

DWS Investment GmbH

FOS Strategie - Fonds Nr. 1

Halbjahresbericht 2019/2020



FOS Strategie - Fonds Nr. 1

Inhalt

Halbjahresbericht 2019/2020
vom 1.10.2019 bis 31.3.2020 (gemäß § 103 KAGB)

Hinweise 2

Halbjahresbericht
FOS Strategie - Fonds Nr. 1 4

Hinweise

Wertentwicklung

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

Darüber hinaus sind in den Berichten auch die entsprechenden Vergleichsindizes – soweit vorhanden – dargestellt. Alle Grafik- und Zahlenangaben geben den **Stand vom 31. März 2020** wieder (sofern nichts anderes angegeben ist).

Verkaufsprospekte

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

Angaben zur Kostenpauschale

In der Kostenpauschale sind folgende Aufwendungen nicht enthalten:

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

Details zur Vergütungsstruktur sind im aktuellen Verkaufsprospekt geregelt.

Ausgabe- und Rücknahmepreise

Börsentäglich im Internet
www.dws.de

Coronakrise

Seit Januar 2020 hat sich das Coronavirus ausgebreitet und in der Folgezeit zu einer ernsten, wirtschaftlichen Krise geführt, deren konkrete Auswirkungen auf die Konjunktur, einzelne Märkte und Branchen aufgrund des hohen Grads an Unsicherheit aktuell noch nicht verlässlich abschätzbar sind. Angesichts dessen hat sich die Kapitalverwaltungsgesellschaft des Sondervermögens nach Gesprächen mit den wichtigsten Dienstleistern davon überzeugt, dass die getroffenen Maßnahmen und Pläne zur Sicherstellung der Fortführung des Geschäftsbetriebs die derzeit absehbaren bzw. laufenden operativen Risiken eindämmen und gewährleisten, dass die Verwaltung des Sondervermögens weiterhin ordnungsgemäß erfolgen kann. Der Ausbruch und die Dynamik der globalen Ausbreitung des Virus haben jedoch dazu geführt, dass die möglichen Auswirkungen im Jahr 2020 mit bedeutenden Unsicherheiten behaftet und zum Zeitpunkt der Aufstellung des vorliegenden Berichts nicht abschließend beurteilbar sind. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft ergreift alle als angemessen erachteten Maßnahmen, um die Anlegerinteressen bestmöglich zu schützen.

Halbjahresbericht

FOS Strategie - Fonds Nr. 1

FOS STRATEGIE-FONDS NR. 1

Wertentwicklung im Überblick

ISIN	6 Monate
DE000DWS0TS9	-7,7%

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

Stand: 31.3.2020
Angaben auf Euro-Basis

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Vermögensübersicht zum 31.03.2020

	Bestand in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien (Branchen):		
Gesundheitswesen	22 192 710,15	6,81
Informationstechnologie	18 482 719,78	5,66
Hauptverbrauchsgüter	14 484 902,64	4,44
Dauerhafte Konsumgüter	12 794 130,61	3,92
Industrien	11 265 482,70	3,45
Finanzsektor	10 694 095,22	3,28
Grundstoffe	10 117 702,44	3,10
Versorger	9 877 554,72	3,03
Energie	2 356 140,19	0,72
Sonstige	44 639 816,09	13,68
Summe Aktien:	156 905 254,54	48,09
2. Anleihen (Emittenten):		
Sonst. Finanzierungsinstitutionen	34 592 142,59	10,60
Institute	31 407 046,56	9,63
Unternehmen	12 696 703,75	3,89
Zentralregierungen	12 555 960,94	3,85
Sonstige öffentliche Stellen	1 554 847,50	0,48
Summe Anleihen:	92 806 701,34	28,45
3. Zertifikate	27 997 000,00	8,58
4. Investmentanteile	21 152 940,00	6,48
5. Derivate	-5 003 697,64	-1,53
6. Bankguthaben	32 179 709,84	9,86
7. Sonstige Vermögensgegenstände	585 016,93	0,18
II. Verbindlichkeiten		
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-359 782,08	-0,11
III. Fondsvermögen	326 263 142,93	100,00

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

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Vermögensaufstellung zum 31.03.2020

