

DWS Investment GmbH

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Halbjahresbericht 2021



FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Inhalt

Halbjahresbericht 2021
vom 1.1.2021 bis 30.6.2021 (gemäß § 103 KAGB)

Hinweise	2
Hinweise für Anleger in Luxemburg	4
Halbjahresbericht FOS Rendite und Nachhaltigkeit	6

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 30. Juni 2021** 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. Die dynamische Ausbreitung des Virus schlug sich mitunter in erheblichen Marktverwerfungen bei zugleich deutlich gestiegenen Volatilitäten nieder. Beschränkungen der Bewegungsfreiheit, wiederholte Lockdown-Maßnahmen, Produktionsstopps sowie unterbrochene Lieferketten üben großen Druck auf nachgelagerte wirtschaftliche Prozesse aus, so dass sich die weltweiten Konjunkturperspektiven erheblich eintrübten. Auch wenn an den Märkten zwischenzeitlich – u.a. durch Hilfsprogramme im Rahmen der Geld- und Fiskalpolitik sowie umfassende Impfkampagnen – wieder schrittweise Erholungen bzw. die Rückkehr zu einer gewissen „Normalität“ zu beobachten waren, sind die konkreten bzw. möglichen mittel- bis langfristigen Auswirkungen der Krise auf die Konjunktur, einzelne Märkte und Branchen ebenso wie die sozialen Implikationen vor dem Hintergrund der Dynamik der globalen Ausbreitung des Virus und des damit einhergehenden hohen Grads an Unsicherheit zum Zeitpunkt der Aufstellung des vorliegenden Berichts nicht verlässlich beurteilbar und lediglich unzureichend prognostizierbar; somit kann es weiterhin zu einer wesentlichen Beeinflussung des jeweiligen Sondervermögens kommen. Ein hohes Maß an Unsicherheit besteht hinsichtlich der finanziellen Auswirkungen der Pandemie, da diese von externen Faktoren wie etwa der Verbreitung bzw. auftretenden Mutationen des Virus und den von den einzelnen Regierungen und Zentralbanken ergriffenen Maßnahmen, der erfolgreichen Eindämmung der Entwicklung der Infektionsraten und dem zügigen und nachhaltigen Wiederanlaufen der Konjunktur abhängig sind.

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft des Sondervermögens setzt deshalb ihre Bemühungen im Rahmen ihres Risikomanagements fort, um diese Unsicherheiten bewerten und ihren möglichen Auswirkungen auf die Aktivitäten, die Liquidität und die Wertentwicklung des Sondervermögens begegnen zu können. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft ergreift alle als angemessen erachteten Maßnahmen, um die Anlegerinteressen bestmöglich zu schützen. In Abstimmung mit den Dienstleistern hat die Kapitalverwaltungsgesellschaft die Folgen der Coronakrise beobachtet und deren Auswirkungen auf das Sondervermögen und die Märkte, in denen dieses investiert, angemessen in ihre Entscheidungsfindung einbezogen. Zum Datum des vorliegenden Berichts wurden dem Sondervermögen gegenüber keine bedeutenden Rücknahmeanträge gestellt; Auswirkungen auf dessen Anteilscheingeschäft werden von der Kapitalverwaltungsgesellschaft kontinuierlich überwacht; die Leistungsfähigkeit der wichtigsten Dienstleister hat keine wesentlichen Beeinträchtigungen erfahren. In diesem Zusammenhang hat sich die Kapitalverwaltungsgesellschaft des Sondervermögens im Einklang mit zahlreichen nationalen Leitlinien nach Gesprächen mit den wichtigsten Dienstleistern (insbesondere hinsichtlich Verwahrstelle, Portfoliomanagement und Fondsadministration) davon überzeugt, dass die getroffenen Maßnahmen und Pläne zur Sicherstellung der Fortführung des Geschäftsbetriebs (u.a. umfangreiche Hygienemaßnahmen in den Räumlichkeiten, Einschränkungen bei Geschäftsreisen und Veranstaltungen, Vorkehrungen zur Gewährleistung eines verlässlichen und reibungslosen Ablaufs der Geschäftsprozesse bei Verdachtsfall auf eine Coronavirus-Infektion, Ausweitung der technischen Möglichkeiten zum mobilen Arbeiten) die derzeit absehbaren bzw. laufenden operativen Risiken eindämmen und gewährleisten, dass die Tätigkeiten des Sondervermögens nicht unterbrochen werden.

Zum Zeitpunkt der Aufstellung des vorliegenden Berichts liegen nach Auffassung der Kapitalverwaltungsgesellschaft weder Anzeichen vor, die gegen die Fortführung des Sondervermögens sprechen, noch ergaben sich für das Sondervermögen Liquiditätsprobleme.

Hinweise für Anleger in Luxemburg

Zahl- und Vertriebsstelle in Luxemburg ist die

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

Bei dieser Stelle können

- die Rücknahme der Anteile durchgeführt bzw. Rücknahmeanträge eingereicht werden,
- die Anleger kostenlos sämtliche Informationen, wie Verkaufsprospekte samt Anlagebedingungen, „Wesentliche Anlegerinformationen“, Jahres- und Halbjahresberichte sowie die Ausgabe- und Rücknahmepreise erhalten und sonstige Angaben und Unterlagen erfragen bzw. einsehen einsehen; zudem sind diese Dokumente über die Internetseite www.dws.com erhältlich,
- Zahlungen an die Anteilhaber weitergeleitet werden.

Darüber hinaus sind Jahres- und Halbjahresberichte in elektronischer Form über www.bundesanzeiger.de erhältlich.

Halbjahresbericht

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

FOS RENDITE UND NACHHALTIGKEIT

Wertentwicklung der Anteilsklassen (in Euro)

Anteilklasse	ISIN	6 Monate
Klasse A	DE000DWSOXF8	4,3%
Klasse B	DE000DWS2S93	4,3%

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

Stand: 30.6.2021

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Vermögensübersicht zum 30.06.2021

