

Deutsche Asset Management Investment GmbH

Astra-Fonds

Halbjahresbericht 2017



Astra-Fonds

Inhalt

Halbjahresbericht 2017
vom 1.1.2017 bis 30.6.2017 (gemäß § 103 KAGB)

Hinweise	2
Halbjahresbericht Astra-Fonds	4
Vermögensaufstellung zum Halbjahresbericht	6
TER für Anleger in der Schweiz	17

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 Deutsche Asset Management 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 zum 30. Juni 2017** 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 Deutsche Asset Management 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

Halbjahresbericht

Astra-Fonds

Astra-Fonds vs. Vergleichsindex Wertentwicklung im Überblick	
ISIN	6 Monate
DE0009777003	7,7%
MSCI World	2,7%

Wertentwicklung nach BVI-Methode, d. h. ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages. Wertentwicklungen der Vergangenheit ermöglichen keine Prognose für die Zukunft.
Stand: 30.6.2017
Angaben auf Euro-Basis

Vermögensaufstellung zum Halbjahresbericht

Astra-Fonds

Vermögensübersicht

	Bestand in TEUR	%-Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien (Branchen):		
Informationstechnologie	64 737	18,77
Dauerhafte Konsumgüter	59 981	17,39
Grundstoffe	52 695	15,29
Finanzsektor	39 252	11,39
Gesundheitswesen	34 334	9,96
Industrien	25 912	7,52
Sonstige	19 520	5,66
Telekommunikationsdienste	12 165	3,53
Hauptverbrauchsgüter	11 743	3,41
Versorger	7 258	2,11
Energie	5 983	1,74
Summe Aktien:	333 580	96,77
2. Derivate	119	0,04
3. Bankguthaben	12 192	3,54
4. Sonstige Vermögensgegenstände	153	0,04
II. Verbindlichkeiten		
1. Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme	-857	-0,25
2. Sonstige Verbindlichkeiten	-467	-0,14
III. Fondsvermögen	344 720	100,00

