13.06.25 A.881 LSA (DE000A2LQ5H4) ³⁾	EUR	10 000		% 104,4760	10 447 600,00	1,92
0,2500	% NRW.BANK 17/04.07.25 S.A.Cl.18E IHS (DE000NWB18E4) ³⁾	EUR	15 000		% 102,9300	15 439 500,00	2,84
0,2500	% NRW.BANK 17/16.05.24 MTN IHS A.061 (DE000NWB0618) ³⁾	EUR	12 000		% 102,8210	12 338 520,00	2,27
0,6250	% OP-Asuntoluottopankki 15/04.09.22 MTN PF (XS1285892870) ³⁾	EUR	10 000		% 103,3350	10 333 500,00	1,90
0,2500	% OP-Asuntoluottopankki 16/11.05.23 MTN PF (XS1408380803) ³⁾	EUR	5 000		% 102,4330	5 121 650,00	0,94
0,2500	% Skandin. Enskilda Banken 17/20.06.24 MTN PF (XS1633824823) ³⁾	EUR	8 000		% 102,3700	8 189 600,00	1,51
0,5000	% SpareBank 1 Boligkredit 18/30.01.25 MTN PF (XS1760129608)	EUR	22 000		% 103,7480	22 824 560,00	4,20
0,3750	% Stadshypotek 19/13.03.26 MTN PF (XS1962535644)	EUR	20 000	20 000	% 102,9360	20 587 200,00	3,79

DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
0,3750 % Swedbank Hypotek 15/11.03.22 MTN PF (XS1200837836) ³⁾	EUR	11 100			% 102,0660	11 329 326,00	2,09
0,4000 % Swedbank Hypotek 17/08.05.24 MTN PF (XS1606633912) ³⁾	EUR	5 000			% 103,0880	5 154 400,00	0,95
0,5000 % Swedish Covered Bond 18/29.01.25 MTN PF (XS1759602953)	EUR	18 000			% 103,7020	18 666 360,00	3,44
Summe Wertpapiervermögen						520 902 380,26	95,91
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Zins-Derivate							
(Forderungen / Verbindlichkeiten)							
						67 240,00	0,01
Zinsterminkontrakte							
EURO-BOBL SEP 19 (EURX)	EUR	26 300				67 240,00	0,01
Bankguthaben							
						21 783 766,90	4,01
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	21 783 766,90		% 100		21 783 766,90	4,01
Sonstige Vermögensgegenstände							
Zinsansprüche	EUR	547 900,03		% 100		547 900,03	0,10
Sonstige Ansprüche	EUR	50 728,80		% 100		50 728,80	0,01
Summe der Vermögensgegenstände ¹⁾							
						543 352 015,99	100,05
Sonstige Verbindlichkeiten							
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-165 628,75		% 100		-165 628,75	-0,03
Verbindlichkeiten aus Steuern	EUR	-65 569,20		% 100		-65 569,20	-0,01
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-16 740,50		% 100		-16 740,50	0,00
Fondsvermögen							
						543 104 077,54	100,00
Anteilwert						152,08	
Umlaufende Anteile						3 571 187,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

Erläuterungen zur Bewertung

Die Anteilwerte werden von der Verwaltungsgesellschaft ermittelt sowie die Bewertung der Vermögenswerte des Fondsvermögens durchgeführt. Die grundsätzliche Kursversorgung sowie die Preisvalidierung erfolgen nach den von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der in den gesetzlichen Bestimmungen/Verordnungen bzw. im Prospekt des Fonds definierten Grundsätze für Bewertungsmethoden eingeführten Verfahren.

Sofern keine handelbaren Kurse vorliegen, werden Bewertungsmodelle zur Preisermittlung (abgeleitete Verkehrswerte) genutzt, die zwischen State Street Bank Luxemburg als externem Price Service Provider und Verwaltungsgesellschaft 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 nicht zu abgeleiteten Verkehrswerten bewertet.

Fußnoten

1) Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.

3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 302 615 350,26.

DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y

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 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere			
Verzinsliche Wertpapiere			
0,0000 % Bremen 14/20.02.19 A.190 LSA (DE000A1K0V92)	EUR		1 000
4,3750 % German Postal Pensions 2 06/18.01.22 Cl.C (XS0256171777)	EUR		15 000
0,0000 % Niedersachsen 14/09.01.19 A.579 LSA (DE000A1YC665)	EUR		1 700
0,6250 % Stadshypotek 14/10.11.21 MTN PF (XS1135318431)	EUR		15 000

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

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: EURO-BOBL JUN 19, EURO-BOBL MAR 19)	EUR	70 006
---	-----	--------

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

unbefristet	EUR	52 632
-------------	-----	--------

Volumen in 1000

Gattung: 4,7500 % Bank of Scotland 07/08.06.22 MTN
PF (XS0304459026), 0,1250 % European Investment Bank
15/15.04.25 MTN (XS1207449684), 1,0000 % European
Stability Mechanism 15/23.09.25 MTN (EU000A1U9894),
German Postal Pensions 2 06/18.01.22 Cl.C
(XS0256171777), 0,0000 % Germany 12/04.07.22 PO Strip
(DE0001108652), 0,0000 % Germany 94/04.01.24
(DE0001142008), 0,0000 % Germany 97/04.07.22 Coupons
(DE0001143253), 0,0000 % Germany 97/04.07.23 Coupons
(DE0001143261), 0,0500 % Niedersachsen 17/20.09.23 A.874
LSA (DE000A2GSD76), 0,5000 % Niedersachsen
18/13.06.25 A.881 LSA (DE000A2LQ5H4), 0,2500 %
NRW.BANK 17/04.07.25 S.A.Cl.18E IHS (DE000NWB18E4),
0,6250 % OP-Asuntoluottopankki 15/04.09.22 MTN PF
(XS1285892870), 0,6250 % Stadshypotek 14/10.11.21
MTN PF (XS1135318431)

DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						884 760 279,21	96,49
Verzinsliche Wertpapiere							
1,3100 % ART Six/HSHN 15/15.07.26 MTN (XS1327533003)	EUR	26 000			% 106,6935	27 740 312,60	3,03
0,7500 % Bayerische Landesbodenkredit.18/27.06.28 IHS (DE000A161RE6)	EUR	13 300	13 300		% 106,5065	14 165 364,50	1,54
6,2500 % Berlin 97/28.02.28 A.87 LSA (DE0001062321)	EUR	5 000			% 154,3425	7 717 125,00	0,84
0,2500 % Brandenburg 16/19.10.26 LSA (DE000A11QE86) ³⁾	EUR	16 500			% 102,7850	16 959 525,00	1,85
0,5000 % Bremen 15/03.03.25 A.198 LSA (DE000A11QJ16) ³⁾	EUR	10 000			% 104,3210	10 432 100,00	1,14
0,0000 % Caisse Francaise Fin. Local 05/15.12.20 MTN ÖPF (FR0010261412)	EUR	2 500			% 100,2000	2 505 000,00	0,27
0,0000 % DNB Boligkredit 14/17.11.21 MTN PF (XS1137512742)	EUR	6 500			% 100,7000	6 545 500,00	0,71
0,3750 % DNB Boligkredit 17/20.11.24 MTN PF (XS1719108463)	EUR	8 002			% 102,9760	8 240 139,52	0,90
0,0000 % DZ HYP 14/08.07.19 R.654 MTN ÖPF (DE000A12TY05)	EUR	4 500			% 100,0045	4 500 202,50	0,49
0,0000 % European Investment Bank 96/05.11.26 (DE0001345908) ³⁾	EUR	22 500			% 100,0750	22 516 875,00	2,46
0,5000 % European Stability Mechanism 16/02.03.26 MTN (EU000A1U9944) ³⁾	EUR	27 000			% 105,0480	28 362 960,00	3,09
0,0000 % Germany 14/15.08.24 S.AU46 (DE0001143584)	EUR	8 000			% 102,6995	8 215 960,00	0,90
0,0000 % Germany 14/15.08.25 IO Strip S.AU46 (DE0001143592) ³⁾	EUR	15 000			% 102,7370	15 410 550,00	1,68
0,0000 % Germany 14/15.08.26 S.AU46 (DE0003811444) ³⁾	EUR	19 000			% 102,7930	19 530 670,00	2,13
0,0000 % Germany 14/15.08.27 IO Strip AU46 (DE0003811451) ³⁾	EUR	11 200			% 103,2520	11 564 224,00	1,26
0,0000 % Germany 94/04.01.24 (DE0001142008) ³⁾	EUR	68 000			% 103,3460	70 275 280,00	7,66
0,0000 % Germany 97/04.01.24 Coupons (DE0001142578) ³⁾	EUR	26 500			% 102,8790	27 262 935,00	2,97
0,0000 % Germany 97/04.07.24 Coupons (DE0001143279) ³⁾	EUR	27 300			% 102,5895	28 006 933,50	3,05
0,0000 % Germany 97/04.07.25 Coupons (DE0001143287) ³⁾	EUR	22 000			% 102,8770	22 632 940,00	2,47
0,0000 % Germany 97/04.07.26 Coupons (DE0001143295) ³⁾	EUR	24 000			% 102,8545	24 685 080,00	2,69
0,0000 % Germany 97/04.07.27 Coupons (DE0001142032)	EUR	22 000			% 103,9280	22 864 160,00	2,49
0,0000 % Germany 97/04.07.27 Coupons (DE0001143303) ³⁾	EUR	10 000			% 102,4775	10 247 750,00	1,12
0,0000 % Germany 98/04.01.25 Coupons (DE0001142586) ³⁾	EUR	23 600			% 102,9610	24 298 796,00	2,65
0,0000 % Germany 98/04.01.26 Coupons (DE0001142594) ³⁾	EUR	23 000			% 102,9570	23 680 110,00	2,58
0,0000 % Germany 98/04.01.27 Coupons (DE0001142602) ³⁾	EUR	22 000			% 102,7025	22 594 550,00	2,46
0,0000 % Germany 98/04.01.28 (DE0001142057) ³⁾	EUR	27 000			% 103,6660	27 989 820,00	3,05
0,0000 % Germany 98/04.07.28 PO Strip (DE0001142073)	EUR	40 000	40 000		% 103,8750	41 550 000,00	4,53
0,3750 % Hessen 16/06.07.26 S.1605 LSA (DE000A1RQCY2) ³⁾	EUR	31 000			% 103,7270	32 155 370,00	3,51
0,0000 % Invest.bk. Schleswig Holstein 14/20.11.19 S.1 IHS (DE000A13SL42)	EUR	3 500			% 100,1470	3 505 145,00	0,38
0,7500 % Investitionsbank Schleswig Holstei 17/03.11.27 IHS (DE000A13SL83)	EUR	20 000			% 106,1435	21 228 700,00	2,32
0,5000 % KfW 17/15.09.27 (DE000A2GSFA2) ³⁾	EUR	25 000			% 105,3210	26 330 250,00	2,87
0,6250 % Landwirts. Rentenbank 17/18.05.27 MTN (XS1615677280) ³⁾	EUR	20 000			% 105,9810	21 196 200,00	2,31
0,3750 % Landwirtschaftliche Rentenbk 19/14.02.28 MTN (XS1951092144)	EUR	15 000	15 000		% 103,8210	15 573 150,00	1,70
0,0000 % LB Baden-Württemberg 00/01.12.25 S.201 IHS MTN (XS0121024292)	EUR	3 400			% 99,5083	3 383 281,59	0,37
0,3750 % L-Bank B-W-Förderbank 16/13.04.23 S.5559 MTN (DE000A13R9M1) ³⁾	EUR	22 000			% 103,9730	22 874 060,00	2,49
1,0000 % LfA Förderbank Bayern 17/03.04.29 IHS (DE000LFA1701)	EUR	30 000	30 000		% 108,4600	32 538 000,00	3,55
0,5000 % Niedersachsen 16/08.06.26 A.863 LSA (DE000A2AAWN1) ³⁾	EUR	18 500			% 104,5750	19 346 375,00	2,11
0,7500 % Nordrhein-Westfalen 16/16.01.26 R.1402 MTN LSA (DE000NRW0H99) ³⁾	EUR	10 000			% 106,1720	10 617 200,00	1,16

DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
0,5000 % Nordrhein-Westfalen 17/16.02.27 R.1435 MTN LSA (DE000NRW0KB3) ³⁾	EUR	15 000			% 104,6060	15 690 900,00	1,71
0,5000 % Rheinland-Pfalz 15/21.01.25 LSA (DE000RLP0645) ³⁾	EUR	20 000			% 104,4040	20 880 800,00	2,28
0,7500 % Sachsen-Anhalt 19/29.01.29 S.10Y LSA (DE000A2TR208)	EUR	17 500	17 500		% 106,4990	18 637 325,00	2,03
0,2500 % Skandin. Enskilda Banken 17/20.06.24 MTN PF (XS1633824823) ³⁾	EUR	10 000			% 102,3700	10 237 000,00	1,12
0,3750 % SpareBank 1 Boligkredit 17/26.06.24 MTN PF (XS1637099026)	EUR	10 000			% 102,9870	10 298 700,00	1,12
0,5000 % SpareBank 1 Boligkredit 18/30.01.25 MTN PF (XS1760129608)	EUR	18 000			% 103,7480	18 674 640,00	2,04
0,3750 % Stadshypotek 17/06.12.24 MTN PF (XS1731734585) ³⁾	EUR	10 000			% 103,0540	10 305 400,00	1,12
0,4000 % Swedbank Hypotek 17/08.05.24 MTN PF (XS1606633912) ³⁾	EUR	8 000			% 103,0880	8 247 040,00	0,90
0,5000 % Thüringen 17/02.03.27 LSA (DE000A2E4X14) ³⁾	EUR	12 000			% 104,5490	12 545 880,00	1,37
Summe Wertpapiervermögen						884 760 279,21	96,49
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						533 440,00	0,06
Zinsterminkontrakte							
EURO-BUND SEP 19 (EURX)	EUR	35 900				533 440,00	0,06
Bankguthaben						30 793 610,42	3,36
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben.	EUR	30 793 610,42			% 100	30 793 610,42	3,36
Sonstige Vermögensgegenstände						1 308 570,40	0,14
Zinsansprüche	EUR	1 214 969,18			% 100	1 214 969,18	0,13
Sonstige Ansprüche	EUR	93 601,22			% 100	93 601,22	0,01
Summe der Vermögensgegenstände ¹⁾						917 395 900,03	100,05
Sonstige Verbindlichkeiten						-455 492,79	-0,05
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-313 896,35			% 100	-313 896,35	-0,03
Verbindlichkeiten aus Steuern.	EUR	-110 708,03			% 100	-110 708,03	-0,02
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-30 888,41			% 100	-30 888,41	0,00
Fondsvermögen						916 940 407,24	100,00
Anteilwert						171,20	
Umlaufende Anteile						5 356 001,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y

Erläuterungen zur Bewertung

Die Anteilwerte werden von der Verwaltungsgesellschaft ermittelt sowie die Bewertung der Vermögenswerte des Fondsvermögens durchgeführt. Die grundsätzliche Kursversorgung sowie die Preisvalidierung erfolgen nach den von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der in den gesetzlichen Bestimmungen/Verordnungen bzw. im Prospekt des Fonds definierten Grundsätze für Bewertungsmethoden eingeführten Verfahren.

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

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

Fußnoten

- 1) Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.
 3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 535 511 366,00.

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 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere			
Verzinsliche Wertpapiere			
0,0000 % Berlin 12/14.03.19 A.378 LSA (DE000A1MLYD2)	EUR		1 500
0,0000 % Germany 13/15.08.23 IO Strip (DE0001143576)	EUR		6 400
0,0000 % Germany 97/04.07.23 Coupons (DE0001143261)	EUR		15 200
0,0000 % Niedersachsen 14/09.01.19 A.579 LSA (DE000A1YC665)	EUR		8 700
0,2500 % NRW.BANK 17/16.05.24 MTN IHS A.061 (DE000NWB0618)	EUR		16 000

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

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: EUR 125 621
 (Basiswerte: EURO-BUND JUN 19, EURO-BUND MAR 19)

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

unbefristet EUR 140 252

Gattung: 0,5000 % Bremen 15/03.03.25 A.198 LSA
 (DE000A11QJ16), 0,3750 % DNB Boligkredit 17/20.11.24
 MTN PF (XS1719108463), 0,5000 % European Stability
 Mechanism 16/02.03.26 MTN (EU000A1U9944), 0,0000 %
 Germany 94/04.01.24 (DE0001142008), 0,0000 % Germany
 97/04.07.23 Coupons (DE0001143261), 0,0000 % Germany
 97/04.07.25 Coupons (DE0001143287), 0,0000 % Germany
 97/04.07.26 Coupons (DE0001143295), 0,0000 % Germany
 97/04.07.27 Coupons (DE0001142032), 0,0000 % Germany
 98/04.01.27 Coupons (DE0001142602), 0,3750 % Hessen
 16/06.07.26 S.1605 LSA (DE000A1RQCY2), 0,5000 % KfW
 17/15.09.27 (DE000A2GSFA2), 0,3750 % L-Bank
 B-V-Förderbank 16/13.04.23 S.5559 MTN (DE000A13R9M1),
 0,6250 % Landwirts. Rentenbank 17/18.05.27 MTN
 (XS1615677280), 0,0000 % Niedersachsen 14/09.01.19 A.579
 LSA (DE000A1YC665), 0,7500 % Nordrhein-Westfalen
 16/16.01.26 R.1402 MTN LSA (DE000NRW0H99), 0,2500 %
 NRW.BANK 17/16.05.24 MTN IHS A.061 (DE000NWB0618),
 0,5000 % Rheinland-Pfalz 15/21.01.25 LSA
 (DE000RLP0645), 0,3750 % Stadshypotek 17/06.12.24
 MTN PF (XS1731734585), 0,5000 % Thüringen
 17/02.03.27 LSA (DE000A2E4X14)

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Wgh. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						1 636 144 815,95	93,65
Verzinsliche Wertpapiere							
1,3100	% ART Six/HSNH 15/15.07.26 MTN (XS1327533003)	EUR 50 000			% 106,6935	53 346 755,00	3,05
0,6250	% Baden-Württemberg 15/09.02.27 LSA (DE000A14JYV1) ³⁾	EUR 15 000			% 105,6840	15 852 600,00	0,91
6,2500	% Berlin 97/28.02.28 A.87 LSA (DE0001062321) ³⁾	EUR 25 000			% 154,3425	38 585 625,00	2,21
0,0000	% Caisse Francaise Fin. Local 05/15.12.20 MTN ÖPF (FR0010261412)	EUR 10 000			% 100,2000	10 020 000,00	0,57
0,0000	% European Investment Bank 09/20.02.29 MTN (XS0411137317) ³⁾	EUR 37 000			% 201,8790	74 695 230,00	4,28
3,0000	% European Investment Bank 13/14.10.33 MTN (XS0975634204) ³⁾	EUR 15 000			% 137,4300	20 614 500,00	1,18
0,0000	% European Investment Bank 96/05.11.26 (DE0001345908) ³⁾	EUR 28 077			% 100,0750	28 098 057,75	1,61
5,6250	% European Investment Bank 98/15.02.28 MTN (XS0093667334) ³⁾	EUR 21 300			% 148,0360	31 531 668,00	1,80
1,3750	% European Union 14/04.10.29 MTN (EU000A1ZR7H3) ³⁾	EUR 40 000			% 113,4110	45 364 400,00	2,60
1,1250	% European Union 15/01.12.28 MTN (EU000A18VJA3) ³⁾	EUR 20 000			% 108,9015	21 780 300,00	1,25
0,5190	% European Union 15/04.04.28 Tr.3 MTN (EU000A1Z0AW7) ³⁾	EUR 10 000			% 103,8400	10 384 000,00	0,59
0,5190	% European Union 15/04.04.29 Tr.4 MTN (EU000A1Z0AX5) ³⁾	EUR 37 000			% 103,7310	38 380 470,00	2,20
0,5190	% European Union 15/04.04.30 Tr.V MTN (EU000A1Z0AY3) ³⁾	EUR 30 000			% 102,9220	30 876 600,00	1,77
0,3750	% FMS Wertmanagement 15/29.04.30 S.50107 IHS MTN (DE000A14J2Q6) ³⁾	EUR 52 800			% 103,0490	54 409 872,00	3,11
0,0000	% Germany 00/04.01.30 (DE0001142131) ³⁾	EUR 60 000			% 103,4890	62 093 400,00	3,55
0,0000	% Germany 00/04.01.31 Coupons (DE0001142164) ³⁾	EUR 60 000			% 102,8985	61 739 100,00	3,53
0,0000	% Germany 00/04.01.31 Coupons (DE0001142644)	EUR 2 700	2 700		% 102,6570	2 771 739,00	0,16
0,0000	% Germany 03/04.07.29 Coupons (DE0001143329)	EUR 27 000			% 102,7315	27 737 505,00	1,59
0,0000	% Germany 03/04.07.30 Coupons (DE0001143337) ³⁾	EUR 16 300			% 102,2770	16 671 151,00	0,95
0,0000	% Germany 03/04.07.32 Coupons (DE0001143352)	EUR 9 000	9 000		% 101,3275	9 119 475,00	0,52
0,0000	% Germany 05/04.01.32 Coupons (DE0001142651)	EUR 17 400	14 400		% 102,2535	17 792 109,00	1,02
0,0000	% Germany 14/15.08.27 IO Strip AU46 (DE0003811451) ³⁾	EUR 15 000			% 103,2520	15 487 800,00	0,89
0,0000	% Germany 14/15.08.28 IO Strip S.AU46 (DE0003811469)	EUR 7 500			% 102,8045	7 710 337,50	0,44
0,0000	% Germany 14/15.08.30 IO Strip (DE0003811485) ³⁾	EUR 9 300	2 100		% 102,1650	9 501 345,00	0,54
0,0000	% Germany 14/15.08.31 IO Strip (DE0003811493) ³⁾	EUR 9 100	2 200		% 100,7845	9 171 389,50	0,52
0,0000	% Germany 14/15.08.32 IO Strip (DE0003811501)	EUR 1 300	1 300		% 100,1425	1 301 852,50	0,07
0,0000	% Germany 14/15.08.29 S.AU46 (DE0003811477)	EUR 26 000			% 102,4470	26 636 220,00	1,52
0,0000	% Germany 97/04.07.26 Coupons (DE0001143295) ³⁾	EUR 73 910			% 102,8545	76 019 760,95	4,35
0,0000	% Germany 97/04.07.27 Coupons (DE0001142032) ³⁾	EUR 87 800			% 103,9280	91 248 784,00	5,22
0,0000	% Germany 98/04.01.26 Coupons (DE0001142594)	EUR 31 700			% 102,9570	32 637 369,00	1,87
0,0000	% Germany 98/04.01.27 Coupons (DE0001142602) ³⁾	EUR 71 200			% 102,7025	73 124 180,00	4,19
0,0000	% Germany 98/04.01.28 (DE0001142057) ³⁾	EUR 81 200			% 103,6660	84 176 792,00	4,82
0,0000	% Germany 98/04.01.28 Coupons (DE0001142610)	EUR 3 000			% 103,7780	3 113 340,00	0,18
0,0000	% Germany 98/04.07.28 Coupons (DE0001143311) ³⁾	EUR 23 700			% 102,9340	24 395 358,00	1,40
0,0000	% Germany 98/04.07.28 PO Strip (DE0001142073) ³⁾	EUR 75 700			% 103,8750	78 633 375,00	4,50
1,1250	% Hamburg 18/30.10.31 LSA (DE000A1685Z1)	EUR 50 000			% 109,8905	54 945 250,00	3,15
0,0000	% Invest.bk. Schleswig Holstein 14/20.11.19 S.1 IHS (DE000A13SL42)	EUR 8 800			% 100,1470	8 812 936,00	0,50
0,3750	% KfW 15/23.04.30 MTN (DE000A11QTF7) ³⁾	EUR 65 000			% 103,1730	67 062 450,00	3,84
1,1250	% KfW 17/15.09.32 MTN (DE000A2GSE59) ³⁾	EUR 25 000	25 000		% 111,3640	27 841 000,00	1,59