	Bestand in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien (Branchen):		
Informationstechnologie	46 566 374,39	4,88
Gesundheitswesen	34 807 972,68	3,65
Grundstoffe	32 914 981,92	3,45
Industrien	30 186 538,77	3,17
Versorger	21 234 391,58	2,23
Finanzsektor	20 959 088,61	2,20
Dauerhafte Konsumgüter	14 924 719,54	1,57
Hauptverbrauchsgüter	14 416 021,94	1,51
Energie	9 200 105,05	0,97
Sonstige	30 046 512,19	3,15
Summe Aktien:	255 256 706,67	26,78
2. Anleihen (Emittenten):		
Institute	259 695 517,74	27,24
Sonst. Finanzierungsinstitutionen	178 864 075,56	18,76
Unternehmen	69 680 111,29	7,31
Zentralregierungen	67 503 785,37	7,08
Sonstige öffentliche Stellen	16 810 967,00	1,76
Summe Anleihen:	592 554 456,96	62,15
3. Zertifikate	10 250 000,00	1,08
4. Investmentanteile	73 196 751,66	7,68
5. Derivate	-1 907 869,10	-0,20
6. Bankguthaben	25 390 040,46	2,66
7. Sonstige Vermögensgegenstände	1 567 877,83	0,17
II. Verbindlichkeiten		
1. Sonstige Verbindlichkeiten	-3 026 225,16	-0,32
III. Fondsvermögen	953 281 739,32	100,00

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

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Vermögensaufstellung zum 30.06.2021

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						846 268 713,39	88,77
Aktien							
Geberit Reg. Disp. (CH0030170408) (N)	Stück	11 400			CHF 701,6000	7 290 679,55	0,76
Swiss Re Reg. (CH0126881561) (N)	Stück	25 000			CHF 83,6400	1 906 020,69	0,20
Coloplast B (DK0060448595) (N)	Stück	27 000		13 000	DKK 1 049,5000	3 810 538,77	0,40
Novo-Nordisk B (DK0060534915) (N)	Stück	100 000		64 000	DKK 529,8000	7 124 462,94	0,75
Orsted (DK0060094928) (N)	Stück	27 300	27 300		DKK 879,6000	3 229 148,71	0,34
Allianz (DE0008404005) ⁶⁾ (N)	Stück	17 000			EUR 210,3500	3 575 950,00	0,38
alstria office REIT (DE000A0LD2U1) (N)	Stück	525 000		135 000	EUR 15,6300	8 205 750,00	0,86
ASML Holding (NL0010273215) (N)	Stück	6 780	3 000	3 000	EUR 581,7000	3 943 926,00	0,41
Aurubis (DE0006766504) ⁶⁾ (N)	Stück	90 000		25 060	EUR 77,6000	6 984 000,00	0,73
BEFESA (LU1704650164) (N)	Stück	60 000			EUR 65,0000	3 900 000,00	0,41
BMW Ord. (DE0005190003) (N)	Stück	40 000		10 000	EUR 89,7400	3 589 600,00	0,38
Compagnie de Saint-Gobain (C.R.) (FR0000125007) (N)	Stück	50 000			EUR 55,6000	2 780 000,00	0,29
Covestro (DE0006062144) (N)	Stück	80 000		40 000	EUR 54,5000	4 360 000,00	0,46
Credit Agricole (FR0000045072) (N)	Stück	320 000			EUR 11,8260	3 784 320,00	0,40
CRH (IE0001827041) (N)	Stück	200 000			EUR 42,9200	8 584 000,00	0,90
Dassault Systemes (FR0000130650) (N)	Stück	12 300			EUR 205,5000	2 527 650,00	0,27
Deutsche Post Reg. (DE0005552004) (N)	Stück	135 000			EUR 57,7700	7 798 950,00	0,82
ENCAVIS (DE0006095003) (N)	Stück	546 000		65 000	EUR 15,8800	8 670 480,00	0,91
ESG Core Investments (NL0015000603)	Stück	500 000	500 000		EUR 9,5300	4 765 000,00	0,50
Infineon Technologies Reg. (DE0006231004) (N)	Stück	150 000		70 000	EUR 33,9700	5 095 500,00	0,53
Kering (FR0000121485) (N)	Stück	6 070	3 000		EUR 743,5000	4 513 045,00	0,47
L'Oreal (FR0000120321) (N)	Stück	15 700			EUR 378,1000	5 936 170,00	0,62
Merck (DE0006599905) (N)	Stück	54 000		33 300	EUR 161,8500	8 739 900,00	0,92
MorphoSys (DE0006632003) (N)	Stück	56 500	12 500		EUR 65,9800	3 727 870,00	0,39
Neste Oyj (FI0009013296) (N)	Stück	75 000	25 000		EUR 52,0800	3 906 000,00	0,41
OboTech Acquisition Cl.A (LU2334363566)	Stück	930 000	930 000		EUR 9,7850	9 100 050,00	0,95
Pacifico Renewables Yield (DE000A2YN371)	Stück	20 090	2 940		EUR 36,9000	741 321,00	0,08
Teamviewer (DE000A2YN900) (N)	Stück	90 000	50 000		EUR 32,0300	2 882 700,00	0,30
Verbund AG (AT0000746409) (N)	Stück	61 000		19 000	EUR 77,3500	4 718 350,00	0,49
Wacker Chemie (DE000WCH8881) (N)	Stück	20 000	10 000	13 400	EUR 130,3500	2 607 000,00	0,27
Legal & General Group (GB0005603997) (N)	Stück	1 835 000			GBP 2,5810	5 512 582,20	0,58
Equinor (NO0010096985) (N)	Stück	296 800			NOK 181,8600	5 294 105,05	0,56
Nordea Bank (FI4000297767) (N)	Stück	360 000	360 000		SEK 95,2600	3 387 741,59	0,36
Svenska Cellulosa B (Free) (SE0000112724) (N)	Stück	750 000	250 000	250 000	SEK 140,1000	10 379 981,92	1,09
American Water Works Co. (US0304201033) (N)	Stück	18 500			USD 155,4800	2 419 769,50	0,25
Autodesk (US0527691069) (N)	Stück	10 650			USD 297,7400	2 667 562,04	0,28
Blackrock (US09247X1019) (N)	Stück	3 800	3 800		USD 873,5300	2 792 474,13	0,29
Bristol-Myers Squibb Co. (US1101221083) (N)	Stück	50 000	50 000		USD 66,2700	2 787 498,95	0,29
European Sustainable Growth Acquisition Cl.A (KYG3194F1090)	Stück	480 427	480 427		USD 9,6700	3 908 243,53	0,41
Intel Corp. (US4581401001) (N)	Stück	105 000		50 000	USD 56,7500	5 012 829,14	0,53
Johnson Controls International (IE00BY7QL619) (N)	Stück	26 000	26 000		USD 68,3700	1 495 431,98	0,16
M3-Brigade Acquisition II (US5538001034)	Stück	500 000	500 000		USD 9,6700	4 067 468,66	0,43
Microsoft Corp. (US5949181045) (N)	Stück	47 000		5 000	USD 271,4000	10 730 882,48	1,13
NIKE B (US6541061031) (N)	Stück	52 000	8 000		USD 155,9500	6 822 074,54	0,72
NVIDIA Corp. (US67066G1040) (N)	Stück	8 850			USD 801,0700	5 964 052,75	0,63
Ormat Technologies (US6866881021) (N)	Stück	25 010			USD 69,1700	1 455 322,37	0,15
The Procter & Gamble (US7427181091) ⁵⁾ (N)	Stück	75 000			USD 134,4000	8 479 851,94	0,89
VISA Cl.A (US92826C8394) (N)	Stück	39 000		3 000	USD 235,9500	7 741 271,98	0,81
Xylem (US98419M1009) (N)	Stück	69 000		21 000	USD 119,2400	6 921 477,24	0,73
Verzinsliche Wertpapiere							
0,3750 % Aareal Bank 19/10.04.24 IHS MTN (DE000A2E4CQ2) (N)	EUR	5 000			% 101,5060	5 075 300,00	0,53
1,5000 % Abbott Ireland Financing 18/27.09.26 (XS1883355197) (N)	EUR	5 000			% 107,3450	5 367 250,00	0,56
0,5000 % ABN AMRO Clearing Bank 18/17.07.23 MTN (XS1856791873) (N)	EUR	5 000			% 101,6680	5 083 400,00	0,53
0,1250 % African Development Bank 16/07.10.26 MTN (XS1501560848) (N)	EUR	5 000			% 101,9110	5 095 550,00	0,53
0,0000 % Agence Française de Développement 20/25.03.25 MTN (FR0013483526) (N)	EUR	1 700			% 101,3050	1 722 185,00	0,18
0,2500 % Alstom 19/14.10.26 MTN (FR0013453040) (N)	EUR	3 500			% 100,4800	3 516 800,00	0,37
0,0000 % Alstom 21/11.01.29 (FR0014001EW8) (N)	EUR	2 200	2 200		% 97,1910	2 138 202,00	0,22