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

Astra-Fonds

Vermögensaufstellung zum 30.06.2017

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen	
Börsengehandelte Wertpapiere						333 580 095,33	96,77	
Aktien								
BVZ Holding Reg. (CH0008207356)	Stück	4 513			CHF	571,0000	2 357 444,88	0,68
Clariant Reg. (CH0012142631)	Stück	324 000	324 000		CHF	20,9500	6 209 678,89	1,80
Dufry Reg. (CH0023405456) ³⁾	Stück	48 300	4 850		CHF	158,6000	7 007 940,72	2,03
Helvetia Holding Reg. (CH0012271687)	Stück	12 520			CHF	550,5000	6 305 241,97	1,83
LafargeHolcim Reg. (CH0012214059)	Stück	66 300	66 300		CHF	55,6000	3 372 317,26	0,98
Lonza Group Reg. (CH0013841017)	Stück	9 500	9 500		CHF	205,8000	1 788 582,93	0,52
u-blox Holding Reg. (CH0033361673)	Stück	38 000	4 250		CHF	181,7000	6 316 530,97	1,83
UBS Group Reg. (CH0244767585)	Stück	54 900	77 200	128 500	CHF	16,4200	824 680,27	0,24
DONG Energy (DK0060094928)	Stück	55 000	34 075		DKK	293,5000	2 170 828,79	0,63
ISS (DK0060542181)	Stück	31 500		16 500	DKK	256,2000	1 085 286,64	0,31
Novo-Nordisk B (DK0060534915) ³⁾	Stück	127 000	46 300		DKK	277,2000	4 734 255,86	1,37
Allianz (DE0008404005)	Stück	19 100	29	12 929	EUR	174,2500	3 328 175,00	0,97
ASML Holding (NL0010273215)	Stück	34 700	34 700		EUR	115,3500	4 002 645,00	1,16
Aurubis (DE0006766504)	Stück	84 300		23 700	EUR	69,2200	5 835 246,00	1,69
Bayer (DE000BAY0017)	Stück	35 800	5 100		EUR	113,6500	4 068 670,00	1,18
Brenntag (DE000A1DAH0)	Stück	69 800	79 700	55 900	EUR	51,5500	3 598 190,00	1,04
BUZZI UNICEM (IT0001347308)	Stück	161 000	53 300		EUR	22,0400	3 548 440,00	1,03
Daimler Reg. (DE0007100000)	Stück	36 200		20 900	EUR	64,1000	2 320 420,00	0,67
Deutsche Telekom Reg. (DE0005557508)	Stück	217 000	37 600	42 600	EUR	15,9900	3 469 830,00	1,01
Deutsche Wohnen (DE000A0HN5C6)	Stück	103 000	103 000		EUR	33,3880	3 438 964,00	1,00
Diebold Nixdorf (DE000A0CAYB2)	Stück	29 300			EUR	71,9400	2 107 842,00	0,61
Fresenius Medical Care (DE0005785802)	Stück	48 500	8 000	25 400	EUR	84,9700	4 121 045,00	1,20
Glanbia (IE0000669501)	Stück	84 000			EUR	17,2450	1 448 580,00	0,42
Groupe Danone (C.R.) (FR0000120644) ³⁾	Stück	134 500	28 200		EUR	66,7700	8 980 565,00	2,61
Imerys (FR0000120859) ³⁾	Stück	58 900			EUR	76,4100	4 500 549,00	1,31
Infineon Technologies Reg. (DE0006231004)	Stück	199 000	199 000		EUR	18,7200	3 725 280,00	1,08
K+S Reg. (DE000KSAG888)	Stück	178 500	178 500		EUR	22,6650	4 045 702,50	1,17
Krones (DE0006335003)	Stück	34 000	25 700		EUR	101,8000	3 461 200,00	1,00
LEG Immobilien Reg. (DE000LEG1110)	Stück	9 000	9 000		EUR	81,7200	735 480,00	0,21
Linde (DE0006483001)	Stück	41 800	3 300		EUR	168,3000	7 034 940,00	2,04