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						265 947 391,18	81,51
Aktien							
Coloplast B (DK0060448595)	Stück	44 000		6 000	DKK 982,8000	5 790 465,99	1,77
Novo-Nordisk B (DK0060534915)	Stück	110 000			DKK 411,6500	6 063 403,86	1,86
Aareal Bank (DE0005408116)	Stück	132 561			EUR 14,8150	1 963 891,22	0,60
Allianz (DE0008404005)	Stück	25 000	25 000	10 000	EUR 154,9400	3 873 500,00	1,19
alstria office REIT (DE000A0LD2U1)	Stück	225 000	71 000	21 000	EUR 13,2200	2 974 500,00	0,91
Anheuser-Busch InBev (BE0974293251)	Stück	64 000			EUR 38,9050	2 489 920,00	0,76
Aurubis (DE0006766504)	Stück	38 399	38 399		EUR 37,3200	1 433 050,68	0,44
B.R.A.I.N. Biotechnology Reg. (DE0005203947)	Stück	103 085			EUR 6,6000	680 361,00	0,21
BASF Reg. (DE000BASF111)	Stück	41 000	41 000		EUR 42,5950	1 746 395,00	0,54
BNP Paribas (FR0000131104)	Stück	40 000	40 000		EUR 27,4050	1 096 200,00	0,34
Covestro (DE0006062144)	Stück	35 000	35 000	35 000	EUR 27,4700	961 450,00	0,29
Deutsche Post Reg. (DE0005552004)	Stück	120 000			EUR 24,6100	2 953 200,00	0,91
DIC Asset Reg. (DE000A1X3X4)	Stück	88 869	88 869		EUR 9,4100	836 257,29	0,26
ENCAVIS (DE0006095003)	Stück	490 687			EUR 9,1400	4 484 879,18	1,37
GAG Immobilien pref. (DE0005863534)	Stück	62 767		10 000	EUR 81,0000	5 084 127,00	1,56
INDUS Holding (DE0006200108)	Stück	100 829		2 583	EUR 23,5000	2 369 481,50	0,73
Infineon Technologies Reg. (DE0006231004)	Stück	250 000			EUR 13,7760	3 444 000,00	1,06
Linde (IE00BZ12WP82)	Stück	8 300	8 300		EUR 158,4000	1 314 720,00	0,40
Lloyd Fonds (DE000A12UP29)	Stück	151 419		33 581	EUR 3,2000	484 540,80	0,15
MorphoSys (DE0006632003)	Stück	33 107			EUR 90,8000	3 006 115,60	0,92
Siltronic Reg. (DE000WAF3001)	Stück	44 000			EUR 68,0000	2 992 000,00	0,92
Sixt (DE0007231326)	Stück	27 254	27 254		EUR 50,6500	1 380 415,10	0,42
Snam (IT0003153415)	Stück	830 000		500 000	EUR 4,1550	3 448 650,00	1,06
Teamviewer (DE000A2YN900)	Stück	136 997	30 000		EUR 38,0900	5 218 215,73	1,60
Total (FR0000120271)	Stück	40 000	30 000		EUR 34,9350	1 397 400,00	0,43
Verbund AG (AT0000746409)	Stück	58 661	46 000		EUR 33,1400	1 944 025,54	0,60
Wacker Chemie (DE000WCH8881)	Stück	23 400	23 400		EUR 44,7800	1 047 852,00	0,32
Wacker Neuson (DE000WACK012)	Stück	150 000		25 000	EUR 10,0200	1 503 000,00	0,46
Wirecard AG (DE0007472060)	Stück	20 800	6 800		EUR 103,1000	2 144 480,00	0,66
Reckitt Benckiser Group (GB00B24CGK77)	Stück	60 000	818	26 253	GBP 61,4500	4 134 335,05	1,27
Equinor (NO0010096985)	Stück	80 000	80 000	80 000	NOK 129,9500	902 599,01	0,28
Alibaba Group Holding ADR (US01609W1027)	Stück	32 000			USD 191,2700	5 574 861,10	1,71
Allegro Merger RIGHT (US01749N1292)	Stück	80 057		267 769	USD 0,1000	7 291,83	0,00
Alphabet Cl.C (US02079K1079)	Stück	3 063	2 700	1 587	USD 1 146,8200	3 199 480,52	0,98
Altus Midstream Co. (US02215L1008)	Stück	89 785		70 000	USD 0,6865	56 141,18	0,02
Bank of America Corp. (US0605051046)	Stück	91 000		119 000	USD 22,0400	1 826 796,61	0,56
Barrick Gold (CA0679011084)	Stück	150 000		75 000	USD 19,2900	2 635 485,93	0,81
CHP Merge (US12558Y1064)	Stück	281 691	281 691		USD 9,7000	2 488 753,71	0,76
Conyers Park II Acquisition Corp Unit (US2128962030)	Stück	37 037			USD 10,2500	345 777,62	0,11
Costco Wholesale Corp. (US22160K1051)	Stück	14 400		14 000	USD 291,1200	3 818 314,96	1,17
Crescent Acquisition D.I.A (US22564L1052)	Stück	500 000			USD 9,8600	4 490 390,75	1,38
DFP Healthcare Acquisitions Corp. (US23343Q2093)	Stück	29 190	29 190		USD 9,9300	264 010,11	0,08
DiamondPeak Holdings Cl.A (US25280H1005)	Stück	290 910			USD 9,9000	2 623 197,92	0,80
Estée Lauder Companies, The Cl.A (US5184391044)	Stück	19 900			USD 165,2300	2 994 878,40	0,92
Experience Investment (US30217C1099)	Stück	377 358	377 358		USD 9,6800	3 327 102,14	1,02
Flying Eagle Acquisition Unit (US34407Y2028)	Stück	29 190	29 190		USD 9,9200	263 744,24	0,08
Freeport-McMoRan B (US35671D8570)	Stück	52 500	52 500		USD 6,2400	298 387,83	0,09
Gores Metropolis (US3828721098)	Stück	153 846			USD 9,9000	1 387 262,41	0,43
Hennessy Capital Acquisition IV D.I.A (US42589C1045)	Stück	261 194			USD 10,1300	2 409 960,12	0,74
Lowe's Companies (US5486611073)	Stück	31 600		13 400	USD 88,7100	2 553 270,79	0,78
Nasdaq (US6311031081)	Stück	16 000			USD 99,4400	1 449 166,59	0,44
New Providence Acquisition (US64822P1066)	Stück	115 385	115 385		USD 9,8000	1 029 941,71	0,32
NIKE B (US6541061031)	Stück	60 000			USD 85,3800	4 665 998,72	1,43
Osprey Technology Acquisition (US68839R1041)	Stück	246 478	246 478		USD 9,6500	2 166 420,17	0,66
Paramount Group (US69924R1086)	Stück	200 000	200 000		USD 8,8300	1 608 525,37	0,49
PayPal Holdings (US70450Y1038)	Stück	53 000		10 000	USD 97,0300	4 684 024,05	1,44
Pfizer (US7170811035)	Stück	100 000	100 000		USD 32,6700	2 975 680,85	0,91
RMG Acquisition (US7496411064)	Stück	269 230			USD 9,8500	2 415 443,57	0,74
Silver Spike Acquisition C.A (KYG8136L1068)	Stück	307 692	307 692		USD 9,8000	2 746 499,32	0,84
The Procter & Gamble (US7427181091)	Stück	10 000			USD 115,0000	1 047 454,23	0,32
Thunder Bridge Acquisition II Cl.A (KYG8857S1167)	Stück	393 258	393 258		USD 9,7000	3 474 453,59	1,06
Waste Management (Del.) (US94106L1098)	Stück	14 500	14 500		USD 94,6000	1 249 385,19	0,38
Xylem (US98419M1009)	Stück	30 000	30 000		USD 66,2400	1 810 000,91	0,55