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
0,5000 % Apple 19/15.11.31 (XS2079716937) (N)	EUR	2 000			%	101,4210	2 028 420,00	0,21
1,1250 % Banco Santander 20/23.06.27 MTN (XS2194370727) (N)	EUR	3 000			%	104,2530	3 127 590,00	0,33
0,4000 % Baxter International 19/15.05.24 (XS1998215393) (N)	EUR	5 000			%	101,6110	5 080 550,00	0,53
0,1250 % Bayerische Landesbank 21/10.02.28 MTN (DE000BLB6JJ0) (N)	EUR	2 800	2 800		%	98,9120	2 769 536,00	0,29
0,6320 % Becton, Dickinson & Co 19/04.06.23 (XS2002532567) (N)	EUR	3 000		2 000	%	101,4230	3 042 690,00	0,32
1,2500 % Belgium 18/22.04.33 S.86 (BE0000346552) (N)	EUR	2 000			%	112,4700	2 249 400,00	0,24
0,5000 % Berlin Hyp 16/26.09.23 IHS (DE000BHY0GU5) (N)	EUR	9 000			%	101,2940	9 116 460,00	0,96
0,1250 % Berlin Hyp 17/23.10.23 S.201 PF (DE000BHY0GH2) (N)	EUR	3 000			%	101,3790	3 041 370,00	0,32
0,3750 % Berlin Hyp 21/21.04.31 MTN (DE000BHY0SL9) (N)	EUR	8 400	8 400		%	100,0690	8 405 796,00	0,88
0,5000 % BNP Paribas 19/04.06.26 MTN (FR0013465358) (N)	EUR	2 000			%	101,5470	2 030 940,00	0,21
0,3750 % BNP Paribas 20/14.10.27 MTN (FR00140005J1) (N)	EUR	3 000			%	100,1190	3 003 570,00	0,32
0,6250 % BPCE 18/26.09.23 MTN (FR0013367406) (N)	EUR	8 000			%	102,1030	8 168 240,00	0,86
0,0000 % Caisse d'Amort de la Dette Sociale 20/25.02.28 MTN (FR00140002P5) (N)	EUR	5 000			%	100,7800	5 039 000,00	0,53
0,7500 % Caixabank 20/10.07.26 MTN (XS2200150766) (N)	EUR	2 000			%	102,1960	2 043 920,00	0,21
0,3750 % Caixabank 20/18.11.26 MTN (XS2258971071) (N)	EUR	5 000			%	100,1400	5 007 000,00	0,53
0,0000 % Cie Gén. Etablissements Michelin 20/02.11.28 (FR0014000D31) (N)	EUR	1 700			%	98,3560	1 672 052,00	0,18
0,3750 % Credit Agricole London 19/21.10.25 MTN Reg S (XS2067135421) (N)	EUR	2 000			%	101,1730	2 023 460,00	0,21
1,6250 % CRH Funding 20/05.05.30 MTN (XS2169281487) (N)	EUR	2 000			%	109,7445	2 194 890,00	0,23
0,0100 % De Volksbank 19/16.09.24 MTN (XS2052503872) (N)	EUR	2 000			%	100,6590	2 013 180,00	0,21
0,7500 % Deutsche Kreditbank 17/26.09.24 (DE000GRN0016) (N)	EUR	6 000			%	102,6550	6 159 300,00	0,65
0,0100 % Deutsche Kreditbank 21/23.02.26 (DE000GRN0024) (N)	EUR	2 780	2 780		%	99,9910	2 779 749,80	0,29
0,1000 % Deutsche Pfandbriefbank 21/02.02.26 MTN (DE000A3H2X9) (N)	EUR	3 900	3 900		%	99,8570	3 894 423,00	0,41
0,6250 % DNB Boligkredit 18/19.06.25 MTN PF (XS1839888754) (N)	EUR	5 050			%	103,7940	5 241 597,00	0,55
0,5000 % DZ Bank 18/02.10.23 IHS MTN (DE000DDA0NB1) (N)	EUR	4 500			%	101,5635	4 570 357,50	0,48
0,1250 % Estonia 20/10.06.30 (XS2181347183) (N)	EUR	5 000			%	100,2680	5 013 400,00	0,53
0,1500 % EUROFIMA 19/10.10.34 MTN (XS2055744689) (N)	EUR	4 000			%	96,2630	3 850 520,00	0,40
0,5000 % Germany 14/15.04.30 INFL (DE0001030559) (N)	EUR	10 000			%	120,6510	12 979 393,28	1,36
0,1000 % Germany 15/15.04.26 INFL (DE0001030567) (N)	EUR	8 000			%	109,4960	9 398 523,46	0,99
0,5000 % Iceland 17/20.12.22 MTN (XS1738511978) (N)	EUR	5 000			%	100,9690	5 048 450,00	0,53
1,7500 % Intesa Sanpaolo 18/20.03.28 MTN (XS1785340172) (N)	EUR	5 000			%	106,8090	5 340 450,00	0,56
0,7500 % Intesa Sanpaolo 19/04.12.24 MTN (XS2089368596) (N)	EUR	2 000			%	102,5690	2 051 380,00	0,22
2,1250 % Intesa Sanpaolo 20/26.05.25 MTN (XS2179037697) (N)	EUR	7 000			%	107,4010	7 518 070,00	0,79
0,7500 % Intesa Sanpaolo 21/16.03.28 MTN (XS2317069685) (N)	EUR	4 170	4 170		%	100,5310	4 192 142,70	0,44
0,6250 % Intesa Sanpaolo 21/24.02.26 MTN (XS2304664167) (N)	EUR	2 590	2 590		%	99,8980	2 587 358,20	0,27
1,3500 % Ireland 18/18.03.31 (IE00BFZRQ242) (N)	EUR	5 000			%	112,2570	5 612 850,00	0,59
0,8750 % Iren 19/14.10.29 MTN (XS2065601937) (N)	EUR	3 000			%	101,9950	3 059 850,00	0,32
0,2500 % Iren 20/17.01.31 MTN (XS2275029085) (N)	EUR	5 100			%	95,7770	4 884 627,00	0,51
0,5000 % Kellogg 21/20.05.29 (XS2343510520) (N)	EUR	2 280	2 280		%	99,9380	2 278 586,40	0,24
1,3750 % La Banque Postale 19/24.04.29 MTN (FR0013415692) (N)	EUR	5 000			%	106,6170	5 330 850,00	0,56
0,3750 % Latvia 16/07.10.26 MTN (XS1501554874) (N)	EUR	5 000			%	103,2200	5 161 000,00	0,54
0,3750 % LB Baden-Württemberg 19/24.05.24 MTN S.806 (DE000LB2CHW4) (N)	EUR	5 800			%	101,5810	5 891 698,00	0,62
0,3750 % LB Baden-Württemberg 19/29.07.26 MTN (DE000LB2CLH7) (N)	EUR	3 300			%	101,6630	3 354 879,00	0,35
0,3750 % LB Baden-Württemberg 20/18.02.27 MTN (DE000LB2CRG6) (N)	EUR	9 200			%	101,3320	9 322 544,00	0,98