Royal Dutch Shell Cl. A (GB00B03MLX29)	Stück	51 000		51 000	EUR	23,3800	1 192 380,00	0,35
SAP (DE0007164600)	Stück	48 900		26 500	EUR	92,1200	4 504 668,00	1,31
Scout24 Reg. (DE000A12DM80)	Stück	171 000	171 000		EUR	32,3850	5 537 835,00	1,61
STADA Arzneimittel Vink. Reg. (DE0007251803)	Stück	2 800	11 000	8 200	EUR	61,4500	172 060,00	0,05
Total (FR0000120271)	Stück	35 500	24 048	108 548	EUR	43,8200	1 555 610,00	0,45
Verbund AG (AT0000746409)	Stück	154 000	154 000		EUR	16,7050	2 572 570,00	0,75
voestalpine (AT0000937503)	Stück	103 500	103 500		EUR	40,6800	4 210 380,00	1,22
Wacker Chemie (DE000WCH8881)	Stück	56 100	20 100		EUR	95,8500	5 377 185,00	1,56
Wirecard AG (DE0007472060)	Stück	87 300		33 400	EUR	56,3700	4 921 101,00	1,43
Yoox Net-A-Porter Group (IT0003540470) ³⁾	Stück	125 000	125 000		EUR	24,1500	3 018 750,00	0,88
Burford Capital (GG00B4L84979)	Stück	90 000	90 000		GBP	9,0000	922 761,45	0,27
GlaxoSmithKline (GB0009252882)	Stück	184 000	143 300		GBP	16,4502	3 448 216,18	1,00
Rio Tinto (GB0007188757)	Stück	105 200		45 900	GBP	32,8500	3 936 910,46	1,14
Champion REIT (HK2778034606)	Stück	6 210 000			HKD	4,9700	3 467 500,29	1,01
China Mobile LTD (HK0941009539)	Stück	159 000	159 000		HKD	82,8500	1 479 987,87	0,43
Great Eagle Holdings (BMG4069C1486)	Stück	2 663 000			HKD	39,7000	11 877 640,90	3,45
Hopewell Holdings (HK0000051067)	Stück	1 927 000			HKD	29,7500	6 440 761,28	1,87
Kingboard Chemical Holdings (KYG525621408)	Stück	1 435 000	205 000		HKD	31,1000	5 013 959,34	1,45
Kingboard Laminates Holdings (KYG5257K1076)	Stück	2 160 000	1 355 000		HKD	9,4200	2 285 983,92	0,66
Kingmaker Footwear Holdings (BMG5256W1029)	Stück	2 004 000		3 036 000	HKD	2,1900	493 072,01	0,14
PICC Property & Casualty Co. Cl.H (new) (CNE100000593)	Stück	830 000			HKD	13,0400	1 215 973,76	0,35
Pico Far East Holdings (KYG7082H1276)	Stück	17 120 000		1 044 000	HKD	3,2700	6 289 556,62	1,82
DMG Mori Co. (JP3924800000)	Stück	207 500			JPY	1 843,0000	2 997 511,37	0,87
Ebara Corp. (JP3166000004)	Stück	25 600	25 600		JPY	3 110,0000	624 047,66	0,18
Panasonic Corp. (JP3866800000)	Stück	283 000	283 000		JPY	1 524,0000	3 380 561,22	0,98
Com Hem Holding (SE0005999778)	Stück	414 000		173 000	SEK	118,1000	5 065 230,12	1,47
Nordea Bank (SE0000427361)	Stück	810 000		64 600	SEK	108,3000	9 087 876,51	2,64
Skanska B (Free) (SE0000113250)	Stück	23 060		184 740	SEK	201,1000	480 419,16	0,14
Trelleborg B (Free) (SE0000114837)	Stück	60 000		118 000	SEK	192,7000	1 197 793,37	0,35
Albemarle (US0126531013)	Stück	14 300		57 700	USD	104,6700	1 312 505,26	0,38
Alibaba Group Holding ADR (US01609W1027)	Stück	88 300	88 300		USD	140,8100	10 902 773,59	3,16
Alphabet Cl.C (US02079K1079)	Stück	4 440		1 300	USD	917,7900	3 573 296,74	1,04