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Verzinsliche Wertpapiere							
0,3750 % Aareal Bank 19/10.04.24 IHS MTN (DE000A2E4CQ2)	EUR	1 000			% 101,0435	1 010 435,00	0,31
0,1250 % African Development Bank 16/07.10.26 MTN (XS1501560848)	EUR	1 000			% 101,0765	1 010 765,00	0,31
0,2500 % Alstom 19/14.10.26 MTN (FR0013453040)	EUR	600	600		% 94,3035	565 821,00	0,17
0,2500 % AT & T 19/04.03.26 (XS2051361264)	EUR	1 550			% 93,1805	1 444 297,75	0,44
0,4000 % Baxter International 19/15.05.24 (XS1998215393)	EUR	500		500	% 96,7580	483 790,00	0,15
1,7500 % Bevco 18/09.02.23 (XS1767050351)	EUR	1 000			% 98,3005	983 005,00	0,30
0,3750 % BMW Finance 19/24.09.27 MTN (XS2055728054)	EUR	640			% 88,5475	566 704,00	0,17
0,0000 % Daimler 19/08.02.24 MTN (DE000A2YNZV0)	EUR	750			% 93,2685	699 513,75	0,21
0,3000 % DekaBank DGZ 19/20.11.26 MTN (XS2082333787)	EUR	400	400		% 94,1605	376 642,00	0,12
3,2500 % DIC Asset 17/11.07.22 (DE000A2GSCV5)	EUR	1 900			% 96,0790	1 825 501,00	0,56
2,5000 % Dufry One 17/15.10.24 (XS1699848914) ³⁾	EUR	1 000		600	% 80,6515	806 515,00	0,25
0,2500 % France O.A.T. 13/25.07.24 INFL (FR0011427848)	EUR	500			% 104,5195	551 497,14	0,17
0,5000 % Germany 14/15.04.30 INFL (DE0001030559) ³⁾	EUR	2 000			% 115,6410	2 427 790,28	0,74
1,0000 % Ireland 16/15.05.26 (IE00BV8C9418)	EUR	1 000			% 107,0995	1 070 995,00	0,33
0,9000 % Ireland 18/15.05.28 (IE00BDHDP44)	EUR	1 000			% 107,7010	1 077 010,00	0,33
0,8750 % Iren 19/14.10.29 MTN (XS2065601937)	EUR	290	290		% 94,1545	273 048,05	0,08
3,1000 % Italy B.T.P. 11/15.09.26 INFL (IT0004735152)	EUR	1 000		500	% 113,5745	1 251 238,91	0,38
2,3500 % Italy B.T.P. 14/15.09.24 INFL (IT0005004426)	EUR	1 000			% 106,9850	1 116 912,70	0,34
1,2500 % Italy B.T.P. 16/01.12.26 (IT0005210650)	EUR	1 000			% 101,1810	1 011 810,00	0,31
1,3750 % La Banque Postale 19/24.04.29 MTN (FR0013415692)	EUR	1 500		500	% 92,8560	1 392 840,00	0,43
0,3750 % LB Baden-Württemberg 19/29.07.26 MTN (DE000LB2CLL7)	EUR	300		700	% 90,0245	270 073,50	0,08
0,1900 % National Grid Electricity Transm. 20/20.01.25 (XS2104915033)	EUR	190	190		% 96,4550	183 264,50	0,06
0,8750 % NIBC Bank 19/08.07.2025 MTN (XS2023631489)	EUR	400			% 94,5460	378 184,00	0,12
5,3750 % Porr 20/Und (XS2113662063)	EUR	2 500	2 500		% 71,5140	1 787 850,00	0,55
0,2500 % Raiffeisen Bank International 20/22.01.25 MTN (XS2106056653)	EUR	900	900		% 94,0880	846 792,00	0,26
0,3750 % Red Eléctrica Financiaciones 20/24.07.28 MTN (XS2103013210)	EUR	400	400		% 96,1080	384 432,00	0,12
0,7500 % Royal Bank of Scotland Group 19/15.11.25 (XS2080205367)	EUR	480	480		% 90,5245	434 517,60	0,13
2,2000 % RZD Capital 19/23.05.27 LPN (XS1843437036)	EUR	850			% 97,3165	827 190,25	0,25
1,8000 % Spain 13/30.11.24 INFL (ES00000126A4)	EUR	2 000	1 000		% 109,4445	2 276 970,93	0,70
1,9500 % Spain 16/30.04.26 (ES00000127Z9)	EUR	1 000			% 110,3365	1 103 365,00	0,34
0,1250 % SpareBank 1 Boligkredit 19/14.05.26 MTN PF (XS1995620967)	EUR	1 000			% 100,5865	1 005 865,00	0,31
0,2500 % Telenor 19/25.09.27 MTN (XS2056396919)	EUR	390			% 95,2800	371 592,00	0,11
0,8750 % TenneT Holding 19/03.06.30 MTN (XS2002491780)	EUR	1 000		1 000	% 97,8325	978 325,00	0,30
0,5000 % UNEDIC 19/20.03.29 MTN (FR0013410008)	EUR	1 500			% 103,6565	1 554 847,50	0,48
2,1250 % UniCredit 16/24.10.26 MTN (XS1508450688) ³⁾	EUR	1 500			% 96,6020	1 449 030,00	0,44
0,5000 % UniCredit 19/09.04.25 MTN (XS2063547041)	EUR	750	750		% 90,3235	677 426,25	0,21
0,3750 % Volkswagen Bank 19/05.07.22 MTN (XS2023306140)	EUR	500		500	% 96,6160	483 080,00	0,15
1,5000 % Volkswagen Financial Service 19/01.10.24 MTN (XS1972548231)	EUR	1 000		1 200	% 95,6145	956 145,00	0,29
0,3750 % Westpac Banking 19/02.04.26 MTN (XS1978200472)	EUR	1 000			% 101,5460	1 015 460,00	0,31
2,5000 % ZF Europe Finance 19/23.10.27 (XS2010039977) ³⁾	EUR	1 100	1 100		% 77,3855	851 240,50	0,26
0,0000 % Deutsche Bank 96/15.10.21 (DE0001343101)	ITL	1 000 000			% 95,9700	495 643,69	0,15
1,5060 % AEGON 95/und. (NL0000120004) ³⁾	NLG	2 000		2 000	% 89,4180	811 522,39	0,25
4,2600 % AEGON 96/und. (NL0000120889) ³⁾	NLG	4 835			% 71,6435	1 571 877,98	0,48
5,5000 % Allianz 12/und. (XS0857872500) ³⁾	USD	1 000			% 95,3495	868 471,63	0,27
5,5000 % AXA 13/und. MTN (XS0876682666)	USD	1 000		1 000	% 95,8105	872 670,55	0,27
8,1510 % Dresdner Funding Tr I 99/30.06.31 Reg S (XS0097772965)	USD	1 000			% 114,8275	1 045 883,05	0,32