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
1,2500 % Lithuania 15/22.10.25 MTN (XS1310032187) (N)	EUR	4 000			% 107,2560	4 290 240,00	0,45
0,3750 % Medtronic Global Holdings 20/15.10.28 (XS2238789460) (N)	EUR	5 000			% 100,7770	5 038 850,00	0,53
0,7500 % NatWest Group 19/15.11.25 (XS2080205367) (N)	EUR	10 000			% 102,0610	10 206 100,00	1,07
0,1250 % Nederlandse Financierings-Maat 17/01.06.23 MTN (XS1622394143) (N)	EUR	2 000			% 101,1960	2 023 920,00	0,21
0,2500 % Nederlandse Waterschapsbank 17/07.06.24 MTN (XS1626191107) (N)	EUR	5 000			% 102,0970	5 104 850,00	0,54
0,7500 % Neste 21/25.03.28 (FI4000496286) (N)	EUR	1 800	1 800		% 99,4820	1 790 676,00	0,19
0,5000 % Netherlands 19/15.01.40 (NL0013552060) (N)	EUR	3 000	2 000		% 105,0620	3 151 860,00	0,33
0,0000 % NIBC Bank 03/10.02.43 MTN (XS0161702914) (N)	EUR	590	590		% 297,5000	1 755 250,00	0,18
0,8750 % NIBC Bank 19/08.07.2025 MTN (XS2023631489) (N)	EUR	1 800			% 102,9880	1 853 784,00	0,19
0,1250 % Nordic Investment Bank 16/10.06.24 MTN (XS1431730388) (N)	EUR	4 000			% 101,8640	4 074 560,00	0,43
0,1250 % Novo Nordisk Finance (Netherlands) 21/04.06.28 MTN (XS2348030425) (N)	EUR	2 710	2 710		% 100,1520	2 714 119,20	0,28
0,3750 % Raiffeisen Bank International 19/25.09.26 MTN (XS2055627538) (N)	EUR	4 000			% 101,6220	4 064 880,00	0,43
0,2500 % Raiffeisen Bank International 20/22.01.25 MTN (XS2106056653) (N)	EUR	3 000			% 101,0470	3 031 410,00	0,32
0,3750 % Red Eléctrica Financiaciones 20/24.07.28 MTN (XS2103013210) (N)	EUR	5 000			% 101,6780	5 083 900,00	0,53
0,5000 % SBAB 20/13.05.25 MTN (XS2173114542) (N)	EUR	1 600			% 102,5610	1 640 976,00	0,17
0,7500 % SBAB Bank (publ) 18/14.06.23 MTN (XS1837975736) (N)	EUR	5 000		1 000	% 102,0780	5 103 900,00	0,54
0,8750 % Societe Generale 20/22.09.28 MTN (FR0013536661) (N)	EUR	5 000			% 101,5770	5 078 850,00	0,53
1,8000 % Spain 13/30.11.24 INFL (ES00000126A4) (N)	EUR	10 000			% 112,4370	11 986 683,70	1,26
0,6500 % Spain 17/30.11.27 INFL (ES00000128S2) (N)	EUR	2 000			% 113,3570	2 405 684,93	0,25
0,8000 % Spain 20/30.07.27 (ES0000012G26) (N)	EUR	5 000	5 000		% 105,0950	5 254 750,00	0,55
0,1250 % SpareBank 1 Boligkreditt 19/14.05.26 MTN PF (XS1995620967) (N)	EUR	2 000			% 101,8570	2 037 140,00	0,21
0,0100 % Sparebanken Vest Boligkreditt 20/28.06.27 MTN PF (XS2199484929) (N)	EUR	9 000			% 100,9510	9 085 590,00	0,95
1,1250 % Statkraft 17/20.03.25 MTN (XS1582205040) (N)	EUR	7 000			% 104,2120	7 294 840,00	0,77
0,2000 % Swedbank 21/12.01.28 MTN (XS2282210231) (N)	EUR	5 360	5 360		% 98,3120	5 269 523,20	0,55
0,3750 % Swisscom Finance 20/14.11.28 (XS2169243479) (N)	EUR	2 000			% 101,3400	2 026 800,00	0,21
1,0000 % TenneT Holding 16/13.06.26 MTN (XS1432384664) (N)	EUR	7 000			% 104,9470	7 346 290,00	0,77
0,7500 % TenneT Holding 17/26.06.25 MTN (XS1632897762) (N)	EUR	10 000			% 103,3970	10 339 700,00	1,08
0,8750 % TenneT Holding 19/03.06.30 MTN (XS2002491780) (N)	EUR	5 000			% 104,2880	5 214 400,00	0,55
0,7500 % Terna Rete Elettrica Nazionale 20/24.07.32 MTN (XS2209023402) (N)	EUR	2 000			% 99,8930	1 997 860,00	0,21
0,5000 % Toronto-Dominion Bank 17/03.04.24 MTN PF (XS1588284056) (N)	EUR	3 000			% 102,4270	3 072 810,00	0,32
0,6250 % Toronto-Dominion Bank 18/20.07.23 MTN (XS1857683335) (N)	EUR	5 000			% 102,0060	5 100 300,00	0,54
0,0100 % UBS (London Branch) 21/29.06.26 MTN (XS2358287238) (N)	EUR	2 640	2 640		% 99,8860	2 636 990,40	0,28
0,0000 % Unedic 20/25.11.28 MTN (FR0014000667) (N)	EUR	6 700			% 100,3510	6 723 517,00	0,71
0,5000 % UniCredit 19/09.04.25 MTN (XS2063547041) (N)	EUR	7 530			% 101,0940	7 612 378,20	0,80
2,0000 % ZF Europe Finance 19/23.10.26 Reg S (XS2010039381) (N)	EUR	4 000	4 000		% 101,2740	4 050 960,00	0,42
2,5000 % ZF Europe Finance 19/23.10.27 (XS2010039977) (N)	EUR	8 000			% 102,8670	8 229 360,00	0,86
2,0000 % ZF Finance 21/06.05.27 MTN Reg S (XS2338564870) (N)	EUR	2 200	2 200		% 100,7200	2 215 840,00	0,23
1,5060 % AEGON 95/und. (NL0000120004) (N)	NLG	10 000			% 94,5155	4 288 926,40	0,45
5,5000 % AXA 13/und. MTN (XS0876682666) (N)	USD	1 000			% 101,2210	851 526,88	0,09
8,1510 % Dresdner Funding Tr I 99/30.06.31 Reg S (XS0097772965)	USD	1 250			% 143,3555	1 507 481,91	0,16
0,1000 % European Bank for Rec. & Dev. 20/20.11.30 INFL (XS2259635170) (N)	USD	17 000			% 112,9500	16 577 709,61	1,74
7,1250 % NatWest Markets 93/15.10.93 S.B (US00077TAB08) (N)	USD	2 250			% 176,5040	3 340 910,24	0,35