Astra-Fonds

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen	
Amazon.com (US0231351067)	Stück	13 950	5 880		USD	975,9300	11 938 112,50	3,46
American Express Co. (US0258161092)	Stück	33 100	8 100	29 700	USD	83,6300	2 427 352,68	0,70
Apple (US0378331005)	Stück	47 200	7 900	5 200	USD	143,6800	5 946 769,55	1,73
Atlantica Yield (GB00BLP5YB54)	Stück	134 000	36 500		USD	21,4000	2 514 556,30	0,73
Autoliv (US0528001094) ³⁾	Stück	37 800		6 200	USD	108,9600	3 611 616,98	1,05
Berkshire Hathaway Cl.B (new) (US0846707026)	Stück	13 600			USD	169,3000	2 019 010,87	0,59
Blackrock (US09247X1019)	Stück	26 000	2 700		USD	423,2400	9 649 456,33	2,80
Blackstone Group Shs.of.Ben.Int. (US09253U1088)	Stück	119 000	84 000		USD	33,2700	3 471 702,91	1,01
Carnival Corp. Paired Cert. (1Sh.Carn.+1SBI P&O) (PA1436583006)	Stück	38 000			USD	65,1500	2 170 904,95	0,63
Cirrus Logic (US1727551004)	Stück	24 000	24 000		USD	63,2800	1 331 743,25	0,39
eBay (US2786421030)	Stück	22 000	22 000		USD	34,5100	665 748,86	0,19
Eli Lilly and Company (US5324571083)	Stück	53 400	13 500		USD	82,7000	3 872 483,34	1,12
Ingersoll-Rand (IE00B6330302)	Stück	46 300			USD	90,3700	3 669 002,98	1,06
Johnson & Johnson (US4781601046)	Stück	32 300	32 300		USD	132,6400	3 756 815,15	1,09
L Brands (US5017971046)	Stück	58 400	13 900	11 000	USD	54,1900	2 775 075,41	0,81
Las Vegas Sands Corp. (US5178341070)	Stück	126 300			USD	63,5100	7 033 771,48	2,04
Marathon Petroleum (US56585A1025)	Stück	71 200			USD	51,8100	3 234 717,64	0,94
Match Group (US57665R1068)	Stück	256 000	256 000		USD	17,3800	3 901 508,24	1,13
Merck & Co. (US58933Y1055)	Stück	60 000	60 000		USD	64,3400	3 385 128,03	0,98
Monsanto Co. (US61166W1018)	Stück	16 700		17 300	USD	118,0000	1 727 990,18	0,50
Newmont Mining (US6516391066)	Stück	56 000			USD	32,2300	1 582 672,75	0,46
NIKE B (US6541061031)	Stück	68 200		26 500	USD	53,1700	3 179 756,23	0,92
Philip Morris International (US7181721090)	Stück	12 800	12 800		USD	117,0800	1 314 121,36	0,38
The Priceline Group (US7415034039)	Stück	2 600	3 590	2 200	USD	1 876,9900	4 279 352,86	1,24
Veon Sp.ADR (US91822M1062)	Stück	632 000	632 000		USD	3,8800	2 150 263,07	0,62
Naspers (new) (ZAE000015889)	Stück	14 600	14 600		ZAR	2 537,9900	2 482 066,99	0,72
Sonstige Beteiligungswertpapiere								
Roche Holding Profitsh. (CH0012032048)	Stück	22 250		6 350	CHF	245,0000	4 986 963,68	1,45
Nicht notierte Wertpapiere							4,48	0,00
Aktien								
Sporthouse.de Reg. (DE0005022107)	Stück	44 810			EUR	0,0001	4,48	0,00
Summe Wertpapiervermögen							333 580 099,81	96,77
Derivate								
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen								
Devisen-Derivate							118 866,10	0,04
Devisenterminkontrakte (Verkauf)								
Offene Positionen								
JPY/EUR 358,00 Mio.						162 079,61	0,05	
Geschlossene Positionen								
USD/EUR 7,70 Mio.						-43 213,51	-0,01	
Bankguthaben und nicht verbriefte Geldmarktinstrumente							12 192 184,85	3,54
Bankguthaben							12 192 184,85	3,54
Verwahrstelle (täglich fällig)								
EUR - Guthaben	EUR	40 200,42			%	100	40 200,42	0,01
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR	1 154 317,50			%	100	1 154 317,50	0,33
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen								
Australische Dollar	AUD	0,69			%	100	0,46	0,00
Kanadische Dollar	CAD	1 036,88			%	100	700,38	0,00
Schweizer Franken	CHF	15 496,52			%	100	14 176,67	0,00
Hongkong Dollar	HKD	1 394 345,03			%	100	156 653,02	0,05
Israelische Schekel	ILS	7,36			%	100	1,85	0,00
Japanische Yen	JPY	3 494 041,00			%	100	27 387,06	0,01
Südkoreanische Won	KRW	2 254 781 896,00			%	100	1 727 021,42	0,50
Malaysische Ringgit	MYR	569,94			%	100	116,39	0,00
Philippinische Peso	PHP	77,76			%	100	1,35	0,00
Südafrikanische Rand	ZAR	103 053,94			%	100	6 902,96	0,00