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
0,2500 % Land Rheinland-Palatinat 19/31.05.29 LHS MTN (DE000RLP1130) ³⁾	EUR	30 000	30 000		% 101,5245	30 457 350,00	1,74
0,6250 % Landwirts. Rentenbank 15/20.02.30 S.1113 MTN Reg S (XS1192872866) ³⁾	EUR	47 000			% 105,6570	49 658 790,00	2,84
0,7500 % LfA Förderbank Bayern 19/01.04.31 IHS (DE000LFA1800)	EUR	10 000	10 000		% 104,5835	10 458 350,00	0,60
0,8750 % Niedersachsen 18/25.10.28 LSA S.884 (DE000A2LQ587) ³⁾	EUR	40 000			% 107,7175	43 087 000,00	2,47
1,6250 % Nordrhein-Westfalen 14/24.10.30 R.1333 LSA (DE000NRW0F26) ³⁾	EUR	25 000			% 114,9260	28 731 500,00	1,64
0,7500 % Nordrhein-Westfalen 15/26.01.27 R.1346 LSA (DE000NRW0GG0) ³⁾	EUR	17 675			% 106,2170	18 773 854,75	1,07
1,4350 % Nordrhein-Westfalen 15/27.01.31 R.1398 LSA (DE000NRW0H57) ³⁾	EUR	50 000	50 000		% 112,0490	56 024 500,00	3,21
0,2000 % Thüringen 16/26.10.26 LSA (DE000A2BPJZ8) ³⁾	EUR	15 000			% 102,3825	15 357 375,00	0,88
0,5000 % Wirtschafts & Infrastr.bank Hessen 18/13.08.31 IHS (DE000A2DAF51)	EUR	20 000			% 99,5600	19 912 000,00	1,14
Summe Wertpapiervermögen						1 636 144 815,95	93,65
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Zins-Derivate							
(Forderungen / Verbindlichkeiten)							
						2 280 440,00	0,13
Zinsterminkontrakte							
EURO-BUND SEP 19 (EURX)	EUR	144 400				2 280 440,00	0,13
Bankguthaben							
						105 051 943,15	6,01
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben.	EUR	105 051 943,15			% 100	105 051 943,15	6,01
Sonstige Vermögensgegenstände							
Zinsansprüche	EUR	4 333 415,55			% 100	4 333 415,55	0,25
Sonstige Ansprüche	EUR	153 861,34			% 100	153 861,34	0,01
Summe der Vermögensgegenstände ¹⁾							
						1 747 964 475,99	100,05
Sonstige Verbindlichkeiten							
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-663 496,65			% 100	-663 496,65	-0,04
Verbindlichkeiten aus Steuern.	EUR	-210 774,70			% 100	-210 774,70	-0,01
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-50 774,24			% 100	-50 774,24	0,00
Fondsvermögen							
						1 747 039 430,40	100,00
Anteilwert						216,67	
Umlaufende Anteile						8 063 076,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y

Erläuterungen zur Bewertung

Die Anteilwerte werden von der Verwaltungsgesellschaft ermittelt sowie die Bewertung der Vermögenswerte des Fondsvermögens durchgeführt. Die grundsätzliche Kursversorgung sowie die Preisvalidierung erfolgen nach den von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der in den gesetzlichen Bestimmungen/Verordnungen bzw. im Prospekt des Fonds definierten Grundsätze für Bewertungsmethoden eingeführten Verfahren.

Sofern keine handelbaren Kurse vorliegen, werden Bewertungsmodelle zur Preisermittlung (abgeleitete Verkehrswerte) genutzt, die zwischen State Street Bank Luxemburg als externem Price Service Provider und Verwaltungsgesellschaft 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.

Fußnoten

- 1) Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.
 3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 978 618 230,35.

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 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere			
Verzinsliche Wertpapiere			
0,5000 % European Stability Mechanism 16/02.03.26 MTN (EU000A1U9944)	EUR		25 000
0,3750 % L-Bank B-W-Förderbank 16/13.04.23 S.5559 MTN (DE000A13R9M1)	EUR		20 000
0,0000 % Niedersachsen 14/09.01.19 A.579 LSA (DE000A1YC665)	EUR		12 200

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

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte: EUR 298 874
 (Basiswerte: EURO-BUND JUN 19, EURO-BUND MAR 19)

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

unbefristet Volumen in 1000
 EUR 356 210

Gattung: 0,6250 % Baden-Württemberg 15/09.02.27 LSA (DE000A14JYW1), 3,0000 % European Investment Bank 13/14.10.33 MTN (XS0975634204), 5,6250 % European Investment Bank 98/15.02.28 MTN (XS0093667334), 0,5000 % European Stability Mechanism 16/02.03.26 MTN (EU000A1U9944), 1,3750 % European Union 14/04.10.29 MTN (EU000A1ZR7H3), 0,5190 % European Union 15/04.04.28 Tr.3 MTN (EU000A1Z0AW7), 0,5190 % European Union 15/04.04.29 Tr.4 MTN (EU000A1Z0AX5), 0,5190 % European Union 15/04.04.30 Tr.V MTN (EU000A1Z0AY3), 0,3750 % FMS Wertmanagement 15/29.04.30 S.50107 IHS MTN (DE000A14J2Q6), 0,0000 % Germany 00/04.01.30 (DE0001142131), 0,0000 % Germany 00/04.01.31 Coupons (DE0001142164), 0,0000 % Germany 03/04.07.29 Coupons (DE0001143329), 0,0000 % Germany 97/04.07.27 Coupons (DE0001142032), 0,0000 % Germany 98/04.01.26 Coupons (DE0001142594), 0,0000 % Germany 98/04.01.28 (DE0001142057), 0,0000 % Germany 98/04.01.28 Coupons (DE0001142610), 0,0000 % Germany 98/04.07.28 PO Strip (DE0001142073), 0,3750 % L-Bank B-W-Förderbank 16/13.04.23 S.5559 MTN (DE000A13R9M1), 0,2500 % Land Rheinland-Palatinat 19/31.05.29 LHS MTN (DE000RLP1130), 0,0000 % Niedersachsen 14/09.01.19 A.579 LSA (DE000A1YC665), 0,8750 % Niedersachsen 18/25.10.28 LSA S.884 (DE000A2LQ587), 0,2000 % Thüringen 16/26.10.26 LSA (DE000A2BPJZ8)

DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						3 854 725 770,13	93,28
Verzinsliche Wertpapiere							
1,1250 % Baden-Württemberg 18/25.07.36 LSA (DE000A14JY96) ³⁾	EUR	100 000			% 110,0820	110 082 000,00	2,66
0,7000 % Bayerische Landesbodenkreditanstalt 19/12.06.37 (DE000A161RJ5)	EUR	50 000	50 000		% 103,1130	51 556 500,00	1,25
1,0000 % Berlin 16/19.05.32 A.488 LSA (DE000A168023) ³⁾	EUR	50 000			% 107,9450	53 972 500,00	1,31
0,6250 % Berlin 16/25.08.36 A.490 LSA (DE000A2AAPH7) ³⁾	EUR	60 000			% 100,6580	60 394 800,00	1,46
1,3750 % Berlin 17/05.06.37 A.495 LSA (DE000A2AAPM7) ³⁾	EUR	34 800			% 113,1700	39 383 160,00	0,95
0,7500 % Brandenburg 16/08.08.36 LSA (DE000A11QE78) ³⁾	EUR	26 800	11 800		% 102,2900	27 413 720,00	0,66
1,1250 % Brandenburg 18/04.07.33 LSA (DE000A2AAWF7) ³⁾	EUR	17 500			% 109,2835	19 124 612,50	0,46
0,7000 % Brandenburg 19/22.05.34 LSA (DE000A2TR6F7)	EUR	35 000	35 000		% 103,0330	36 061 550,00	0,87
0,5000 % Bremen 17/14.06.34 A.208 LSA (DE000A1680R9) ³⁾	EUR	50 000			% 97,4970	48 748 500,00	1,18
1,2940 % Bremen 18/10.04.36 A.210 LSA (DE000A1680T5)	EUR	50 000			% 108,6520	54 326 000,00	1,31
0,0000 % Caisse Francaise Fin. Local 05/15.12.20 MTN ÖPF (FR0010261412)	EUR	13 000			% 100,2000	13 026 000,00	0,32
0,4300 % Danske Bank 18/01.06.23 MTN PF (XS1830113327)	EUR	20 000			% 102,6090	20 521 800,00	0,50
0,0000 % DNB Boligkreditt 14/27.08.21 MTN PF (XS1103651953)	EUR	10 000			% 100,5630	10 056 300,00	0,24
0,0000 % EUROFIMA 15/15.10.30 MTN (XS1307863081)	EUR	19 000			% 100,6635	19 126 065,00	0,46
0,0000 % European Investment Bank 00/04.09.30 MTN (XS0116967836) ³⁾	EUR	21 000			% 95,5150	20 058 150,00	0,49
0,0000 % European Investment Bank 00/15.03.30 MTN (XS0109077486)	EUR	28 529			% 96,0915	27 413 944,04	0,66
4,0000 % European Investment Bank 05/15.10.37 MTN (XS0219724878) ³⁾	EUR	10 000			% 160,6880	16 068 800,00	0,39
0,0000 % European Investment Bank 10/16.04.25 MTN (XS0502603136) ³⁾	EUR	10 000			% 102,2860	10 228 600,00	0,25
1,0000 % European Investment Bank 15/14.03.31 MTN (XS1183208328) ³⁾	EUR	20 000			% 109,7030	21 940 600,00	0,53
1,1250 % European Investment Bank 16/15.09.36 MTN (XS1361554584) ³⁾	EUR	30 700			% 110,6490	33 969 243,00	0,82
1,1250 % European Investment Bank 17/13.04.33 MTN (XS161297717) ³⁾	EUR	25 000			% 111,1610	27 790 250,00	0,67
1,6250 % European Stability Mechanism 15/17.11.36 MTN (EU000A1U9928) ³⁾	EUR	107 300			% 118,4610	127 108 653,00	3,08
1,1250 % European Stability Mechanism 16/03.05.32 MTN (EU000A1U9969) ³⁾	EUR	48 000			% 110,8750	53 220 000,00	1,29
1,5000 % European Union 15/04.10.35 MTN Reg S (EU000A1Z6TV6) ³⁾	EUR	87 455			% 116,6560	102 021 504,80	2,47
0,7500 % European Union 16/04.04.31 MTN (EU000A18Z2D4)	EUR	10 000			% 106,6720	10 667 200,00	0,26
1,1250 % European Union 16/04.04.36 MTN (EU000A18Y205) ³⁾	EUR	40 000			% 110,4040	44 161 600,00	1,07
0,0000 % Germany 00/04.01.31 Coupons (DE0001142164) ³⁾	EUR	365 000			% 102,8985	375 579 525,00	9,09
0,0000 % Germany 00/04.07.31 Coupons (DE0001143345)	EUR	2 250		22 000	% 102,7825	2 312 606,25	0,06
0,0000 % Germany 03/04.07.32 Coupons (DE0001143352) ³⁾	EUR	148 250		15 000	% 101,3275	150 218 018,75	3,64
0,0000 % Germany 03/04.07.33 Coupons (DE0001143360) ³⁾	EUR	85 300		17 700	% 101,5740	86 642 622,00	2,10
0,0000 % Germany 03/04.07.34 (DE0001142214) ³⁾	EUR	415 000			% 100,9035	418 749 525,00	10,13
0,0000 % Germany 03/04.07.34 Coupons (DE0001143378)	EUR	17 000		6 000	% 100,5660	17 096 220,00	0,41
0,0000 % Germany 05/04.01.32 Coupons (DE0001142651) ³⁾	EUR	18 000			% 102,2535	18 405 630,00	0,45
0,0000 % Germany 05/04.01.33 Coupons (DE0001142669) ³⁾	EUR	5 000			% 101,5490	5 077 450,00	0,12
0,0000 % Germany 05/04.01.34 Coupons (DE0001142677)	EUR	12 140	8 140		% 100,6225	12 215 571,50	0,30
0,0000 % Germany 05/04.01.35 Coupons (DE0001142685)	EUR	38 210	8 610		% 99,9550	38 192 805,50	0,92
0,0000 % Germany 05/04.01.36 Coupons (DE0001142693)	EUR	10 750	6 750		% 99,3915	10 684 586,25	0,26

DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
0,0000 % Germany 05/04.01.37 (DE0001142263) ³⁾	EUR	400 000	130 000		%	99,6370	398 548 000,00	9,64
0,0000 % Germany 05/04.01.37 Coupons (DE0001142701)	EUR	11 740	11 740		%	98,9635	11 618 314,90	0,28
0,0000 % Germany 07/04.07.35 Coupons (DE0001143386)	EUR	31 100	2 000	1 300	%	99,6240	30 983 064,00	0,75
0,0000 % Germany 07/04.07.36 Coupons (DE0001143394)	EUR	16 800		9 700	%	99,0350	16 637 880,00	0,40
0,0000 % Germany 07/04.07.37 Coupons (DE0001143402)	EUR	6 500	6 500		%	98,2060	6 383 390,00	0,15
0,0000 % Germany 14/15.08.30 IO Strip (DE0003811485) ³⁾	EUR	19 000			%	102,1650	19 411 350,00	0,47
0,0000 % Germany 14/15.08.31 IO Strip (DE0003811493)	EUR	18 100			%	100,7845	18 241 994,50	0,44
0,0000 % Germany 14/15.08.32 IO Strip (DE0003811501) ³⁾	EUR	20 450			%	100,1425	20 479 141,25	0,50
0,0000 % Germany 14/15.08.33 IO Strip (DE0003811519) ³⁾	EUR	27 375	1 725		%	100,7175	27 571 415,63	0,67
0,0000 % Germany 14/15.08.34 IO Strip (DE0003811527)	EUR	28 475	2 925		%	99,9640	28 464 749,00	0,69
0,0000 % Germany 14/15.08.35 IO Strip (DE0003811535) ³⁾	EUR	27 775	1 925		%	98,3910	27 328 100,25	0,66
0,0000 % Germany 14/15.08.36 S.AU46 (DE0003811543)	EUR	9 775	1 925		%	97,7225	9 552 374,38	0,23
0,0000 % Germany 14/15.08.37 IO Strip S.AU46 (DE0003811550)	EUR	23 425	23 425		%	96,9725	22 715 808,13	0,55
1,2000 % Hamburg 18/03.06.33 A.1 LSA (DE000A1685X6) ³⁾	EUR	35 820			%	110,1495	39 455 550,90	0,95
0,7500 % Hessen 16/04.08.36 S.1607 LSA (DE000A1RQC02) ³⁾	EUR	12 120			%	102,8350	12 463 602,00	0,30
1,3000 % Hessen 18/07.11.36 LSA (DE000A1RQDD4) ³⁾	EUR	50 000			%	112,2350	56 117 500,00	1,36
1,3000 % Hessen 18/10.10.33 S.1803 LSA (DE000A1RQDB8) ³⁾	EUR	40 000			%	111,7125	44 685 000,00	1,08
1,3750 % Investitionsbank Berlin 18/02.05.36 S.193 IHS (DE000A2GSEH0) ³⁾	EUR	90 000			%	113,0840	101 775 600,00	2,46
1,4000 % KfW 15/06.08.35 MTN (DE000A11QTJ9) ³⁾	EUR	26 000			%	99,1000	25 766 000,00	0,62
1,3750 % KfW 15/31.07.35 MTN (DE000A11QTK7) ³⁾	EUR	67 000			%	115,4340	77 340 780,00	1,87
1,2500 % KfW 16/04.07.36 MTN (DE000A168Y48) ³⁾	EUR	70 000			%	113,4920	79 444 400,00	1,92
0,6250 % Landwirts. Rentenbank 16/31.10.36 MTN (XS1511781897) ³⁾	EUR	140 000			%	102,7780	143 889 200,00	3,48
1,3750 % LfA Förderbank Bayern 18/30.11.36 IHS (DE000LFA1750)	EUR	17 500	17 500		%	112,1825	19 631 937,50	0,48
1,1250 % Niedersachsen 18/12.09.33 S.883 LSA (DE000A2NBKT4) ³⁾	EUR	36 000			%	109,2650	39 335 400,00	0,95
1,2500 % Nordrhein Westfalen 16/12.05.36 R.1410 MTN LSA (DE000NRW0JJ8) ³⁾	EUR	80 000			%	110,2400	88 192 000,00	2,13
0,0000 % Nordrhein-Westfalen 08/21.05.38 R.861 LSA (DE000NRW12R5) ³⁾	EUR	10 000			%	101,2210	10 122 100,00	0,24
2,3750 % Nordrhein-Westfalen 13/13.05.33 R.1250 LSA (DE000NRW2152) ³⁾	EUR	35 500			%	125,9890	44 726 095,00	1,08
0,1890 % Nykredit Realkredit 17/01.10.22 PF (DK0009515603) ³⁾	EUR	6 050			%	101,2040	6 122 842,00	0,15
0,5000 % Rheinland-Pfalz 18/30.07.36 LSA (DE000RLP1072)	EUR	50 000			%	99,3805	49 690 250,00	1,20
0,2420 % Swedbank Hypotek 18/09.05.23 MTN PF (XS1820768130)	EUR	20 000			%	101,7590	20 351 800,00	0,49
1,2500 % Thüringen 18/05.12.33 LSA (DE000A2TSS82) ³⁾	EUR	58 330			%	110,9570	64 721 218,10	1,57
1,4440 % WI Bank Hessen-rechtlich unse. Anstalt 18/28.03.36 (DE000A2DAF28)	EUR	50 000			%	114,7920	57 396 000,00	1,39
1,2500 % Wirt & Infra BK Hessen 18/06.09.33 IHS (DE000A2DAF77)	EUR	38 000			%	110,3850	41 946 300,00	1,02
Summe Wertpapiervermögen							3 854 725 770,13	93,28
Derivate								
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen								
Zins-Derivate								
(Forderungen / Verbindlichkeiten)								
							9 308 289,06	0,22
Zinsterminkontrakte								
EURO BUXL 30YR BOND SEP 19 (EURX)	EUR	167 300					9 308 289,06	0,22

DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Bankguthaben						259 750 907,37	6,29
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	259 750 907,37			% 100	259 750 907,37	6,29
Sonstige Vermögensgegenstände						10 871 381,28	0,26
Zinsansprüche	EUR	10 518 013,47			% 100	10 518 013,47	0,25
Sonstige Ansprüche	EUR	353 367,81			% 100	353 367,81	0,01
Summe der Vermögensgegenstände 1)						4 134 656 347,84	100,05
Sonstige Verbindlichkeiten						-2 171 007,88	-0,05
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-1 555 652,12			% 100	-1 555 652,12	-0,04
Verbindlichkeiten aus Steuern	EUR	-498 744,37			% 100	-498 744,37	-0,01
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-116 611,39			% 100	-116 611,39	0,00
Fondsvermögen						4 132 485 339,96	100,00
Anteilwert						263,78	
Umlaufende Anteile						15 666 405,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)

Erläuterungen zur Bewertung

Die Anteilswerte werden von der Verwaltungsgesellschaft ermittelt sowie die Bewertung der Vermögenswerte des Fondsvermögens durchgeführt. Die grundsätzliche Kursversorgung sowie die Preisvalidierung erfolgen nach den von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der in den gesetzlichen Bestimmungen/Verordnungen bzw. im Prospekt des Fonds definierten Grundsätze für Bewertungsmethoden eingeführten Verfahren.

Sofern keine handelbaren Kurse vorliegen, werden Bewertungsmodelle zur Preisermittlung (abgeleitete Verkehrswerte) genutzt, die zwischen State Street Bank Luxemburg als externem Price Service Provider und Verwaltungsgesellschaft 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 nicht zu abgeleiteten Verkehrswerten bewertet.

Fußnoten

1) Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.

3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 2 282 878 956,00.

DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y

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. Vhg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere			
Verzinsliche Wertpapiere			
0,0000 % Bremen 14/20.02.19 A.190 LSA (DE000A1K0V92)	EUR		16 000
0,0000 % Germany 03/04.07.30 Coupons (DE0001143337)	EUR		35 000
0,0000 % Niedersachsen 14/09.01.19 A.579 LSA (DE000A1YC665)	EUR		19 500
1,4350 % Nordrhein-Westfalen 15/27.01.31 R.1398 LSA (DE000NRW0H57)	EUR		50 000

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

	Volumen in 1000
Terminkontrakte	
Zinsterminkontrakte	
Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: EURO BUXL 30YR BOND JUN 19, EURO BUXL 30YR BOND MAR 19)	EUR 422 583

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

	Volumen in 1000
unbefristet	EUR 866 388

Gattung: 1,1250 % Baden-Württemberg 18/25.07.36 LSA (DE000A14JY96), 0,6250 % Berlin 16/25.08.36 A.490 LSA (DE000A2AAPH7), 1,1250 % Brandenburg 18/04.07.33 LSA (DE000A2AAWF7), 0,0000 % Bremen 14/20.02.19 A.190 LSA (DE000A1K0V92), 0,5000 % Bremen 17/14.06.34 A.208 LSA (DE000A1680R9), 0,0000 % European Investment Bank 00/04.09.30 MTN (XS0116967836), 0,0000 % European Investment Bank 00/15.03.30 MTN (XS0109077486), 0,0000 % European Investment Bank 10/16.04.25 MTN (XS0502603136), 1,1250 % European Investment Bank 17/13.04.33 MTN (XS1612977717), 1,6250 % European Stability Mechanism 15/17.11.36 MTN (EU000A1U9928), 1,1250 % European Stability Mechanism 16/03.05.32 MTN (EU000A1U9969), 0,7500 % European Union 16/04.04.31 MTN (EU000A18Z2D4), 1,1250 % European Union 16/04.04.36 MTN (EU000A18YZ05), 0,0000 % Germany 00/04.01.31 Coupons (DE0001142164), 0,0000 % Germany 00/04.07.31 Coupons (DE0001143345), 0,0000 % Germany 03/04.07.30 Coupons (DE0001143337), 0,0000 % Germany 03/04.07.32 Coupons (DE0001143352), 0,0000 % Germany 03/04.07.33 Coupons (DE0001143360), 0,0000 % Germany 03/04.07.34 (DE0001142214), 0,0000 % Germany 03/04.07.33 Coupons (DE0001143378), 0,0000 % Germany 05/04.01.33 Coupons (DE0001142669), 0,0000 % Germany 05/04.01.35 Coupons (DE0001142685), 0,0000 % Germany 05/04.01.37 (DE0001142263), 0,0000 % Germany 07/04.07.35 Coupons (DE0001143386), 0,0000 % Germany 07/04.07.36 Coupons (DE0001143394), 0,0000 % Germany 14/15.08.31 IO Strip (DE0003811493), 0,0000 % Germany 14/15.08.34 IO Strip (DE0003811527), 1,2000 % Hamburg 18/03.06.33 A.1 LSA (DE000A1685X6), 1,3000 % Hessen 18/07.11.36 LSA (DE000A1RQDD4), 1,4000 % KfW 15/06.08.35 MTN (DE000A11QTJ9), 1,3750 % KfW 15/31.07.35 MTN (DE000A11QTK7), 1,2500 % KfW 16/04.07.36 MTN (DE000A168Y48), 0,6250 % Landwirts. Rentenbank 16/31.10.36 MTN (XS1511781897), 0,0000 % Niedersachsen 14/09.01.19 A.579 LSA (DE000A1YC665), 1,2500 % Nordrhein Westfalen 16/12.05.36 R.1410 MTN LSA (DE000NRW0JJ8), 1,4350 % Nordrhein-Westfalen 15/27.01.31 R.1398 LSA (DE000NRW0H57)

DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

Vermögensaufstellung zum 30.06.2019

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						4 023 148 730,20	89,41
Verzinsliche Wertpapiere							
0,3750 % Baden-Württemberg 18/20.07.48 IHS (DE000A14JY70) ³⁾	EUR	100 000			% 90,3430	90 343 000,00	2,01
0,5000 % Berlin 17/19.06.47 LSA (DE000A2AAPP0) ³⁾	EUR	25 000			% 93,5580	23 389 500,00	0,52
0,9360 % Bremen 16/28.09.46 A.205 LSA (DE000A1680N8) ³⁾	EUR	50 000			% 102,9370	51 468 500,00	1,14
0,0000 % Bremen 18/20.08.48 S.212 (DE000A2G8W16) ³⁾	EUR	50 000			% 83,0620	41 531 000,00	0,92
0,0000 % Bremen 18/22.10.48 S.213 (DE000A2G8W24) ³⁾	EUR	75 000			% 81,9590	61 469 250,00	1,37
0,0000 % Caisse Francaise Fin. Local 05/15.12.20 MTN ÖPF (FR0010261412) ³⁾	EUR	49 500			% 100,2000	49 599 000,00	1,10
0,4300 % Danske Bank 18/01.06.23 MTN PF (XS1830113327) ³⁾	EUR	30 000			% 102,6090	30 782 700,00	0,68
0,0000 % DNB Boligkredit 14/17.11.21 MTN PF (XS1137512742) ³⁾	EUR	13 660			% 100,7000	13 755 620,00	0,31
0,0000 % DNB Boligkredit 14/27.08.21 MTN PF (XS1103651953) ³⁾	EUR	12 500			% 100,5630	12 570 375,00	0,28
0,0000 % DNB Boligkredit 14/30.04.21 MTN PF (XS1062737587) ³⁾	EUR	35 700			% 100,6020	35 914 914,00	0,80
0,1920 % DNB Boligkredit 18/11.05.23 MTN PF (XS1820073820) ³⁾	EUR	30 000			% 101,5635	30 469 050,00	0,68
0,0000 % EUROFIMA 15/15.10.30 MTN (XS1307863081) ³⁾	EUR	60 000			% 100,6635	60 398 100,00	1,34
0,0000 % European Investment Bank 10/16.04.25 MTN (XS0502603136) ³⁾	EUR	50 000			% 102,2860	51 143 000,00	1,14
1,5000 % European Investment Bank 17/15.11.47 MTN (XS1641457277) ³⁾	EUR	25 000			% 119,8970	29 974 250,00	0,67
1,8500 % European Stability Mechanism 15/01.12.55 MTN (EU000A1U9936) ³⁾	EUR	50 000			% 129,3740	64 687 000,00	1,44
0,0000 % Germany 10/04.07.42 IO Strip (DE0001143451) ³⁾	EUR	5 000			% 94,1540	4 707 700,00	0,10
0,0000 % Germany 10/04.07.42 PO Strip (DE0001108595) ³⁾	EUR	20 000			% 95,9785	19 195 700,00	0,43
0,0000 % Germany 12/04.07.44 IO Strip (DE0001143477) ³⁾	EUR	17 250			% 93,4915	16 127 283,75	0,36
0,0000 % Germany 12/04.07.44 PO Strip (DE0001108660) ³⁾	EUR	680 000			% 94,0505	639 543 400,00	14,21
0,0000 % Germany 14/15.08.41 IO Strip (DE0003811592) ³⁾	EUR	9 250			% 94,1195	8 706 053,75	0,19
0,0000 % Germany 14/15.08.42 IO Strip (DE0003811600) ³⁾	EUR	25 875			% 96,5000	24 969 375,00	0,55
0,0000 % Germany 14/15.08.43 IO Strip (DE0003811618) ³⁾	EUR	25 125			% 93,0835	23 387 229,38	0,52
0,0000 % Germany 14/15.08.44 IO Strip (DE0003811626) ³⁾	EUR	27 425	1 300		% 92,6580	25 411 456,50	0,56
0,0000 % Germany 14/15.08.45 IO Strip (DE0003811634) ³⁾	EUR	27 250	2 325		% 92,4150	25 183 087,50	0,56
0,0000 % Germany 14/15.08.46 IO Strip (DE0003811642) ³⁾	EUR	27 450	2 325		% 92,6685	25 437 503,25	0,57
0,0000 % Germany 14/15.08.46 PO Strip (DE0001108744) ³⁾	EUR	696 000			% 90,7245	631 442 520,00	14,03
0,0000 % Germany 17/15.08.47 PO Strip (DE0003811659) ³⁾	EUR	9 425	1 925		% 92,4125	8 709 878,13	0,19
0,0000 % Germany 17/15.08.48 PO Strip (DE0001108835) ³⁾	EUR	768 900	68 900		% 92,9240	714 492 636,00	15,88
0,0000 % Germany 17/15.08.48 PO Strip (DE0003811667) ³⁾	EUR	8 925	625		% 92,5000	8 255 625,00	0,18
1,0950 % Hamburg 16/13.06.46 A.3 LSA (DE000A1685T4) ³⁾	EUR	50 000			% 106,3945	53 197 250,00	1,18
0,0000 % KfW 16/29.01.46 MTN (DE000A168Y30) ³⁾	EUR	100 000			% 115,6290	115 629 000,00	2,57
0,2570 % Norddt. Landesbank 17/28.09.22 ÖPF (DE000NLB2QZ6) ³⁾	EUR	40 000			% 102,4150	40 966 000,00	0,91
0,0000 % Nordea Bank 15/05.06.20 MTN (XS1242968979) ³⁾	EUR	20 000			% 100,2020	20 040 400,00	0,45
0,0000 % Nordrhein-Westfalen 08/21.05.38 R.861 LSA (DE000NRW12R5) ³⁾	EUR	40 000			% 101,2210	40 488 400,00	0,90
1,0000 % Nordrhein-Westfalen 16/16.10.46 R.1427 MTN LSA (DE000NRW0J22) ³⁾	EUR	90 000			% 103,8070	93 426 300,00	2,08
1,6500 % Nordrhein-Westfalen 17/16.05.47 R.1435 MTN LSA (DE000NRW0KE7) ³⁾	EUR	71 670			% 119,3725	85 554 270,75	1,90

DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
1,5500 % Nordrhein-Westfalen 17/16.06.48 R.1439 MTN LSA (DE000NRW0KF4) ³⁾	EUR	40 000	40 000		% 117,0590	46 823 600,00	1,04
0,0000 % NRW.BANK 16/17.02.46 MTN IHS A.2ed (DE000NWB2ED6)	EUR	132 000			% 69,8000	92 136 000,00	2,05
0,1890 % Nykredit Realkredit 17/01.10.22 PF (DK0009515603) ³⁾	EUR	41 970			% 101,2040	42 475 318,80	0,94
0,6000 % Rheinland Pfalz 16/24.10.46 LSA (DE000RLP0793) ³⁾	EUR	50 000			% 92,8485	46 424 250,00	1,03
0,3750 % Rheinland-Pfalz 18/20.07.48 LSA (DE000RPL1064)	EUR	50 000			% 92,8880	46 444 000,00	1,03
1,1080 % Saarland 16/18.05.46 R.2 LSA (DE000A11P8S4) ³⁾	EUR	50 000			% 103,8830	51 941 500,00	1,15
1,2230 % Sachsen-Anhalt 16/04.05.46 MTN LSA (DE000A2AARB6) ³⁾	EUR	50 000			% 110,5920	55 296 000,00	1,23
0,3210 % Swedbank Hypotek 11/16.12.21 MTN PF (XS0720522779)	EUR	20 000			% 101,3035	20 260 700,00	0,45
0,2590 % Swedbank Hypotek 17/23.01.20 MTN PF (XS1554269933)	EUR	3 000			% 100,2850	3 008 550,00	0,07
0,2420 % Swedbank Hypotek 18/09.05.23 MTN PF (XS1820768130)	EUR	30 000			% 101,7590	30 527 700,00	0,68
1,1000 % Thüringen 17/03.07.47 LSA (DE000A2GSCZ6) ³⁾	EUR	25 000			% 106,9800	26 745 000,00	0,59
1,1270 % Thüringen 19/02.04.49 LSA (DE000A2TSDQ6) ³⁾	EUR	50 000	50 000		% 107,9980	53 999 000,00	1,20
0,5000 % Wirtschafts.bank Hessen 18/28.08.46 IHS (DE000A2DAF69)	EUR	100 000			% 93,8945	93 894 500,00	2,09
5,5000 % EUROFIMA 01/07.06.32 MTN (XS0132378166)	GBP	39 500			% 144,0870	63 350 806,99	1,41
5,0000 % European Investment Bank 99/15.04.39 (XS0096499057)	GBP	44 000			% 158,1500	77 455 476,40	1,72
Summe Wertpapiervermögen						4 023 148 730,20	89,41
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						21 568 777,83	0,48
Zinsterminkontrakte							
EURO BUXL 30YR BOND SEP 19 (EURX)	EUR	410 700				21 568 777,83	0,48
Swaps						180 171 450,03	4,01
Zinsswaps (Zahlen / Erhalten)							
Swap Zero 3M Euribor/1,58% (DBK)28.09.18-28.09.58 (OTC)	EUR	500 000				225 116 330,00	5,00
Zins-Währungsswaps (Zahlen / Erhalten)							
Swap GBP 5%/6M Euribor (MLL) 15.04.39 (OTC)	GBP	44 000				-27 772 246,28	-0,62
Swap GBP 5,5%/6M Euribor (DBK) 07.06.32 (OTC)	GBP	39 500				-17 172 633,69	-0,38
Bankguthaben						246 224 172,67	5,47
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	246 224 172,67			% 100	246 224 172,67	5,47
Sonstige Vermögensgegenstände						30 721 223,79	0,68
Zinsansprüche	EUR	4 340 815,12			% 100	4 340 815,12	0,10
Einschüsse (Initial Margin)	EUR	25 981 418,00			% 100	25 981 418,00	0,58
Sonstige Ansprüche	EUR	398 990,67			% 100	398 990,67	0,01
Summe der Vermögensgegenstände ¹⁾						4 546 779 234,49	101,05

DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Sonstige Verbindlichkeiten						-2 353 164,69	-0,05
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-1 679 275,39		%	100	-1 679 275,39	-0,04
Verbindlichkeiten aus Steuern	EUR	-542 222,37		%	100	-542 222,37	-0,01
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-131 666,93		%	100	-131 666,93	0,00
Fondsvermögen						4 499 481 189,83	100,00
Anteilwert						192,98	
Umlaufende Anteile						23 316 097,000	

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX = Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
 OTC = Over the Counter

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 28.06.2019

Britische Pfund GBP 0,898400 = EUR 1

Erläuterungen zur Bewertung

Die Anteilwerte werden von der Verwaltungsgesellschaft ermittelt sowie die Bewertung der Vermögenswerte des Fondsvermögens durchgeführt. Die grundsätzliche Kursversorgung sowie die Preisvalidierung erfolgen nach den von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der in den gesetzlichen Bestimmungen/Verordnungen bzw. im Prospekt des Fonds definierten Grundsätze für Bewertungsmethoden eingeführten Verfahren.