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
4,7500 % ZF North America Capital 15/29.04.25 Reg S (USU98737AC03) (N)	USD	4 000			% 108,5730	3 653 503,83	0,38
Verbriefte Geldmarktinstrumente							
0,0000 % AEGON 04/und. (NL0000116150) (N)	EUR	11 500	2 500		% 86,8260	9 984 990,00	1,05
0,5700 % AXA 03/und. MTN (XS0179060974) (N)	EUR	5 000			% 90,2480	4 512 400,00	0,47
0,3400 % AXA 03/und. MTN (XS0181369454) (N)	EUR	8 000			% 88,4335	7 074 680,00	0,74
0,1460 % AXA 04/und. MTN (XS0203470157) (N)	EUR	10 000			% 89,6840	8 968 400,00	0,94
0,0580 % Banco Santander 04/Und. (XS0202197694) (N)	EUR	6 000	1 000		% 96,5070	5 790 420,00	0,61
0,5000 % Caixabank 21/09.02.29 MTN (XS2297549391) (N)	EUR	1 900	1 900		% 98,4950	1 871 405,00	0,20
0,0000 % Crédit Agricole 05/und (FR0010161026) (N)	EUR	5 000			% 96,9390	4 846 950,00	0,51
0,1650 % Deutsche Postbank Funding Trust I 04/und. pref. (DE000A0DEN75) (N)	EUR	13 500	1 500		% 97,7330	13 193 955,00	1,38
0,2480 % Deutsche Postbank Funding Trust III 05/und. pref. (DE000A0D2421) (N)	EUR	8 220			% 97,7570	8 035 625,40	0,84
0,4600 % ING Groep 03/und. (NL0000113587) (N)	EUR	9 000	7 000		% 97,7600	8 798 400,00	0,92
0,0600 % ING Groep 04/und. (NL0000116127) (N)	EUR	9 000	3 000		% 97,7500	8 797 500,00	0,92
0,0000 % LB Baden-Württemberg 00/17.01.30 MTN (XS0105748205) (N)	EUR	2 000	2 000		% 95,3770	1 907 540,00	0,20
0,2000 % LB Baden-Württemberg 17/13.12.21 S.790 MTN (DE000LB1M214) (N)	EUR	5 000			% 100,2760	5 013 800,00	0,53
1,6120 % National Westminster Bank 99/und. MTN (XS0102480786) (N)	EUR	2 278	2 278		% 100,0000	2 278 000,00	0,24
1,6120 % National Westminster Bank 99/und. MTN (XS0102480869) (N)	EUR	1 579	1 579		% 99,9470	1 578 163,13	0,17
0,1080 % NIBC Bank 06/Und. (XS0249580357) (N)	EUR	9 000			% 95,2375	8 571 375,00	0,90
0,2500 % Raiffeisen Bank International 18/05.07.21 MTN (XS1852213930) (N)	EUR	5 000			% 100,0010	5 000 050,00	0,52
0,1530 % RZB Finance (Jersey) III 04/und. (XS0193631040) (N)	EUR	9 000			% 98,3460	8 851 140,00	0,93
0,0000 % Société Générale 85/Und. S.XV (FR0000585564) (N)	EUR	2 500	2 500		% 98,9950	2 474 875,00	0,26
0,0000 % UniCredit Bank Austria 01/27.12.31 MTN (XS0140394817) (N)	EUR	1 600	1 600		% 91,5305	1 464 488,00	0,15
4,0000 % Vossloh 21/Und. (DE000A3H2VA6) (N)	EUR	1 300	1 300		% 104,9050	1 363 765,00	0,14
0,0000 % Deutsche Bank 96/15.10.21 (DE0001343101) (N)	ITL	6 000 000			% 99,7930	3 092 327,00	0,32
0,4960 % AEGON 96/und. (NL0000120889) (N)	NLG	7 000			% 85,7485	2 723 768,10	0,29
1,4250 % AEGON 96/und. (NL0000121416) (N)	NLG	5 000			% 94,1405	2 135 954,82	0,22
1,7740 % AEGON 04/und. (NL0000116168) (N)	USD	4 000	2 000		% 92,5370	3 113 889,12	0,33
1,2630 % AXA 04/und. MTN (XS0185672291) (N)	USD	2 000			% 93,2640	1 569 176,41	0,16
0,2779 % BNP Paribas 86/und (FR0008131403) (N)	USD	4 000	1 000		% 94,4920	3 179 675,28	0,33
0,5625 % Commerzbank Holdings (UK) 85/und. (GB0004955547) (N)	USD	1 250	250		% 92,5290	973 006,23	0,10
0,2813 % CW Bank of Australia 86/und. (GB0008424284) (N)	USD	7 400			% 94,5575	5 886 476,82	0,62
0,3244 % DNB Bank 86/und. (GB0040940875) (N)	USD	3 000	1 000		% 94,1730	2 376 705,64	0,25
4,0400 % KBC Ifima 05/07.02.25 MTN (XS0210976329) (N)	USD	2 000			% 107,5110	1 808 883,65	0,19
0,5000 % National Westminster Bank 85/und. (GB0006267073) (N)	USD	250		750	% 99,8220	209 939,43	0,02
1,8110 % NIBC Bank 05/und. MTN (XS0215294512) (N)	USD	2 000			% 95,44851 605 930,85	0,17	
Zertifikate							
UBS London/Equity Basket 23.12.22 TrackerCert. (CH0575775371) (N)	Stück	100 000	100 000		EUR 102,5000	10 250 000,00	1,08
Sonstige Beteiligungswertpapiere							
Roche Holding Profitsch. (CH0012032048) (N)	Stück	27 000		8 000	CHF 350,1500	8 617 702,02	0,90
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						11 792 450,24	1,24
Verzinsliche Wertpapiere							
9,0000 % HVB Funding Trust III 99/22.10.31 144a (US404399AA50)	USD	2 000			% 151,0505	2 541 440,23	0,27