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
7,6250 % LB Baden-Württemberg 93/01.02.23 (US514886AC47)	USD	3 000			% 118,5312	3 238 853,39	0,99
4,7500 % ZF North America Capital 15/29.04.25 Reg S (USU98737AC03)	USD	2 000		1 000	% 83,9970	1 530 139,36	0,47
Verbriefte Geldmarktinstrumente							
0,0230 % AEGON 04/und. (NL0000116150)	EUR	3 000		1 500	% 55,0780	1 652 340,00	0,51
0,4500 % AXA 03/und. MTN (XS0179060974)	EUR	1 000			% 69,8750	698 750,00	0,21
0,0750 % AXA 04/und. MTN (XS0203470157)	EUR	1 000			% 63,8280	638 280,00	0,20
0,1120 % BA-CA Finance (Cayman) 04/und. (DE000A0DD4K8)	EUR	3 000			% 69,5030	2 085 090,00	0,64
0,2300 % Ba-Ca Finance 2 05/Und. (DE000A0DYW70)	EUR	2 000			% 68,9910	1 379 820,00	0,42
0,0000 % Crédit Agricole 05/und (FR0010161026)	EUR	500			% 71,1605	355 802,50	0,11
0,6610 % Credit Logement 06/und. (FR0010301713)	EUR	5 000			% 81,0470	4 052 350,00	1,24
0,0590 % Deutsche Postbank Funding Trust I 04/und. pref. (DE000A0DEN75)	EUR	1 000	1 000		% 69,8020	698 020,00	0,21
3,7500 % Deutsche Postbank Funding Trust II 04/und. pref. (DE000A0DHUM0)	EUR	1 000		900	% 88,0000	880 000,00	0,27
0,4270 % Deutsche Postbank Funding Trust III 05/und. pref. (DE000A0D24Z1)	EUR	5 000		1 000	% 69,4980	3 474 900,00	1,07
1,1900 % DZ Bank Capital Funding Trust II 04/und. (DE000A0DCXA0)	EUR	2 000			% 94,2605	1 885 210,00	0,58
0,2810 % ING Groep 03/und. (NL0000113587)	EUR	1 000			% 68,8750	688 750,00	0,21
0,0000 % ING Groep 04/und. (NL0000116127)	EUR	1 500			% 66,3510	995 265,00	0,31
0,1930 % NIBC Bank 06/Und. (XS0249580357)	EUR	1 500			% 62,2680	934 020,00	0,29
0,1810 % RZB Finance (Jersey) III 04/und. (XS0193631040)	EUR	5 100		1 000	% 81,6985	4 166 623,50	1,28
2,1917 % American International Group 07/15.03.67 MTN (XS0291641420)	GBP	1 500	1 500		% 86,1910	1 449 725,27	0,44
1,4250 % AEGON 96/und. (NL0000121416)	NLG	3 500		3 000	% 78,5000	1 246 761,14	0,38
1,1470 % BNP Paribas 86/und (FR0008131403)	USD	2 000			% 62,1345	1 131 879,04	0,35
2,0000 % CW Bank of Australia 86/und. (GB0008424284)	USD	4 000			% 84,2220	3 068 476,18	0,94
2,0000 % Hongkong & Shanghai Banking 86/und. S.3 (GB0004355490)	USD	2 000			% 65,9190	1 200 819,75	0,37
2,3750 % HSBC Bank 85/und. (XS0015190423)	USD	1 000			% 66,8235	608 648,33	0,19
1,6905 % Lloyds Bank 86/und. S.3 (GB0005232391)	USD	2 000		1 850	% 77,4380	1 410 656,71	0,43
1,8633 % Natinoal Westminster Bank 1985/und. S.C (LU0001547172)	USD	3 000			% 76,7290	2 096 611,71	0,64
2,0875 % National Australia Bank 86/und. (GB0006241326)	USD	1 500			% 92,7730	1 267 506,15	0,39
1,9819 % Société Générale 86/und. (FR0008202550)	USD	1 000			% 67,5985	615 707,26	0,19
Zertifikate							
DB ETC/Gold Euro Hedged 15.06.60 ETC (DE000A1EK0G3)	Stück	200 000	50 000		EUR 106,1600	21 232 000,00	6,51
Soc. Generale/Equity Basket 23.12.22 TrackerCert. (DE000SG2CLQ6)	Stück	75 000	75 000		EUR 90,2000	6 765 000,00	2,07
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						5 907 844,15	1,81
Verzinsliche Wertpapiere							
0,1250 % US Treasury 17/15.02.22 INFL (US912828X398)	USD	700	700		% 98,8377	668 370,98	0,20
Verbriefte Geldmarktinstrumente							
2,8457 % Crédit Agricole 07/und. Reg S (USF22797FJ25)	USD	2 600			% 85,4776	2 024 244,10	0,62
2,7413 % HSB Group 97/15.07.27 (US40428NAC39)	USD	4 000		1 000	% 88,2500	3 215 229,07	0,99
Nicht notierte Wertpapiere						5 853 720,55	1,80
Aktien							
Alussa Energy Acquisition (KYG0232J1013)	Stück	246 478	246 478		USD 9,7000	2 177 645,14	0,67
Gores Holdings IV Unit (US3828652020)	Stück	67 022	67 022		USD 9,9500	607 404,04	0,19
Oaktree Acquisition Corp (KYG671451055)	Stück	74 074	74 074		USD 9,9000	667 941,16	0,20
Replay Acquisition (KYG751301071)	Stück	269 230			USD 9,7900	2 400 730,21	0,74