Sofern keine handelbaren Kurse vorliegen, werden Bewertungsmodelle zur Preisermittlung (abgeleitete Verkehrswerte) genutzt, die zwischen State Street Bank Luxemburg als externem Price Service Provider und Verwaltungsgesellschaft 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 nicht zu abgeleiteten Verkehrswerten bewertet.

Fußnoten

- 1) Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.
 3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 1 588 291 163,25.

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 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge	Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
Börsengehandelte Wertpapiere				0,0000	% Nordea Kredit Realkreditakt.		
					14/01.01.19 PF (LU1110205314)	EUR	22 590
Verzinsliche Wertpapiere				0,0000	% Nordrhein-Westfalen 12/05.06.19		
0,2840	% Dexia Credit Local 17/07.03.19				R.1187 LSA (DE000NRWOER2)	EUR	10 000
	MTN (XS1575798860)	EUR	30 000				
0,0000	% DNB Boligkredit 14/29.01.19						
	MTN PF (XS1023622175)	EUR	9 000				

DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

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

Volumen in 1000

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Gekaufte Kontrakte:
(Basiswerte: EURO BUXL 30YR BOND JUN 19,
EURO BUXL 30YR BOND MAR 19)

EUR 1 000 683

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

Volumen in 1000

unbefristet

EUR 1 266 259

Gattung: 0,3750 % Baden-Württemberg 18/20.07.48 IHS (DE000A14JY70), 0,9360 % Bremen 16/28.09.46 A.205 LSA (DE000A1680N8), 0,2840 % Dexia Credit Local 17/07.03.19 MTN (XS1575798860), 0,0000 % DNB Boligkredit 14/29.01.19 MTN PF (XS1023622175), 0,0000 % European Investment Bank 10/16.04.25 MTN (XS0502603136), 1,5000 % European Investment Bank 17/15.11.47 MTN (XS1641457277), 1,8500 % European Stability Mechanism 15/01.12.55 MTN (EU000A1U9936), 0,0000 % Germany 10/04.07.42 IO Strip (DE0001143451), 0,0000 % Germany 10/04.07.42 PO Strip (DE0001108595), 0,0000 % Germany 12/04.07.44 PO Strip (DE0001108660), 0,0000 % Germany 14/15.08.46 PO Strip (DE0001108744), 0,0000 % Germany 17/15.08.48 PO Strip (DE0001108835), 1,0950 % Hamburg 16/13.06.46 A.3 LSA (DE000A1685T4), 0,0000 % Nordrhein-Westfalen 08/21.05.38 R.861 LSA (DE000NRW12R5), 0,0000 % Nordrhein-Westfalen 12/05.06.19 R.1187 LSA (DE000NRW0ER2), 1,0000 % Nordrhein-Westfalen 16/16.10.46 R.1427 MTN LSA (DE000NRWQJ22), 1,5500 % Nordrhein-Westfalen 17/16.06.48 R.1439 MTN LSA (DE000NRW0KF4), 1,2230 % Sachsen-Anhalt 16/04.05.46 MTN LSA (DE000A2AARB6), 5,0000 % European Investment Bank 99/15.04.39 (XS0096499057)

DWS Vorsorge Premium

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

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
Angaben in Fondswährung			
1. Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	-	-	2 441 867,52
in % des Fondsvermögens	-	-	0,43
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name			Merrill Lynch International Ltd.
Bruttovolumen offene Geschäfte			1 207 136,16
Sitzstaat			Großbritannien (ohne Guernsey, Jersey, Insel Man)
2. Name			J.P. Morgan Securities PLC
Bruttovolumen offene Geschäfte			1 207 136,16
Sitzstaat			Großbritannien (ohne Guernsey, Jersey, Insel Man)
3. Name			J.P. Morgan AG, Frankfurt
Bruttovolumen offene Geschäfte			27 595,20
Sitzstaat			Bundesrepublik Deutschland
4. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
5. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
6. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
7. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
8. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

DWS Vorsorge Premium

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	-	-	2 441 867,52
über 1 Jahr	-	-	-
unbefristet	-	-	-

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

Art(en):			
Bankguthaben	-	-	1 100 000,00 *)
Schuldverschreibungen	-	-	1 102 751,01 *)
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.

DWS Vorsorge Premium

6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten		
Wahrung(en):	-	EUR *)
7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Betrage)		
unter 1 Tag	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-
1 bis 3 Monate	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-
uber 1 Jahr	-	-
unbefristet	-	2 202 751,01 *)
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)		
Ertragsanteil des Fonds		
absolut	10 957,90	103 233,33
in % der Bruttoertrage	67,00	100,00
Kostenanteil des Fonds	-	-
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft		
absolut	5 397,13	-
in % der Bruttoertrage	33,00	-
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft	-	-
Ertragsanteil Dritter		
absolut	-	-
in % der Bruttoertrage	-	-
Kostenanteil Dritter	-	-
9. Ertrage fur den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps		
absolut	-	
10. Verleiene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermogensgegenstande des Fonds		
Summe	-	
Anteil	-	
11. Die 10 groten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps		
1. Name		French Republic
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		1 102 751,01 *)
2. Name		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		

DWS Vorsorge Premium

3. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
4. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
5. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
6. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
7. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
8. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
9. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
10. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
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	-		-

DWS Vorsorge Premium

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

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	-	-	1
1. Name			State Street Bank
verwahrter Betrag absolut			2 202 751,01 *)

DWS Vorsorge Premium Balance

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	-	-	-
in % des Fondsvermögens	-	-	-
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
2. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
3. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
4. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
5. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
6. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
7. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
8. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
9. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

DWS Vorsorge Premium Balance

10. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

3. Art(en) von Abwicklung und Clearing

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

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	-	-	-

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

	Art(en):		
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	-	-	-
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.

DWS Vorsorge Premium Balance

	6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten		
Wahrung(en):	-	-	-
	7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Betrage)		
unter 1 Tag	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-
uber 1 Jahr	-	-	-
unbefristet	-	-	-
	8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)		
	Ertragsanteil des Fonds		
absolut	1 241,22	-	-
in % der Bruttoertrage	67,00	-	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	-
	Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft		
absolut	611,28	-	-
in % der Bruttoertrage	33,00	-	-
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft	-	-	-
	Ertragsanteil Dritter		
absolut	-	-	-
in % der Bruttoertrage	-	-	-
Kostenanteil Dritter	-	-	-
	9. Ertrage fur den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps		
absolut			-
	10. Verleiene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermogensgegenstande des Fonds		
Summe			-
Anteil			-
	11. Die 10 groten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps		
1. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
2. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			

DWS Vorsorge Premium Balance

3. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
4. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
5. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
6. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
7. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
8. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
9. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
10. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
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	-		-

DWS Vorsorge Premium Balance

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

Gesamtzahl Verwahrer/
Kontoführer

	-		-		-
--	---	--	---	--	---

1. Name
verwahrter Betrag absolut

DWS Vorsorge Premium Balance Plus

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

Im Berichtszeitraum lagen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte gemäß der o.g. rechtlichen Bestimmung vor.

DWS Vorsorge Premium Plus

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	43 634,76	-	-
in % des Fondsvermögens	0,28	-	-
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name	UBS AG, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	43 634,76		
Sitzstaat	Großbritannien		
2. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
3. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
4. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
5. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
6. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
7. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
8. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
9. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

DWS Vorsorge Premium Plus

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	43 634,76	-	-

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

Art(en):			
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	-	-	-
Aktien	41 540,02	-	-
Sonstige	4 122,73	-	-

Qualität(en):

Dem Fonds werden – soweit Wertpapier-Darlehensgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte oder Geschäfte mit OTC-Derivaten (außer Währungstermingeschäften) abgeschlossen werden - Sicherheiten in einer der folgenden Formen gestellt:

- liquide Vermögenswerte wie Barmittel, kurzfristige Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente gemäß Definition in Richtlinie 2007/16/EG vom 19. März 2007, Akkreditive und Garantien auf erstes Anfordern, die von erstklassigen, nicht mit dem Kontrahenten verbundenen Kreditinstituten ausgegeben werden, beziehungsweise von einem OECD-Mitgliedstaat oder dessen Gebietskörperschaften oder von supranationalen Institutionen und Behörden auf kommunaler, regionaler oder internationaler Ebene begebene Anleihen unabhängig von ihrer Restlaufzeit

- Anteile eines in Geldmarktinstrumente anlegenden Organismus für gemeinsame Anlagen (nachfolgend „OGA“), der täglich einen Nettoinventarwert berechnet und der über ein Rating von AAA oder ein vergleichbares Rating verfügt

- Anteile eines OGAW, der vorwiegend in die unter den nächsten beiden Gedankenstrichen aufgeführten Anleihen / Aktien anlegt

- Anleihen unabhängig von ihrer Restlaufzeit, die ein Mindestrating von niedrigem Investment-Grade aufweisen

- Aktien, die an einem geregelten Markt eines Mitgliedstaats der Europäischen Union oder an einer Börse eines OECD-Mitgliedstaats zugelassen sind oder gehandelt werden, sofern diese Aktien in einem wichtigen Index enthalten sind.

Die Verwaltungsgesellschaft behält sich vor, die Zulässigkeit der oben genannten Sicherheiten einzuschränken. Des Weiteren behält sich die Verwaltungsgesellschaft vor, in Ausnahmefällen von den oben genannten Kriterien abzuweichen.

Weitere Informationen zu Sicherheitenanforderungen befinden sich in dem Verkaufsprospekt des Fonds/Teilfonds.

DWS Vorsorge Premium Plus

6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Wahrung(en):	EUR; CAD; USD	-	-
7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Betrage)			
unter 1 Tag	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-
uber 1 Jahr	-	-	-
unbefristet	45 662,75	-	-
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	431,31	-	-
in % der Bruttoertrage	67,00	-	-
Kostenanteil des Fonds			
	-	-	-
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	212,40	-	-
in % der Bruttoertrage	33,00	-	-
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft			
	-	-	-
Ertragsanteil Dritter			
absolut	-	-	-
in % der Bruttoertrage	-	-	-
Kostenanteil Dritter			
	-	-	-
9. Ertrage fur den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
absolut			-
10. Verleiene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermogensgegenstande des Fonds			
Summe	43 634,76		
Anteil	0,29		
11. Die 10 groten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
1. Name	Ordina N.V.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 131,07		
2. Name	Unilever N.V.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 130,47		

DWS Vorsorge Premium Plus

3. Name	Uranium Participation Corp.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 128,70		
4. Name	ResMed Inc.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 127,74		
5. Name	Koninklijke Volker Wessels N.V.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 127,29		
6. Name	BinckBank N.V.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 125,63		
7. Name	Heijmans N.V.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 125,38		
8. Name	NSI N.V.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 122,73		
9. Name	BEFESA S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 106,61		
10. Name	TKH Group N.V.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 100,57		

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	-	-

DWS Vorsorge Premium Plus

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

Gesamtzahl Verwahrer/
Kontoführer

1	-	-
---	---	---

1. Name

Bank of New York		
------------------	--	--

verwahrter Betrag absolut

45 662,75		
-----------	--	--

DWS Vorsorge Rentenfonds 1Y

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	-	-	-
in % des Fondsvermögens	-	-	-
	2. Die 10 größten Gegenparteien		
1. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
2. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
3. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
4. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
5. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
6. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
7. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
8. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
9. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

DWS Vorsorge Rentenfonds 1Y

10. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

3. Art(en) von Abwicklung und Clearing

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

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	-	-	-

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

Art(en):			
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	-	-	-
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.