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Verbriefte Geldmarktinstrumente							
1,3675 % Crédit Agricole 07/und. Reg S (USF22797FJ25) (N)	USD	3 810			% 98,2260	3 148 322,20	0,33
1,0938 % HSB Group 97/15.07.27 (US40428NAC39) ..	USD	6 000			% 91,8200	4 634 642,89	0,49
0,5000 % National Westminster Bank 85/Und. (GB0006267180) (N)	USD	1 750	750		% 99,7180	1 468 044,92	0,15
Investmentanteile						73 196 751,66	7,68
Gruppeneigene Investmentanteile (inkl. KVG-eigene Investmentanteile)							
Xtrackers MSCI Emerging Markets ESG UCITS ETF 1C (IE00BG370F43) (0,250%)	Stück	240 000		100 000	EUR 52,2800	12 547 200,00	1,32
Xtrackers MSCI Japan ESG UCITS ETF 1C (IE00BG36TC12) (0,100%)	Stück	800 000	500 000		EUR 18,6000	14 880 000,00	1,56
Gruppenfremde Investmentanteile						45 769 551,66	4,80
Fisch U.F. SICAV-FISCH Convert.Global Sustai.Fd BE (LU1130246231) (0,900%)	Stück	65 000			EUR 132,3400	8 602 100,00	0,90
FSGU-Stewart Inv.APAC Sus. VI EUR Accu. (IE00BFY86394) (0,850%)	Stück	7 627 273			EUR 3,4764	26 515 451,66	2,78
iShs II-Global Water UCITS ETF USD (Dist.) (IE00B1TXK627) (0,650%)	Stück	200 000		87 000	EUR 53,2600	10 652 000,00	1,12
Summe Wertpapiervermögen						931 257 915,29	97,69
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Derivate auf einzelne Wertpapiere						125 086,51	0,01
Wertpapier-Optionsrechte (Forderungen / Verbindlichkeiten)							
Optionsrechte auf Aktien							
Put Coloplast B 09/2021 Strike 950,00 508	Stück	-15 600			DKK 11,6250	-24 386,96	0,00
Call Allianz 07/2021 Strike 230,00 (EURX)	Stück	-8 000			EUR 0,1200	-960,00	0,00
Call Aurubis 09/2021 Strike 76,00 (EURX)	Stück	-26 000			EUR 4,8500	-126 100,00	-0,01
Put Air Liquide 09/2021 Strike 130,00 (EURX)	Stück	-17 600			EUR 0,7450	-13 112,00	0,00
Put Allianz 07/2021 Strike 200,00 (EURX)	Stück	-16 000			EUR 1,0000	-16 000,00	0,00
Put Covestro 09/2021 Strike 50,00 (EURX)	Stück	-45 800			EUR 1,1400	-52 212,00	-0,01
Put Neste Oyj 09/2021 Strike 46,00 (EURX)	Stück	-25 000			EUR 0,9500	-23 750,00	0,00
Put Veolia Environnement 09/2021 Strike 23,00 (EURX) ..	Stück	-100 000			EUR 0,3550	-35 500,00	0,00
Put Wacker Chemie 12/2021 Strike 120,00 (EURX)	Stück	-20 000			EUR 7,2500	-145 000,00	-0,02
Call The Procter & Gamble 10/2021 Strike 145,00 (US\$) ..	Stück	-25 000			USD 1,0200	-21 452,01	0,00
Put American Water Works Co. 09/2021 Strike 140,00 (US\$)	Stück	-18 500			USD 1,4000	-21 788,51	0,00
Put Apple 09/2021 Strike 115,00 (US\$)	Stück	-30 000			USD 0,8900	-22 461,51	0,00
Put Boston Scientific Corp. 08/2021 Strike 35,00 (US\$) ..	Stück	-98 000			USD 0,1400	-11 542,02	0,00
Wertpapier-Optionsscheine							
Optionsscheine auf Aktien							
OboTech Acquisition 30.04.26 (LU2334364374)	Stück	310 000	310 000		EUR 0,9000	279 000,00	0,03
European Sustainable Growth Acq. Cl.A 31.12.27 (KYG3194F1173)	Stück	240 213	240 214	1	USD 1,0200	206 122,03	0,02
M3-Brigade Acquisition II 31.12.27 (US5538001117)	Stück	166 666	166 667	1	USD 1,1000	154 229,49	0,02
Aktienindex-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						395 000,00	0,04
Optionsrechte							
Optionsrechte auf Aktienindices							
Put DAX (Performanceindex) 09/2021 Strike 13000,00 (EURX)	Stück	5 000			EUR 79,0000	395 000,00	0,04