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
Investmentanteile						21 152 940,00	6,48	
Gruppeneigene Investmentanteile (inkl. KVG-eigene Investmentanteile)						12 914 540,00	3,96	
Xtrackers II iBoxx Eurz. Gov.Bd Y.Pl. UCITS								
ETF 1D (LU0962071741) (0,050%)	Stück	34 000			EUR	173,3100	1,81	
Xtrackers II USD EM Bond UCITS ETF 1C - EUR								
Hed. (LU0321462953) (0,300%)	Stück	25 000	15 000		EUR	280,8800	2,15	
Gruppenfremde Investmentanteile						8 238 400,00	2,52	
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF USD Acc. (IE00BKM4GZ66) ³⁾ (0,180%)	Stück	400 000		400 000	EUR	20,5960	2,52	
Summe Wertpapiervermögen						298 861 895,88	91,60	
Derivate								
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen								
Derivate auf einzelne Wertpapiere						-1 070 696,22	-0,33	
Wertpapier-Optionsrechte (Forderungen / Verbindlichkeiten)								
Optionsrechte auf Aktien								
Put Anheuser-Busch InBev 06/2020 Strike 60,00 (EURX)	Stück	-12 000			EUR	21,6750	-260 100,00	-0,08
Put Carl Zeiss Meditec 06/2020 Strike 100,00 (EURX)	Stück	-20 000			EUR	13,2500	-265 000,00	-0,08
Put Covestro 06/2020 Strike 38,00 (EURX)	Stück	-35 000			EUR	11,0250	-385 875,00	-0,12
Put LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton (C.R.) 04/2020 Strike 385,00 (EURX)	Stück	-5 100			EUR	42,9500	-219 045,00	-0,07
Put Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft Vink.Reg. 12/2020 Strike 120,00 (EURX)	Stück	-35 000			EUR	6,5500	-229 250,00	-0,07
Put Reckitt Benckiser Group 05/2020 Strike 60,00 (IPE)	Stück	-26 000			GBP	2,8550	-83 236,15	-0,03
Put Barrick Gold 06/2020 Strike 17,00 (USS)	Stück	-127 700			USD	1,2500	-145 391,20	-0,04
Put Freeport-McMoRan B 04/2020 Strike 11,00 (USS)	Stück	-147 500			USD	4,8000	-644 867,47	-0,20
Put PayPal Holdings 06/2020 Strike 110,00 (USS)	Stück	-10 000			USD	15,7500	-143 455,69	-0,04
Wertpapier-Optionsscheine								
Optionsscheine auf Aktien								
Alussa Energy Acquisition 31.10.26 (KYG0232J1195)	Stück	123 239	123 239		USD	0,7163	80 404,50	0,02
Chp Merg.Corp. Wts24 (US12558Y1148)	Stück	140 845	140 846	1	USD	0,7000	89 800,07	0,03
Crescent Acquis. Wts24 (US22564L1136)	Stück	250 000			USD	0,8000	182 165,95	0,06
DiamondPeak Holding Corp Wts (US25280H1187)	Stück	96 970			USD	0,4000	35 329,26	0,01
Experience Investment 01.09.26 (US30217C1172)	Stück	125 786	125 786		USD	0,7300	83 635,83	0,03
Far Point Acquisition Wts (US30734W1172)	Stück	28 248			USD	0,4700	12 092,69	0,00
Gores Metropoulos WRT 28.01.26 (US3828721171)	Stück	51 282			USD	0,6500	30 360,96	0,01
Hennessy Cap.Acq. Wts25 (US42589C1128)	Stück	195 895			USD	0,3900	69 586,53	0,02
Leisure Acquisition 28.12.22 (US52539T1152)	Stück	250 000			USD	0,1700	38 710,27	0,01
New Providence Acquisition 01.09.24 (US64822P1140)	Stück	57 692	57 693	1	USD	0,5000	26 273,80	0,01
Osprey Technology Acquisition 30.10.24 (US68839R1207)	Stück	123 239	123 239		USD	0,5208	58 459,67	0,02
PAE 11.09.23 (US69290Y1174)	Stück	69 444	69 444		USD	1,0100	63 884,18	0,02
Pure Acquisition 17.04.23 (US74621Q1141)	Stück	125 000			USD	0,9900	112 715,18	0,03
Qaktree Acquisition Corp 09.09.24 (KYG671451139)	Stück	24 691	24 691		USD	0,8772	19 727,62	0,01
Repay Holdings Corp 17.07.22 (US76029L1180)	Stück	168 983		50 000	USD	1,1700	180 080,25	0,06
Replay Acquisition 08.04.24 (KYG751301154)	Stück	134 615			USD	0,2100	25 748,38	0,01
RMG Acquisition Corp Wts (US7496411148)	Stück	89 743			USD	0,6200	50 679,17	0,02
Silver Spike Acquisition 31.12.24 (KYG8136L1142)	Stück	153 846	153 846		USD	0,2115	29 636,97	0,01
Thunder Bird Acq.II Wts26 (KYG8857S1084)	Stück	196 629	196 629		USD	0,6490	116 233,01	0,04
Aktienindex-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						-712 632,27	-0,22	
Aktienindex-Terminkontrakte								
DAX INDEX JUN 20 (EURX) EUR	Stück	-425				-474 725,00	-0,15	
NASDAQ 100 E-MINI JUN 20 (CME) USD	Stück	-320				-237 907,27	-0,07	