DWS Vorsorge Rentenfonds 1Y

6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Wahrung(en):	-	-	-
7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Betrage)			
unter 1 Tag	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-
uber 1 Jahr	-	-	-
unbefristet	-	-	-
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	4 893,28	-	-
in % der Bruttoertrage	67,00	-	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	-
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	2 438,08	-	-
in % der Bruttoertrage	33,00	-	-
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft	-	-	-
Ertragsanteil Dritter			
absolut	-	-	-
in % der Bruttoertrage	-	-	-
Kostenanteil Dritter	-	-	-
9. Ertrage fur den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
absolut	-		
10. Verleiene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermogensgegenstande des Fonds			
Summe	-		
Anteil	-		
11. Die 10 groten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
1. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
2. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			

DWS Vorsorge Rentenfonds 1Y

3. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
4. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
5. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
6. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
7. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
8. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
9. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
10. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
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	-		-

DWS Vorsorge Rentenfonds 1Y

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

Gesamtzahl Verwahrer/
Kontoführer

-	-	-
---	---	---

1. Name
verwahrter Betrag absolut

DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y

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

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
Angaben in Fondswährung			
1. Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	97 982 336,50	-	-
in % des Fondsvermögens	24,54	-	-
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name	BNP Paribas S.A. Arbitrage, Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	47 800 622,50		
Sitzstaat	Frankreich		
2. Name	HSBC Bank PLC		
Bruttovolumen offene Geschäfte	21 087 015,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
3. Name	UBS AG, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	16 307 874,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
4. Name	Crédit Suisse Securities (Europe) Ltd.		
Bruttovolumen offene Geschäfte	9 713 490,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
5. Name	Barclays Bank PLC, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	3 073 335,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
6. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
7. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
8. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
9. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y

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	97 982 336,50	-	-

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

Art(en):			
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	10 258 564,44	-	-
Aktien	83 174 988,46	-	-
Sonstige	9 182 987,59	-	-

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.

DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y

6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Wahrung(en):	EUR; CHF; JPY; USD; MXN; GBP; CAD; AUD; SEK	-	-
7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Betrage)			
unter 1 Tag	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-
uber 1 Jahr	-	-	-
unbefristet	102 616 540,49	-	-
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	80 130,45	-	-
in % der Bruttoertrage	67,00	-	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	-
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	39 724,90	-	-
in % der Bruttoertrage	33,00	-	-
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft	-	-	-
Ertragsanteil Dritter			
absolut	-	-	-
in % der Bruttoertrage	-	-	-
Kostenanteil Dritter	-	-	-
9. Ertrage fur den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
absolut	-		
10. Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermogensgegenstande des Fonds			
Summe	97 982 336,50		
Anteil	25,64		
11. Die 10 groten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
1. Name	European Investment Bank (EIB)		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	10 258 564,44		
2. Name	Signify N.V.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 520 039,30		

DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y

3. Name	Intesa Sanpaolo S.p.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 519 982,38		
4. Name	PSP Swiss Property AG		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 519 975,23		
5. Name	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 519 967,72		
6. Name	Warehouses De Pauw S.C.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 519 872,16		
7. Name	Great Portland Estates PLC		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 476 460,17		
8. Name	Signature Bank		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 283 238,21		
9. Name	Chocoladefabriken Lindt & Sprüngli AG		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3 297 378,09		
10. Name	Wereldhave N.V.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3 202 514,78		

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	-	-

DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y

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

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	2	-	-
1. Name	Bank of New York		
verwahrter Betrag absolut	92 357 976,05		
2. Name	State Street Bank		
verwahrter Betrag absolut	10 258 564,44		

DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y

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

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
Angaben in Fondswährung			
1. Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	302 615 350,26	-	-
in % des Fondsvermögens	55,72	-	-
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name	Commerzbank AG, Frankfurt		
Bruttovolumen offene Geschäfte	129 925 192,00		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
2. Name	BNP Paribas S.A. Arbitrage, Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	97 382 999,00		
Sitzstaat	Frankreich		
3. Name	UBS AG, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	27 443 170,50		
Sitzstaat	Großbritannien		
4. Name	DekaBank		
Bruttovolumen offene Geschäfte	22 924 927,76		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
5. Name	Barclays Bank PLC, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	10 948 901,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
6. Name	Citigroup Global Markets Ltd., London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	10 333 500,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
7. Name	Zürcher Kantonalbank		
Bruttovolumen offene Geschäfte	3 656 660,00		
Sitzstaat	Schweiz		
8. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
9. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y

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	302 615 350,26	-	-

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

Art(en):			
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	32 544 818,40	-	-
Aktien	275 787 034,50	-	-
Sonstige	10 836 590,68	-	-

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.

DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y

6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Wahrung(en):	EUR; JPY; GBP; USD; CHF; CAD; AUD; NOK	-	-
7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Betrage)			
unter 1 Tag	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-
uber 1 Jahr	-	-	-
unbefristet	319 168 443,58	-	-
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	182 004,34	-	-
in % der Bruttoertrage	67,00	-	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	-
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	90 276,91	-	-
in % der Bruttoertrage	33,00	-	-
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft	-	-	-
Ertragsanteil Dritter			
absolut	-	-	-
in % der Bruttoertrage	-	-	-
Kostenanteil Dritter	-	-	-
9. Ertrage fur den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
absolut	-		
10. Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermogensgegenstande des Fonds			
Summe	302 615 350,26		
Anteil	58,09		
11. Die 10 groten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
1. Name	Vinci S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	25 369 498,00		
2. Name	BASF SE		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	18 545 520,00		

DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y

3. Name	Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	14 255 907,11		
4. Name	European Investment Bank (EIB)		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	10 982 573,12		
5. Name	Banco Santander S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	9 221 811,95		
6. Name	Cboe Global Markets Inc.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	9 221 790,82		
7. Name	Deutsche Börse AG		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	9 221 749,06		
8. Name	Nokia Oyj		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	9 221 710,77		
9. Name	Zurich Insurance Group AG		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	9 186 628,77		
10. Name	French Republic		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	9 065 411,52		
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	-		-

DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y

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

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	2	-	-
1. Name	Bank of New York		
verwahrter Betrag absolut	167 356 172,91		
2. Name	State Street Bank		
verwahrter Betrag absolut	151 812 270,67		

DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y

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

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
Angaben in Fondswährung			
1. Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	535 511 366,00	-	-
in % des Fondsvermögens	58,40	-	-
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name	Commerzbank AG, Frankfurt		
Bruttovolumen offene Geschäfte	221 806 970,00		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
2. Name	BNP Paribas S.A. Arbitrage, Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	167 992 812,00		
Sitzstaat	Frankreich		
3. Name	DekaBank		
Bruttovolumen offene Geschäfte	64 159 008,00		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
4. Name	UBS AG, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	27 381 005,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
5. Name	Morgan Stanley & Co. International PLC		
Bruttovolumen offene Geschäfte	25 664 375,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
6. Name	Barclays Bank PLC, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	12 973 086,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
7. Name	J.P. Morgan Securities PLC		
Bruttovolumen offene Geschäfte	11 357 720,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
8. Name	Deutsche Bank AG, Frankfurt		
Bruttovolumen offene Geschäfte	2 626 200,00		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
9. Name	Merrill Lynch International Ltd.		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1 550 190,00		
Sitzstaat	Großbritannien		

DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y

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	535 511 366,00	-	-

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

Art(en):			
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	26 771 164,87	-	-
Aktien	533 973 743,00	-	-
Sonstige	6 899 283,75	-	-

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.

DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y

6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten		
Wahrung(en):	JPY; GBP; EUR; USD; SEK; CAD; CHF; AUD; NOK; DKK	-
		-
7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Betrage)		
unter 1 Tag	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-
1 bis 3 Monate	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-
uber 1 Jahr	-	-
unbefristet	567 644 191,62	-
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)		
Ertragsanteil des Fonds		
absolut	288 353,36	-
in % der Bruttoertrage	67,00	-
Kostenanteil des Fonds		
	-	-
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft		
absolut	142 934,44	-
in % der Bruttoertrage	33,00	-
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft		
	-	-
Ertragsanteil Dritter		
absolut	-	-
in % der Bruttoertrage	-	-
Kostenanteil Dritter		
	-	-
9. Ertrage fur den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps		
absolut		-
10. Verleiene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermogensgegenstande des Fonds		
Summe	535 511 366,00	
Anteil	60,53	
11. Die 10 groten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps		
1. Name	Munchener Ruckversicherungs- Gesellschaft AG in Munchen	
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	34 230 639,11	
2. Name	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. (BBVA)	
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	30 906 060,50	

DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y

3. Name	Nestlé S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	23 779 284,88		
4. Name	French Republic		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	23 504 713,44		
5. Name	Total S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	21 187 612,50		
6. Name	Barclays Bank PLC, London		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	19 742 954,11		
7. Name	Vivendi S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	17 333 680,00		
8. Name	Aena SME S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	16 035 060,00		
9. Name	Vinci S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	15 973 720,00		
10. Name	Investor AB		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	15 904 381,98		

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	-	-

DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y

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

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	2	-	-
1. Name	Bank of New York		
verwahrter Betrag absolut	300 283 160,12		
2. Name	State Street Bank		
verwahrter Betrag absolut	267 361 031,50		

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y

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

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
Angaben in Fondswährung			
1. Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	978 618 230,35	-	-
in % des Fondsvermögens	56,02	-	-
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name	BNP Paribas S.A. Arbitrage, Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	397 340 965,00		
Sitzstaat	Frankreich		
2. Name	Commerzbank AG, Frankfurt		
Bruttovolumen offene Geschäfte	286 692 659,00		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
3. Name	DekaBank		
Bruttovolumen offene Geschäfte	190 309 177,50		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
4. Name	UBS AG, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	41 636 774,50		
Sitzstaat	Großbritannien		
5. Name	J.P. Morgan Securities PLC		
Bruttovolumen offene Geschäfte	31 219 837,50		
Sitzstaat	Großbritannien		
6. Name	HSBC Bank PLC		
Bruttovolumen offene Geschäfte	13 743 000,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
7. Name	Citigroup Global Markets Ltd., London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	13 195 393,75		
Sitzstaat	Großbritannien		
8. Name	Morgan Stanley & Co. International PLC		
Bruttovolumen offene Geschäfte	3 972 800,60		
Sitzstaat	Großbritannien		
9. Name	Crédit Suisse Securities (Europe) Ltd.		
Bruttovolumen offene Geschäfte	507 622,50		
Sitzstaat	Großbritannien		

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y

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	978 618 230,35	-	-

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

Art(en):			
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	86 205 192,26	-	-
Aktien	926 101 035,93	-	-
Sonstige	26 154 383,45	-	-

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.

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y

6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Wahrung(en):	EUR; GBP; JPY; MXN; SEK; CHF; USD; AUD; DKK	-	-
7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Betrage)			
unter 1 Tag	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-
ber 1 Jahr	-	-	-
unbefristet	1 038 460 611,64	-	-
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	497 822,33	-	-
in % der Bruttoertrage	67,00	-	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	-
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	247 201,40	-	-
in % der Bruttoertrage	33,00	-	-
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft	-	-	-
Ertragsanteil Dritter			
absolut	-	-	-
in % der Bruttoertrage	-	-	-
Kostenanteil Dritter	-	-	-
9. Ertrage fr den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
absolut	-		
10. Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermgensgegenstande des Fonds			
Summe	978 618 230,35		
Anteil	59,81		
11. Die 10 groten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
1. Name	French Republic		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	71 723 663,95		
2. Name	Safran		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	47 367 567,50		

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y

3. Name	Volkswagen AG		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	37 582 321,01		
4. Name	Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	37 582 135,74		
5. Name	Scor Se		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	37 581 919,93		
6. Name	CRH PLC		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	37 581 708,11		
7. Name	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	37 581 304,11		
8. Name	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	33 377 406,43		
9. Name	Allianz SE		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	27 780 818,22		
10. Name	Mizuho Financial Group Inc.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	26 104 129,46		
	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	-		-

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y

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

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	2	-	-
1. Name	Bank of New York		
verwahrter Betrag absolut	677 069 712,64		
2. Name	State Street Bank		
verwahrter Betrag absolut	361 390 899,00		

DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y

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

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
Angaben in Fondswährung			
1. Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	2 282 878 956,00	-	-
in % des Fondsvermögens	55,24	-	-
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name	Commerzbank AG, Frankfurt		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1 000 267 485,50		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
2. Name	BNP Paribas S.A. Arbitrage, Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	829 028 750,00		
Sitzstaat	Frankreich		
3. Name	HSBC Bank PLC		
Bruttovolumen offene Geschäfte	167 861 870,50		
Sitzstaat	Großbritannien		
4. Name	DekaBank		
Bruttovolumen offene Geschäfte	157 528 336,00		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
5. Name	UBS AG, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	103 473 030,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
6. Name	BNP Paribas S.A., Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	12 273 752,00		
Sitzstaat	Frankreich		
7. Name	Morgan Stanley & Co. International PLC		
Bruttovolumen offene Geschäfte	10 736 271,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
8. Name	Goldman Sachs International		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1 104 040,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
9. Name	Barclays Bank PLC, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	605 421,00		
Sitzstaat	Großbritannien		

DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y

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	2 282 878 956,00	-	-

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

Art(en):			
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	193 636 635,82	-	-
Aktien	2 156 453 218,47	-	-
Sonstige	57 883 358,69	-	-

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.

DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y

6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Wahrung(en):	EUR; GBP; CHF; USD; JPY; MXN; CAD; SEK	-	-
7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Betrage)			
unter 1 Tag	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-
uber 1 Jahr	-	-	-
unbefristet	2 407 973 212,98	-	-
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	1 128 711,54	-	-
in % der Bruttoertrage	67,00	-	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	-
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	560 586,80	-	-
in % der Bruttoertrage	33,00	-	-
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft	-	-	-
Ertragsanteil Dritter			
absolut	-	-	-
in % der Bruttoertrage	-	-	-
Kostenanteil Dritter	-	-	-
9. Ertrage fur den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
absolut	-		
10. Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermogensgegenstande des Fonds			
Summe	2 282 878 956,00		
Anteil	59,22		
11. Die 10 groten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
1. Name	French Republic		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	121 649 869,71		
2. Name	Airbus SE		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	107 861 696,60		

DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y

3. Name	Zurich Insurance Group AG		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	98 811 699,98		
4. Name	Banco Santander S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	78 427 864,61		
5. Name	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	78 427 607,78		
6. Name	Société Générale S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	76 076 591,39		
7. Name	EssilorLuxottica S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	73 465 120,00		
8. Name	CRH PLC		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	71 569 024,87		
9. Name	Schneider Electric SE		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	69 881 504,00		
10. Name	Total S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	62 152 950,00		

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	-	-

DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y

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

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	2	-	-
1. Name	Bank of New York		
verwahrter Betrag absolut	1 229 691 760,17		
2. Name	State Street Bank		
verwahrter Betrag absolut	1 178 281 452,81		

DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

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	1 588 291 163,25	-	-
in % des Fondsvermögens	35,30	-	-
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name	BNP Paribas S.A. Arbitrage, Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	721 177 680,00		
Sitzstaat	Frankreich		
2. Name	Morgan Stanley & Co. International PLC		
Bruttovolumen offene Geschäfte	333 648 031,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
3. Name	Commerzbank AG, Frankfurt		
Bruttovolumen offene Geschäfte	321 056 630,00		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
4. Name	DekaBank		
Bruttovolumen offene Geschäfte	104 940 550,75		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
5. Name	HSBC Bank PLC		
Bruttovolumen offene Geschäfte	64 040 130,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
6. Name	Barclays Bank PLC, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	24 375 996,50		
Sitzstaat	Großbritannien		
7. Name	UBS AG, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	19 052 145,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
8. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			
9. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

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	1 588 291 163,25	-	-

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

	Art(en):		
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	27 557 887,72	-	-
Aktien	1 572 845 093,61	-	-
Sonstige	67 183 419,86	-	-

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.

DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Wahrung(en):	NOK; EUR; JPY; SEK; CAD; CHF; USD; MXN; GBP; AUD	-	-
7. Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Betrage)			
unter 1 Tag	-	-	-
1 Tag bis 1 Woche	-	-	-
1 Woche bis 1 Monat	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 Monate bis 1 Jahr	-	-	-
uber 1 Jahr	-	-	-
unbefristet	1 667 586 401,19	-	-
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	887 840,79	-	-
in % der Bruttoertrage	67,00	-	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	-
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	440 600,25	-	-
in % der Bruttoertrage	33,00	-	-
Kostenanteil der Verwaltungsgesellschaft	-	-	-
Ertragsanteil Dritter			
absolut	-	-	-
in % der Bruttoertrage	-	-	-
Kostenanteil Dritter	-	-	-
9. Ertrage fur den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
absolut	-		
10. Verleihte Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermogensgegenstande des Fonds			
Summe	1 588 291 163,25		
Anteil	39,48		
11. Die 10 groten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
1. Name	Banco Santander S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	72 332 793,21		
2. Name	Intesa Sanpaolo S.p.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	68 258 813,32		

DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

3. Name	Ryanair Holdings PLC		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	59 589 240,49		
4. Name	Allianz SE		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	54 285 954,43		
5. Name	Vinci S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	53 897 844,00		
6. Name	Deutsche Börse AG		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	50 221 671,27		
7. Name	Renault S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	46 527 525,00		
8. Name	UBS Group AG		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	46 511 790,21		
9. Name	ING Groep N.V.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	43 748 141,57		
10. Name	Land Securities Group PLC		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	39 233 857,99		

12. Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps

Anteil	0,00
---------------	------

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	-	-

DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration

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

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	2	-	-
1. Name	Bank of New York		
verwahrter Betrag absolut	1 312 344 783,98		
2. Name	State Street Bank		
verwahrter Betrag absolut	355 241 617,21		

DWS Vorsorge - 30.06.2019

Zusammensetzung des Fondsvermögens (in EUR)			
	DWS Vorsorge Konsolidiert	DWS Vorsorge Premium	DWS Vorsorge Rentenfonds 15Y
Wertpapiervermögen	12 045 559 959,37	536 668 018,44	3 854 725 770,13
Zins-Derivate	33 874 646,89	-	9 308 289,06
Swaps	182 379 603,61	2 213 075,37	-
Bankguthaben	730 928 246,68	29 375 217,26	259 750 907,37
Sonstige Vermögensgegenstände	50 032 095,90	901,02	10 871 381,28
Summe der Vermögensgegenstände ¹⁾	13 087 953 146,36	568 486 004,24	4 134 656 347,84
Sonstige Verbindlichkeiten	- 6 987 240,75	- 577 433,50	- 2 171 007,88
= Fondsvermögen	13 035 787 311,70	567 679 778,59	4 132 485 339,96

Zusammensetzung des Fondsvermögens (in EUR)			
	DWS Vorsorge Premium Plus	DWS Vorsorge Premium Balance	DWS Vorsorge Premium Balance Plus
Wertpapiervermögen	14 913 706,68	19 877 909,00	654 912,30
Zins-Derivate	-	-	-
Swaps	-	- 4 921,79	-
Bankguthaben	674 166,02	769 442,80	21 370,13
Sonstige Vermögensgegenstände	64,80	-	-
Summe der Vermögensgegenstände ¹⁾	15 587 937,50	20 647 351,80	676 282,43
Sonstige Verbindlichkeiten	- 13 261,45	- 11 135,74	- 356,98
= Fondsvermögen	15 574 676,05	20 631 294,27	675 925,45

¹⁾ Beinhaltet, sofern vorhanden, keine Positionen mit negativem Bestand.

DWS Vorsorge Rentenfonds 10Y	DWS Vorsorge Rentenfonds 7Y	DWS Vorsorge Rentenfonds 5Y	DWS Vorsorge Rentenfonds 3Y	DWS Vorsorge Rentenfonds XL Duration
1 636 144 815,95	884 760 279,21	520 902 380,26	382 108 622,20	4 023 148 730,20
2 280 440,00	533 440,00	67 240,00	115 780,00	21 568 777,83
-	-	-	-	180 171 450,03
105 051 943,15	30 793 610,42	21 783 766,90	16 246 712,06	246 224 172,67
4 487 276,89	1 308 570,40	598 628,83	1 003 411,96	30 721 223,79
1 747 964 475,99	917 395 900,03	543 352 015,99	399 474 526,22	4 546 779 234,49
- 925 045,59	- 455 492,79	- 247 938,45	- 164 273,42	- 2 353 164,69
1 747 039 430,40	916 940 407,24	543 104 077,54	399 310 252,80	4 499 481 189,83

DWS Vorsorge Rentenfonds 1Y
171 654 815,00
680,00
-
20 236 937,90
1 040 636,93
192 933 069,83
- 68 130,26
192 864 939,57

Hinweise für Anleger in der Schweiz

Der Vertrieb von Anteilen dieser kollektiven Kapitalanlagen (die „Anteile“) in der Schweiz richtet sich ausschliesslich an qualifizierte Anleger, wie sie im Bundesgesetz über die kollektiven Kapitalanlagen vom 23. Juni 2006 („KAG“) in seiner jeweils gültigen Fassung und in der umsetzenden Verordnung („KKV“) definiert sind. Entsprechend sind und werden diese kollektiven Kapitalanlagen nicht bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA registriert. Dieses Dokument und/oder jegliche andere Unterlagen, die sich auf die Anteile beziehen, dürfen in der Schweiz einzig qualifizierten Anlegern zur Verfügung gestellt werden.

1. Vertreter in der Schweiz

DWS CH AG
Hardstrasse 201
CH-8005 Zürich

2. Zahlstelle in der Schweiz

Deutsche Bank (Suisse) SA
Place des Bergues 3
CH-1201 Genf

3. Bezugsort der massgeblichen Dokumente

Der Verkaufsprospekt, die Anlagebedingungen, „Wesentliche Anlegerinformationen“ sowie Jahres- und Halbjahresberichte können beim Vertreter in der Schweiz kostenlos bezogen werden.

4. Erfüllungsort und Gerichtsstand

Für die in der Schweiz und von der Schweiz aus vertriebenen Anteile ist am Sitz des Vertreters Erfüllungsort und Gerichtsstand begründet.

**Verwaltungsgesellschaft, Zentralverwaltung,
Transferstelle, Registerstelle und
Hauptvertriebsstelle**

DWS Investment S.A.
2, Boulevard Konrad Adenauer
L-1115 Luxemburg
Eigenkapital per 31.12.2018: 288,6 Mio. Euro
vor Gewinnverwendung

Mit Wirkung zum 1. Januar 2019 wurde die
Deutsche Asset Management S.A. in
DWS Investment S.A. umbenannt.

Aufsichtsrat

Holger Naumann
Vorsitzender
DWS Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Stefan Kreuzkamp
DWS Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Frank Krings
Deutsche Bank Luxembourg S.A.,
Luxemburg

Dr. Matthias Liermann
DWS Investment GmbH,
Frankfurt am Main

Claire Peel
DWS Management GmbH,
Frankfurt am Main

Nikolaus von Tippelskirch
DWS Management GmbH,
Frankfurt am Main

Vorstand

Manfred Bauer
Vorsitzender
DWS Investment S.A.,
Luxemburg

Nathalie Bausch
DWS Investment S.A.,
Luxemburg

Barbara Schots
DWS Investment S.A.,
Luxemburg

Abschlussprüfer

KPMG Luxembourg
Société coopérative
39, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg

Verwahrstelle

State Street Bank Luxembourg S.C.A.
49, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg

Fondsmanager

DWS Investment GmbH
Mainzer Landstraße 11-17
D-60329 Frankfurt am Main

Vertriebs-, Zahl- und Informationsstelle

LUXEMBURG
Deutsche Bank Luxembourg S.A.
2, Boulevard Konrad Adenauer
L-1115 Luxemburg

DWS Investment S.A.
2, Boulevard Konrad Adenauer
L-1115 Luxemburg
Tel.: +352 4 21 01-1
Fax: +352 4 21 01-9 00