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						-166 940,01	-0,02
Zinsterminkontrakte							
EURO-BOBL SEP 21 (EURX)	EUR	-15 700				-14 130,00	0,00
EURO-BUND SEP 21 (EURX)	EUR	-16 700				-152 810,01	-0,02
Devisen-Derivate						-2 261 015,60	-0,23
Devisentermingeschäfte							
EUR/USD FUTURE (CME) SEP 21	USD	90 625				-2 261 015,60	-0,23
Bankguthaben und nicht verbriefte Geldmarktinstrumente						25 390 040,46	2,66
Bankguthaben							
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	11 432 654,04			% 100	11 432 654,04	1,20
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR	42 852,73			% 100	42 852,73	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							
Australische Dollar	AUD	154,16			% 100	97,25	0,00
Kanadische Dollar	CAD	153,61			% 100	104,07	0,00
Schweizer Franken	CHF	6 596,80			% 100	6 013,22	0,00
Britische Pfund	GBP	3 094,60			% 100	3 601,93	0,00
Japanische Yen	JPY	7 645,00			% 100	58,22	0,00
Mexikanische Peso	MXN	2 067,80			% 100	87,68	0,00
US Dollar	USD	16 528 363,93			% 100	13 904 571,32	1,46
Sonstige Vermögensgegenstände						1 567 877,83	0,17
Zinsansprüche	EUR	1 369 142,47			% 100	1 369 142,47	0,14
Dividenden-/Ausschüttungsansprüche	EUR	15 160,43			% 100	15 160,43	0,00
Quellensteueransprüche	EUR	183 574,93			% 100	183 574,93	0,02
Sonstige Verbindlichkeiten						-3 026 225,16	-0,32
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-3 006 725,16			% 100	-3 006 725,16	-0,32
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-19 500,00			% 100	-19 500,00	0,00
Fondsvermögen						953 281 739,32	100,00

Anteilwert bzw. umlaufende Anteile	Stück bzw. Whg.	Anteilwert in der jeweiligen Whg.
Anteilwert		
Klasse A	EUR	126,14
Klasse B	EUR	126,58
Umlaufende Anteile		
Klasse A	Stück	6 689 861,728
Klasse B	Stück	864 498,357

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

508	=	NASDAQ OMX Copenhagen
EURX	=	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
USS	=	American Stock Options Exchange
CME	=	Chicago Mercantile Exchange (CME) - Index and Options Market Division (IOM)

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 30.06.2021

Australische Dollar	AUD	1,585150	= EUR	1
Kanadische Dollar	CAD	1,476000	= EUR	1
Schweizer Franken	CHF	1,097050	= EUR	1
Dänische Kronen	DKK	7,436350	= EUR	1
Britische Pfund	GBP	0,859150	= EUR	1
Italienische Lira	ITL	1 936,270000	= EUR	1
Japanische Yen	JPY	131,310000	= EUR	1
Mexikanische Peso	MXN	23,584150	= EUR	1
Niederländische Gulden	NLG	2,203710	= EUR	1
Norwegische Kronen	NOK	10,195500	= EUR	1
Schwedische Kronen	SEK	10,122850	= EUR	1
US Dollar	USD	1,188700	= EUR	1

Fußnoten

6) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise Gegenstand eines Stillhaltergeschäfts in Wertpapieren (Verkauf einer Kaufoption).

Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
-----------------------	-------------------------	--------------------	-----------------------

Börsengehandelte Wertpapiere

Aktien

ACON S2 Acquisition Cl.A (KYG007481065)	Stück	122 641	500 000
Advanced Micro Devices (US0079031078)	Stück		48 000
Akamai Technologies (US00971T1016)	Stück		23 250
ArcLight Clean Transition Cl.A (KYG045611095)	Stück		400 000
Broadscale Acquisition Unit (US11134Y2000)	Stück	5 883	5 883
European Sustainable growth Acquisition Unit (KYG3194F1256)	Stück	480 427	480 427
Hennessy Capital Investment Unit (US42589T2069)	Stück	27 608	27 608
M3-Brigade Acquisition II Unit (US5538002024)	Stück	500 000	500 000
Peridot Acquisition Cl.A (KYG7008A1159)	Stück		400 000
Star Peak II Unit (US8551792067)	Stück	41 379	41 379
TPG Pace Beneficial Finance Cl.A (KYG8990D1253)	Stück	295 425	295 425
TPG Pace Beneficial II Cl.A (KYG898261048)	Stück	53 922	53 922

Verzinsliche Wertpapiere

2,2000 % RZD Capital 19/23.05.27 LPN (XS1843437036)	EUR		5 000
1,9500 % Spain 16/30.04.26 (ES00000127Z9)	EUR		5 000
2,7500 % ZF North America Capital 15/27.04.23 (DE000A14J7G6)	EUR		4 000

Verbriefte Geldmarktinstrumente

0,0000 % BA-CA Finance (Cayman) 04/und. (DE000A0DD4K8)	EUR		9 000
0,2286 % Ba-Ca Finance 2 05/Und. (DE000A0DYV70)	EUR		5 000
1,7500 % Deutsche Bank Capital Finance Tr I 05/und. pref. (DE000A0E5JD4)	EUR		1 885
0,6250 % Deutsche Kreditbank 16/08.06.21 (DE000GRN0008)	EUR		9 000
0,9730 % DZ Bank Capital Fdg. III 05/und. Tr.Pref. (DE000A0DZTE1)	EUR		9 000
1,0730 % DZ Bank Capital Funding Trust II 04/und. (DE000A0DCXAO)	EUR		8 000
0,2590 % DZ BANK Perp. Issuer Funding (Jersey) 06/und. MTN (DE000A0GMRS6)	EUR		1 187
0,2760 % DZ BANK Perp. Issuer Funding (Jersey) 06/Und. MTN (DE000A0GWWW7)	EUR		500
0,5000 % LB Baden-Württemberg 17/07.06.22 S.783 IHS MTN (DE000LB1DVL8)	EUR		3 000

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Käufe bzw. Zugänge	Verkäufe bzw. Abgänge
-----------------------	-------------------------	--------------------	-----------------------

0,5000 % SBAB Bank 16/11.05.21 MTN (XS1392159825) EUR 2 000

5,5000 % Allianz 12/und. (XS0857872500) USD 2 000

0,5000 % Natinoal Westminster Bank 1985/und. (LU0001547172) USD 3 000

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

ACON S2 Acquisition 15.09.27 (KYG007481149)	Stück		125 787
ArcLight Clean Transition 22.09.27 (KYG045611251)	Stück		200 000
Peridot Acquisition 30.11.27 (KYG7008A1076)	Stück		200 000
TPG Pace Beneficial Finance 09.10.27 WRT (KYG8990D1170)	Stück	59 085	59 085