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						79 598,58	0,03
Zinsterminkontrakte							
EURO-BOBL JUN 20 (EURX)	EUR	-7 500				34 500,00	0,01
EURO-BUND JUN 20 (EURX)	EUR	-8 000				97 600,00	0,04
US 10YR NOTE JUN 20 (CBT)	USD	5 800				-52 501,42	-0,02
Devisen-Derivate						-3 299 967,73	-1,01
Devisentermingeschäfte							
EUR/USD FUTURE (CME) JUN 20	USD	86 875				-2 705 187,73	-0,83
Optionsrechte							
Optionsrechte auf Devisen							
Call EUR/AUD (HSB) 04.06.20 Strike 1,72 (OTC)	Stück	-2 000 000			EUR 0,0466	-93 106,00	-0,03
Call EUR/NOK (JPM) 28.04.20 Strike 10,3 (OTC)	Stück	-4 000 000			EUR 0,1073	-429 040,00	-0,13
Call EUR/NZD (DBK) 04.06.20 Strike 1,80 (OTC)	Stück	-2 000 000			EUR 0,0363	-72 634,00	-0,02
Bankguthaben und nicht verbriefte Geldmarktinstrumente						32 179 709,84	9,86
Bankguthaben						32 179 709,84	9,86
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	8 416 188,10			% 100	8 416 188,10	2,58
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR	16 379,13			% 100	16 379,13	0,01
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							
Australische Dollar	AUD	4,72			% 100	2,64	0,00
Kanadische Dollar	CAD	114,18			% 100	73,27	0,00
Schweizer Franken	CHF	2 245,21			% 100	2 120,92	0,00
Chinesische Renminbi/Yuan	CNY	4 060,21			% 100	521,33	0,00
Britische Pfund	GBP	38 583,30			% 100	43 264,52	0,01
Hongkong Dollar	HKD	88 526,36			% 100	10 400,06	0,00
Japanische Yen	JPY	600,00			% 100	5,04	0,00
Mexikanische Peso	MXN	991,23			% 100	37,75	0,00
Russische Rubel	RUB	1 294,00			% 100	15,01	0,00
US Dollar	USD	9 315 071,86			% 100	8 484 444,72	2,60
Südafrikanische Rand	ZAR	6,73			% 100	0,34	0,00
Termingeld							
GBP - Guthaben (Landesbank Baden- Württemberg, Stuttgart)	GBP	1 700 000,00			% 100	1 906 257,01	0,58
EUR - Guthaben (DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt am Main)	EUR	13 300 000,00			% 100	13 300 000,00	4,08
Sonstige Vermögensgegenstände						585 016,93	0,18
Zinsansprüche	EUR	503 762,83			% 100	503 762,83	0,15
Dividenden-/Ausschüttungsansprüche	EUR	49 324,06			% 100	49 324,06	0,02
Quellensteueransprüche	EUR	21 786,40			% 100	21 786,40	0,01
Sonstige Ansprüche	EUR	10 143,64			% 100	10 143,64	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten						-359 782,08	-0,11
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-356 434,67			% 100	-356 434,67	-0,11
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-3 347,41			% 100	-3 347,41	0,00
Fondsvermögen						326 263 142,93	100,00
Anteilwert						12 136,88	
Umlaufende Anteile						26 881,961	

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

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX	=	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
IPE	=	ICE Futures Europe
USS	=	American Stock Options Exchange
CME	=	Chicago Mercantile Exchange (CME) - Index and Options Market Division (IOM)
CBT	=	Chicago Board of Trade (CBOT)
OTC	=	Over the counter

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 31.03.2020

Australische Dollar	AUD	1,786250	=	EUR	1
Kanadische Dollar	CAD	1,558250	=	EUR	1
Schweizer Franken	CHF	1,058600	=	EUR	1
Chinesische Renminbi/Yuan	CNY	7,788250	=	EUR	1
Dänische Kronen	DKK	7,468000	=	EUR	1
Britische Pfund	GBP	0,891800	=	EUR	1
Hongkong Dollar	HKD	8,512100	=	EUR	1
Italienische Lira	ITL	1936,270000	=	EUR	1
Japanische Yen	JPY	119,140000	=	EUR	1
Mexikanische Peso	MXN	26,260650	=	EUR	1
Niederländische Gulden	NLG	2,203710	=	EUR	1
Norwegische Kronen	NOK	11,517850	=	EUR	1
Russische Rubel	RUB	86,198850	=	EUR	1
US Dollar	USD	1,097900	=	EUR	1
Südafrikanische Rand	ZAR	19,739250	=	EUR	1

Fußnoten

3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 14.330.556,23.

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				Nutrien (CA67077M1086) Stück 67 000			
Aktien				Osprey Technology Acquisition Units (US68839R4011) Stück 246 478 246 478			
The Swatch Group (CH0012255151)	Stück		18 200	Pure Acquisition Cl.A (US74621Q1067)	Stück		250 000
Godewind Immobilien Reg. (DE000A2G8XX3)	Stück		1 037 380	Silver Spike Aquisition (KYG8136L1225)	Stück		307 692
ING Groep (NL0011821202)	Stück	100 000	250 000	United Technologies Corp. (US9130171096)	Stück		46 900
Nexi (IT0005366767)	Stück		304 132	Verzinsliche Wertpapiere			
OSRAM Licht (DE000LED4000)	Stück	200 000	400 000	0,0000 % Apple 19/15.11.25 (XS2079716853)	EUR	990	990
PNE Reg. (DE000A0JBPG2)	Stück		676 689	2,1240 % Assicurazioni Generali 19/01.10.30 MTN (XS2056491587)	EUR		310
TUI Reg. (DE000TUAG000)	Stück		50 000	0,5000 % Austria 19/20.02.29 (AT0000A269M8)	EUR		1 000
Tullow Oil (GB0001500809)	Stück		1 146 334	0,6320 % Becton, Dickinson & Co 19/04.06.23 (XS2002532567)	EUR		500
Allegro Merger (US01749N1037)	Stück		347 826	0,7500 % BMW Finance 17/12.07.24 MTN (XS1548436473)	EUR		1 000
Alussa Energy Acquisiton (KYG0232J1278)	Stück	246 478	246 478	0,1250 % China 19/12.11.26 (XS2078532913)	EUR	1 480	1 480
CHP Merger Corp (US12558Y2054)	Stück	281 691	281 691	1,6000 % Deutsche Bahn Finance 19/und. (XS2010039548)	EUR	600	600
Cisco Systems (US17275R1023)	Stück		110 000	0,6250 % Grenke Finance 19/09.01.25 MTN (XS2078696866)	EUR	820	820
Diamond Eagle Acquisition Unit (US25258L2088)	Stück		151 516	4,0000 % Otto 18/Und. (XS1853998182)	EUR		1 000
Electronic Arts (US2855121099)	Stück		50 000	0,7500 % Telenor 19/31.05.26 MTN (XS2001737324)	EUR		530
Experience Investment (US30217C2089)	Stück		377 358	1,0000 % TenneT Holding 16/13.06.26 MTN (XS1432384664)	EUR		1 000
Far Point Acquisition (US30734W1099)	Stück		84 746	2,7500 % ZF North America Capital 15/27.04.23 (DE000A14J7G6)	EUR		500
Gilead Sciences (US3755581036)	Stück		35 000				
Gores Holdings III (US38286G1094)	Stück		208 333				
GS Acquisition Holdings (US36255F2011)	Stück		40 000				
Leisure Acquisition (US52539T1079)	Stück		500 000				
New Providence Acquisition Corp Unit (US64822P2056)	Stück		115 385				