Astra-Fonds

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Wgh. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fonds- vermögen
Termingeld							
EUR - Guthaben (Bayerische Landesbank, Munich)	EUR	2 225 000,00			% 100	2 225 000,00	0,65
USD - Guthaben (Bayerische Landesbank, Munich)	USD	7 800 000,00			% 100	6 839 705,37	1,98
Sonstige Vermögensgegenstände						152 791,28	0,04
Dividendenansprüche	EUR	97 677,31			% 100	97 677,31	0,03
Quellensteueransprüche	EUR	50 924,11			% 100	50 924,11	0,01
Sonstige Ansprüche	EUR	4 189,86			% 100	4 189,86	0,00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme						-856 614,11	-0,25
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen							
US Dollar	USD	-976 882,73			% 100	-856 614,11	-0,25
Sonstige Verbindlichkeiten						-466 998,68	-0,14
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen							
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-463 818,87			% 100	-463 818,87	-0,13
	EUR	-3 179,81			% 100	-3 179,81	0,00
Fondsvermögen						344 720 329,25	100,00
Anteilwert						263,94	
Umlaufende Anteile						1 306 033,226	

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

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 30.06.2017

Australische Dollar	AUD	1,484750	= EUR	1
Kanadische Dollar	CAD	1,480450	= EUR	1
Schweizer Franken	CHF	1,093100	= EUR	1
Dänische Kronen	DKK	7,436100	= EUR	1
Britische Pfund	GBP	0,877800	= EUR	1
Hongkong Dollar	HKD	8,900850	= EUR	1
Israelische Schekel	ILS	3,985700	= EUR	1
Japanische Yen	JPY	127,580000	= EUR	1
Südkoreanische Won	KRW	1 305,590000	= EUR	1
Malaysische Ringgit	MYR	4,896650	= EUR	1
Philippinische Peso	PHP	57,551000	= EUR	1
Schwedische Kronen	SEK	9,652750	= EUR	1
US Dollar	USD	1,140400	= EUR	1
Südafrikanische Rand	ZAR	14,928950	= EUR	1

Fußnoten

3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 23 261 721,43.

Astra-Fonds

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			
Actelion Reg. (CH0010532478)	Stück	10 300	10 300
Actelion Reg. 2nd Line 03/17 (CH0355794022)	Stück	20 600	20 600
Idorsia Reg. (CH0363463438)	Stück	10 300	10 300
Sunrise Communications Group (CH0267291224)	Stück		44 600
BASF Reg. (DE000BASF111)	Stück		11 400
Capital Stage (DE0006095003)	Stück		252 000
Deutsche Post Reg. (DE0005552004)	Stück		106 300
DEUTZ (DE0006305006)	Stück		431 000
Gerresheimer (DE000A0LD6E6)	Stück		51 400
Koninklijke DSM (NL0000009827)	Stück		45 400
Lanxess (DE0005470405)	Stück		54 067
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton (C.R.) (FR0000121014)	Stück		18 970
MTU Aero Engines Reg. (DE000A0D9PT0)	Stück		106 500
Wacker Neuson (DE000WACK012)	Stück		76 500
Paysafe Group (GB0034264548)	Stück	64 000	668 000
Hengdeli Holdings (KYG450481083)	Stück		22 847 000
Texwinca Holdings (BMG877021068)	Stück		2 671 000
KDDI Corp. (JP3496400007)	Stück		56 000
Hyundai Motor Co. (KR7005380001)	Stück	27 000	32 800
Allergan (IE00BY9D5467)	Stück	6 100	9 700
Applied Materials (US0382221051)	Stück	42 400	152 000
Cisco Systems (US17275R1023)	Stück		188 000
Expedia (US30212P3038)	Stück		16 600
Facebook Cl.A (US30303M1027)	Stück	18 900	18 900
General Motors Co. (US37045V1008)	Stück	40 000	40 000
JPMorgan Chase & Co. (US46625H1005)	Stück		16 100
MMC Norilsk Nickel (Sp. ADR) (US55315J1025)	Stück		165 600
PayPal Holdings (US70450Y1038)	Stück		234 400
Praxair (US74005P1049)	Stück		34 000
Sysco Corp. (US8718291078)	Stück		13 000
Vimpelcom ADR (US92719A1060)	Stück	348 000	632 000
Vipshop Holdings (US92763W1036)	Stück	214 800	214 800
Wells Fargo & Co. (US9497461015)	Stück		32 300