Volumen in 1000

Terminkontrakte

Zinsterminkontrakte

Verkaufte Kontrakte: (Basiswerte: EURO-BOBL JUN 21, EURO-BUND JUN 21) EUR 52 598

Devisentermingeschäfte

Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: EUR/USD FUTURE (CME) JUN 21) EUR 90 888

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

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

	Volumen in 1000	
Optionsrechte		
Wertpapier-Optionsrechte		
Optionsrechte auf Aktien		
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswerte: ASML Holding, Equinor, Roche Holding Profitsh., The Procter & Gamble)	EUR	8 153
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: ASML Holding, Covestro, CRH, Kering, Merck, Orsted, Svenska Cellulosa B (Free), The Procter & Gamble)	EUR	17 352
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate		
Optionsrechte auf Aktienindices		
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: DAX (Performanceindex))	EUR	19 500
Optionsrechte auf Devisen-Derivate		
Optionsrechte auf Devisen		
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswährungen: GBP/EUR)	EUR	4 791
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswährungen: GBP/EUR)	EUR	4 325

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

	Volumen in 1000	
unbefristet	EUR	121 892
Gattung: 1,5000 % Abbott Ireland Financing 18/27.09.26 (XS1883355197), 0,0000 % AEGON 04/und. (NL0000116150), 0,1250 % African Development Bank 16/07.10.26 MTN (XS1501560848), 0,0000 % Alstom 21/11.01.29 (FR0014001EW8), 0,5700 % AXA 03/und. MTN (XS0179060974), 1,2500 % Belgium 18/22.04.33 S.86 (BE0000346552), 0,1250 % Berlin Hyp 17/23.10.23 S.201 PF (DE000BHY0GH2), 0,5000 % BNP Paribas 19/04.06.26 MTN (FR0013465358), 0,3750 % BNP Paribas 20/14.10.27 MTN (FR00140005J1), 0,0000 % Cie Gén. Etablissements Michelin 20/02.11.28 (FR0014000D31), 0,7500 % Deutsche Kreditbank 17/26.09.24 (DE000GRN0016), 0,1000 % Deutsche Pfandbriefbank 21/02.02.26 MTN (DE000A3H2ZX9), 0,6250 % DNB Boligkredit 18/19.06.25 MTN PF (XS1839888754), 0,1500 % EUROFIMA 19/10.10.34 MTN (XS2055744689), Germany 14/15.04.30 INFL (DE0001030559), Germany 15/15.04.26 INFL (DE0001030567), 0,7500 % Intesa Sanpaolo 19/04.12.24 MTN (XS2089368596), 0,2500 % Iren 20/17.01.31 MTN (XS2275029085), 1,3750 % La Banque Postale 19/24.04.29 MTN (FR0013415692), 0,3750 % LB Baden-Württemberg 19/29.07.26 MTN (DE000LB2CLH7), 0,2500 % Nederlandse Waterschapsbank 17/07.06.24 MTN (XS1626191107), 0,2500 % Raiffeisen Bank International 20/22.01.25 MTN (XS2106056653), 0,3750 % Red Eléctrica Financiaciones 20/24.07.28 MTN (XS2103013210), 0,5000 % SBAB 20/13.05.25 MTN (XS2173114542), Spain 13/30.11.24 INFL (ES00000126A4), 0,1250 % SpareBank 1 Boligkredit 19/14.05.26 MTN PF (XS1995620967), 1,1250 % Statkraft 17/20.03.25 MTN (XS1582205040), 0,2000 % Swedbank 21/12.01.28 MTN (XS2282210231), 0,3750 % Swisscom Finance 20/14.11.28 (XS2169243479), 1,0000 % TenneT Holding 16/13.06.26 MTN (XS1432384664), 0,8750 % TenneT Holding 19/03.06.30 MTN (XS2002491780), 0,7500 % Terna Rete Elettrica Nazionale 20/24.07.32 MTN (XS2209023402), 0,5000 % Toronto-Dominion Bank 17/03.04.24 MTN PF (XS1588284056), 0,6250 % Toronto-Dominion Bank 18/20.07.23 MTN (XS1857683335), 0,0000 % Unedic 20/25.11.28 MTN (FR0014000667), 0,5000 % UniCredit 19/09.04.25 MTN (XS2063547041), Legal & General Group (GB0005603997), Svenska Cellulosa B (Free) (SE0000112724), VISA Cl.A (US92826C8394), 0,5000 % Natinoal Westminster Bank 1985/und. (LU0001547172), 0,5000 % National Westminster Bank 85/Und. (GB0006267180)		

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Anhang gemäß § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert Klasse A: EUR 126,14
Anteilwert Klasse B: EUR 126,58

Umlaufende Anteile Klasse A: 6 689 861,728
Umlaufende Anteile Klasse B: 864 498,357

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände:

Die Bewertung erfolgt durch die Verwahrstelle unter Mitwirkung der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Verwahrstelle stützt sich hierbei grundsätzlich auf externe Quellen.

Sofern keine handelbaren Kurse vorliegen, werden Bewertungsmodelle zur Preisermittlung (abgeleitete Verkehrswerte) genutzt, die zwischen Verwahrstelle und Kapitalverwaltungsgesellschaft abgestimmt sind und sich so weit als möglich auf Marktparameter stützen. Diese Vorgehensweise unterliegt einem permanenten Kontrollprozess. 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.

Die in Klammern aufgeführte Buchstaben-Kennzeichnung N gibt bei den einzelnen Werten an, dass die Nachhaltigkeitskriterien gemäß § 26 Abs. 1 der Besonderen Anlagebedingungen erfüllt sind.

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

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

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

Angaben in Fondswährung	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
	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			

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

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.			

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

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	21 808,10	-	-
in % der Bruttoertrage	67,00	-	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	-
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	10 739,68	-	-
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sten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
1. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			
2. Name			
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)			

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

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

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	-		-

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

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

Gesamtzahl Verwahrer/
Kontoführer

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

1. Name
verwahrter Betrag absolut

Kapitalverwaltungsgesellschaft

DWS Investment GmbH
60612 Frankfurt am Main
Eigenmittel am 31.12.2020: 398,4 Mio. Euro
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital
am 31.12.2020: 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

Britta Lehfeldt
Deutsche Bank AG,
Frankfurt am Main

Dr. Stefan Marcinowski
Ludwigshafen

Prof. Christian Strenger
The Germany Funds,
New York

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

Susanne Zeidler
Deutsche Beteiligungs AG,
Frankfurt am Main

Geschäftsführung

Manfred Bauer
Sprecher der Geschäftsführung

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

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

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