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
Verbriefte Geldmarktinstrumente			
1,7870 % HT1 Funding 06/und. (DE000A0KAAA7)	EUR		2 000
8,1250 % UniCredit International Bank (Lux) 09/und. Pref. (XS0470937243)	EUR		1 000
0,0000 % Norway 19/18.03.20 S.46 (NO0010847106)	NOK	40 000	40 000
Nicht notierte Wertpapiere			
Aktien			
Osram Licht (DE000LED01V2)	Stück	200 000	200 000
Oaktree Acquisition Corp Unit (KYG671451212)	Stück		74 074
Thunder Bridge Acquisition Unit (KYG8857S1241)	Stück		393 258
Investmentanteile			
Gruppeneigene Investmentanteile (inkl. KVG-eigene Investmentanteile)			
Xtrackers MSCI Europe UCITS ETF 1D (LU1242369327) (0,150%)	Stück	104 000	104 000
Gruppenfremde Investmentanteile			
iShares V-MSCI Japan € Hed. UCITS ETF Acc.S.M.€ Hd. (IE00B42Z5J44) (0,640%)	Stück		178 000

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

	Zugänge	Abgänge
Optionsscheine		
Wertpapier-Optionsscheine		
Optionsscheine auf Aktien		
Adapthealth Corp 03.04.23 (US00653Q1105)	Stück	25 672
Allegro Merger 06.01.25 (US01749N1110)	Stück	347 826
DFB Healthcare Acquisition 03.04.23 (US23291E1174)	Stück	138 889
Gores Holdings III Wts (US38286G1177)	Stück	69 444
Nesco Holdings 01.01.25 (US64083J1126)	Stück	100 666
Ranpak Holdings Corporation 22.02.23 (US75321W1119)	Stück	100 000
Target Hospitality WTS 15.03.24 (US87615L1153)	Stück	85 134
		Volumen in 1000
Terminkontrakte		
Aktienindex-Terminkontrakte		
Verkaufte Kontrakte: (Basiswerte: DAX (Performanceindex), Nasdaq 100 Index)	EUR	30 799
Zinsterminkontrakte		
Verkaufte Kontrakte: (Basiswerte: EURO-BOBL MAR 20, EURO-BUND MAR 20)	EUR	24 559
Devisenterminkontrakte		
Kauf von Devisen auf Termin	EUR	1 000

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

	Volumen in 1000
Devisentermingeschäfte	
Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: EUR/USD FUTURE (CME) DEC 19, EUR/USD FUTURE (CME) MAR 20)	EUR 119 176
Optionsrechte	
Wertpapier-Optionsrechte	
Optionsrechte auf Aktien	
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswerte: Allianz, Covestro, Gilead Sciences, Total)	EUR 6 406
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: Barrick Gold, Boeing Co., Equinor, Linde, Total, TUI Reg., Verbund AG, Wacker Chemie, Wirecard AG)	EUR 13 044
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate	
Optionsrechte auf Aktienindices	
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: DAX (Performanceindex))	EUR 16 875
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: DAX (Performanceindex), Hang Seng Index)	EUR 11 125

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

	Volumen in 1000
unbefristet	EUR 66 208
Gattung: iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF USD Acc. (IE00BKM4GZ66), iShares V-MSCI Japan € Hed. UCITS ETF Acc.S.M.€ Hd. (IE00B42Z5J44), Xtrackers II iBoxx Eurz. Gov.Bd Y.PI. UCITS ETF 1D (LU0962071741), Xtrackers II USD EM Bond UCITS ETF 1C - EUR Hed. (LU0321462953), Xtrackers MSCI Europe UCITS ETF 1D (LU1242369327), 0,1250 % African Development Bank 16/07.10.26 MTN (XS1501560848), 0,0000 % Apple 19/15.11.25 (XS2079716853), 0,5000 % Austria 19/20.02.29 (AT0000A269M8), 0,4500 % AXA 03/und. MTN (XS0179060974), 0,3000 % DekaBank DGZ 19/20.11.26 MTN (XS2082333787), 0,2810 % ING Groep 03/und. (NL0000113587), 0,8750 % NIBC Bank 19/08.07.2025 MTN (XS2023631489), 4,0000 % Otto 18/Und. (XS1853998182), 0,8750 % TenneT Holding 19/03.06.30 MTN (XS2002491780), 2,1250 % UniCredit 16/24.10.26 MTN (XS1508450688), 0,5000 % UniCredit 19/09.04.25 MTN (XS2063547041), 0,3750 % Volkswagen Bank 19/05.07.22 MTN (XS2023306140), 1,5000 % Volkswagen Financial Service 19/01.10.24 MTN (XS1972548231), 0,3750 % Westpac Banking 19/02.04.26 MTN (XS1978200472), 5,5000 % AXA 13/und. MTN (XS0876682666), 1,1470 % BNP Paribas 86/und (FR0008131403), 2,0000 % Hongkong & Shanghai Banking 86/und. S.3 (GB0004355490), 2,3750 % HSBC Bank 85/und. (XS0015190423), 4,7500 % ZF North America Capital 15/29.04.25 Reg S (USU98737AC03)	

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

Anhang gemäß § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert: EUR 12 136,88

Umlaufende Anteile: 26 881,961

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände:

Die Bewertung erfolgt durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft stützt sich hierbei grundsätzlich auf externe Quellen.