Nicht notierte Wertpapiere

Aktien

KUKA (applied for sale) (DE000A2BPXK1)	Stück		20 300
--	-------	--	--------

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

Devisenterminkontrakte

Kauf von Devisen auf Termin

EUR/JPY	EUR	866
---------	-----	-----

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

unbefristet	EUR	38 043
-------------	-----	--------

Gattung: Atlantica Yield (GB00BLP5YB54), AutoIiv (US0528001094), Clariant Reg. (CH0012142631), Hengdeli Holdings (KYG450481083), LafargeHolcim Reg. (CH0012214059), Novo-Nordisk B (DK0060534915), Total (FR0000120271), Trelleborg B (Free) (SE0000114837), u-blox Holding Reg. (CH0033361673)

Astra-Fonds

Anhang gemäß § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert: EUR 263,94

Umlaufende Anteile: 1 306 033,226

Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände:

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

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

Die in diesem Bericht ausgewiesenen Anlagen werden nicht Teil zu abgeleiteten Verkehrswerten bewertet.

Astra-Fonds

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	23 261 721,43	-	-
in % des Fondsvermögens	6,75	-	-
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name	J.P. Morgan Securities PLC		
Bruttovolumen offene Geschäfte	14 465 311,25		
Sitzstaat	Großbritannien		
2. Name	UBS AG, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	3 344 089,79		
Sitzstaat	Großbritannien		
3. Name	Merrill Lynch International Ltd.		
Bruttovolumen offene Geschäfte	2 795 820,39		
Sitzstaat	Großbritannien		
4. Name	UniCredit Bank AG		
Bruttovolumen offene Geschäfte	2 656 500,00		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
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			

Astra-Fonds

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	23 261 721,43	-	-

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

Art(en):			
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	530 766,73	-	-
Aktien	20 880 801,91	-	-
Sonstige	3 002 829,19	-	-

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.

Astra-Fonds

6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten		
Wahrung(en):	SEK; JPY; USD; EUR; GBP	-
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	24 414 397,83	-
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)		
Ertragsanteil des Fonds		
absolut	8 965,27	-
in % der Bruttoertrage	60,00	-
Kostenanteil des Fonds	-	-
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft		
absolut	5 976,65	-
in % der Bruttoertrage	40,00	-
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	23 261 721,43	
Anteil	6,97	
11. Die 10 groten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps		
1. Name	Airbus SE	
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2 682 973,00	
2. Name	Orbital ATK Inc.	
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1 367 994,95	

Astra-Fonds

3. Name	Bank of Ireland (The Governor and Company of the)		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1 367 993,06		
4. Name	Taiko Pharmaceutical Co. Ltd.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1 367 987,10		
5. Name	INC Research Holdings Inc.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1 367 984,65		
6. Name	Cheesecake Factory Inc.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1 367 968,92		
7. Name	Stabilus S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1 367 933,71		
8. Name	Saga PLC		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1 367 794,74		
9. Name	Ingevity Corp.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	630 908,45		
10. Name	Lancaster Colony Corp.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	543 138,37		

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	-	-

Astra-Fonds

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

Gesamtzahl Verwahrer/ Kontoführer	2	-	-
1. Name	Bank of New York		
verwahrter Betrag absolut	21 572 112,83		
2. Name	State Street Bank		
verwahrter Betrag absolut	2 842 285,00		

TER für Anleger in der Schweiz

Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio (TER)) für Fonds mit Registrierung in der Schweiz im Zeitraum vom 1.7.2016 bis 30.6.2017		
Fonds	ISIN	TER ¹⁾²⁾
Astra-Fonds	DE0009777003	1,60

¹⁾ Die Gesamtkostenquote drückt die Summe der Kosten und Gebühren (ohne Transaktionskosten) als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvolumens innerhalb eines Jahres aus (TER inkl. erfolgsabhängiger Vergütung gemäss SFAMA-Richtlinie).