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

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

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

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

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

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
Angaben in Fondswährung			
1. Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	14 330 556,23	-	-
in % des Fondsvermögens	4,39	-	-
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name	UniCredit Bank AG		
Bruttovolumen offene Geschäfte	8 238 400,00		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
2. Name	BNP Paribas S.A. Arbitrage, Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	2 427 790,28		
Sitzstaat	Frankreich		
3. Name	Deutsche Bank AG, Frankfurt		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1 352 428,00		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
4. Name	J.P. Morgan Securities PLC		
Bruttovolumen offene Geschäfte	868 471,63		
Sitzstaat	Großbritannien		
5. Name	Barclays Bank PLC, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	806 515,00		
Sitzstaat	Großbritannien		
6. Name	Goldman Sachs International		
Bruttovolumen offene Geschäfte	260 083,22		
Sitzstaat	Großbritannien		
7. Name	Crédit Suisse Securities (Europe) Ltd.		
Bruttovolumen offene Geschäfte	202 880,60		
Sitzstaat	Großbritannien		
8. Name	BNP Paribas S.A., Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	173 987,50		
Sitzstaat	Frankreich		
9. Name			
Bruttovolumen offene Geschäfte			
Sitzstaat			

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

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	14 330 556,23	-	-

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

Art(en):			
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	10 966 039,38	-	-
Aktien	4 085 003,12	-	-
Sonstige	81 446,35	-	-

Qualität(en):

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

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

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

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

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

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

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

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

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Wahrung(en):	USD; GBP; EUR; CAD; JPY; CHF; NZD; 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	15 132 488,85	-	-
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	31 130,46	-	-
in % der Bruttoertrage	67,00	-	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	-
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	15 332,59	-	-
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	14 330 556,23		
Anteil	4,77		
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)	8 010 021,50		
2. Name	Finnvera PLC		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1 505 951,11		

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

3. Name	Landeskreditbank Baden-Württemberg - Förderbank		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	811 161,76		
4. Name	European Investment Bank (EIB)		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	246 412,76		
5. Name	Pharming Group N.V.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	232 702,90		
6. Name	Bureau Veritas SA		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	232 692,82		
7. Name	Worthington Industries Inc.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	232 691,63		
8. Name	Traton SE		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	232 685,20		
9. Name	Smart Global Holdings Inc.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	232 673,92		
10. Name	Yamaha Motor Co. Ltd.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	232 647,76		

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

Anteil	-
---------------	---

13. Verwahrart begebener Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps (In % aller begebenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps)

gesonderte Konten / Depots	-	-
Sammelkonten / Depots	-	-
andere Konten / Depots	-	-
Verwahrart bestimmt Empfänger	-	-

FOS Strategie-Fonds Nr. 1

14. Verwahrer/Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps		
Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	3	-
1. Name	State Street Bank International GmbH (Custody Oper	
verwahrter Betrag absolut	8 613 479,90	
2. Name	Bank of New York	
verwahrter Betrag absolut	4 581 717,95	
3. Name	State Street Bank	
verwahrter Betrag absolut	1 937 291,00	

Kapitalverwaltungsgesellschaft

DWS Investment GmbH
60612 Frankfurt
Eigenmittel am 31.12.2019: 289,2 Mio. Euro
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital
am 31.12.2019: 115 Mio. Euro

Aufsichtsrat

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

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

Hans-Theo Franken
Deutsche Vermögensberatung AG,
Frankfurt am Main

Dr. Alexander Ilgen
Deutsche Bank AG,
Frankfurt am Main

Dr. Stefan Marcinowski
Ludwigshafen

Prof. Christian Strenger
Frankfurt am Main

Gerhard Wiesheu
Teilhaber des Bankhauses
B. Metzler seel. Sohn & Co. KGaA,
Frankfurt am Main

Susanne Zeidler
DWS Beteiligungs GmbH,
Frankfurt am Main

Geschäftsführung

Manfred Bauer (seit dem 2.12.2019)
Sprecher der Geschäftsführung
(seit dem 1.1.2020)

Vorsitzender des Vorstandes der
DWS Investment S.A.,
Luxemburg
Mitglied der Geschäftsführung der
DWS Beteiligungs GmbH,
Frankfurt am Main
Vorsitzender des Verwaltungsrates der
DWS CH AG,
Zürich

Dirk Görgen

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

Stefan Kreuzkamp

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

Dr. Matthias Liermann

Mitglied der Geschäftsführung der
DWS International GmbH,
Frankfurt am Main
Mitglied der Geschäftsführung der
DWS Beteiligungs GmbH,
Frankfurt am Main
Mitglied des Aufsichtsrates der
DWS Investment S.A.,
Luxemburg
Mitglied des Aufsichtsrates der
Deutsche Treuinvest Stiftung,
Frankfurt am Main

Holger Naumann (bis zum 31.12.2019)
Frankfurt am Main

Petra Pflaum

Mitglied der Geschäftsführung der
DWS Beteiligungs GmbH,
Frankfurt am Main

Verwahrstelle

State Street Bank International GmbH
Briener Straße 59
80333 München
Eigenmittel am 31.12.2019:
2.207,5 Mio. Euro
(im Sinne von Artikel 72 der Verordnung
(EU) Nr. 575/2013 (CRR))
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital am
31.12.2019: 109,4 Mio. Euro

**Gesellschafter der
DWS Investment GmbH**

DWS Beteiligungs GmbH,
Frankfurt am Main



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