²⁾ Der TER-Ausweis in den Vermögensaufstellungen und Ertrags- und Aufwandsrechnungen zu den Jahresberichten kann hiervon abweichen, da er nach BVI-Methode ermittelt wurde.

Kapitalverwaltungsgesellschaft

Deutsche Asset Management
Investment GmbH
60612 Frankfurt
Haftendes Eigenkapital am 31.12.2016:
179 Mio. Euro
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital
am 31.12.2016: 115 Mio. Euro

Aufsichtsrat

Nicolas Moreau
Deutsche Bank AG, London
Vorsitzender

Christof von Dryander
Deutsche Bank AG,
Frankfurt am Main
stellv. Vorsitzender

Hans-Theo Franken
Deutsche Vermögensberatung AG,
Frankfurt am Main

Dr. Alexander Ilgen
Deutsche Bank AG,
Frankfurt am Main

Dr. Stefan Marcinowski
Ludwigshafen

Friedrich von Metzler
Teilhaber des Bankhauses
B. Metzler seel. Sohn & Co. KGaA,
Frankfurt am Main

Alain Moreau
Deutsche Bank AG,
Frankfurt am Main

Prof. Christian Strenger
Frankfurt am Main

Ute Wolf
Evonik Industries AG,
Essen

Verwahrstelle

State Street Bank International GmbH
Briener Straße 59
80333 München
Eigenmittel nach Feststellung des
Jahresabschlusses am 31.12.2016:
2.200,9 Mio. Euro
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital
am 31.12.2016: 109,3 Mio. Euro

Geschäftsführung

Holger Naumann
Sprecher der Geschäftsführung
Geschäftsführer der
DWS Holding & Service GmbH,
Frankfurt am Main
Vorsitzender des Aufsichtsrates der
Deutsche Asset Management S.A.,
Luxemburg

Mitglied des Verwaltungsrates der
Sal. Oppenheim jr. & Cie. Luxemburg S.A.,
Luxemburg

Mitglied des Aufsichtsrates der
Sal. Oppenheim jr. & Cie. AG & KGaA,
Köln

Mitglied des Aufsichtsrates der
Sal. Oppenheim jr. & Cie. Komplementär AG,
Köln

Reinhard Bellet
Geschäftsführer der
DWS Holding & Service GmbH,
Frankfurt am Main
Mitglied des Aufsichtsrates der
Deutsche Asset Management S.A.,
Luxemburg

Stefan Kreuzkamp
Geschäftsführer der
DWS Holding & Service GmbH,
Frankfurt am Main
Mitglied des Aufsichtsrates der
Deutsche Asset Management S.A.,
Luxemburg

Dr. Matthias Liermann
Geschäftsführer der
DWS Holding & Service GmbH,
Frankfurt am Main
Mitglied des Aufsichtsrates der
Deutsche Asset Management S.A.,
Luxemburg

Mitglied des Verwaltungsrates der
Oppenheim Asset Management
Services S.à.r.l.,
Luxemburg

Mitglied des Aufsichtsrates der
Deutsche Treuinvest Stiftung,
Frankfurt am Main

Thorsten Michalik
Geschäftsführer der
DWS Holding & Service GmbH,
Frankfurt am Main

Petra Pflaum
Geschäftsführer der
DWS Holding & Service GmbH,
Frankfurt am Main

**Gesellschafter der
Deutsche Asset Management
Investment GmbH**

DWS Holding & Service GmbH,
Frankfurt am Main

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