

Deutsche Asset Management Investment GmbH

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Halbjahresbericht 2018



FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Inhalt

Halbjahresbericht 2018
vom 1.1.2018 bis 30.6.2018 (gemäß § 103 KAGB)

Hinweise	2
Hinweise für Anleger in Luxemburg	3
Halbjahresbericht FOS Rendite und Nachhaltigkeit	6
Vermögensaufstellung zum Halbjahresbericht	8

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 vom 30. Juni 2018** 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

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. Rücknahme- und Umtauschanträge eingereicht werden, die Anleger kostenlos sämtliche Informationen, wie Verkaufsprospekt samt Anlagebedingungen, „Wesentliche Anlegerinformationen“, Jahres- und Halbjahresberichte sowie die Ausgabe- und Rücknahmepreise erhalten und sonstige Angaben und Unterlagen erfragen bzw. einsehen, Zahlungen an die Anteilinhaber weitergeleitet werden.

Zudem sind Jahres- und Halbjahresberichte in elektronischer Form über die Internetseiten funds.deutscheam.com/lu und www.bundesanzeiger.de erhältlich.

Halbjahresbericht

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

FOS Rendite und Nachhaltigkeit Wertentwicklung der Anteilklassen (in Euro)		
Anteilklasse	ISIN	6 Monate
Klasse A	DE000DWS0XF8	-2,6%
Klasse B	DE000DWS2S93	-3,0% ¹⁾

¹⁾ Klasse B aufgelegt am 2.1.2018

Wertentwicklung nach BVI-Methode, d. h. ohne Berücksichtigung des Ausgabeaufschlages. Wertentwicklungen der Vergangenheit ermöglichen keine Prognose für die Zukunft. Stand: 30.6.2018

Überblick über die Anteilklassen		
ISIN-Code	A	DE000DWS0XF8
	B	DE000DWS2S93
Wertpapierkennnummer (WKN)	A	DWS0XF
	B	DWS2S9
Fondswährung		EUR
Anteilklassenwährung	A	EUR
	B	EUR
Erstzeichnungs- und Auflegungsdatum	A	3.9.2009 (ab 27.9.2017 als Anteilklasse A)
	B	2.1.2018
Ausgabeaufschlag	A	3%
	B	3%
Verwendung der Erträge	A	Ausschüttung
	B	Ausschüttung
Kostenpauschale	A	0,9% p.a.
	B	0,9% p.a.
Mindestanlagesumme	A	Keine
	B	Keine
Erstausgabepreis	A	EUR 103 (inklusive Ausgabeaufschlag)
	B	Anteilwert der Anteilklasse FOS Rendite und Nachhaltigkeit A am Auflegungstag der Anteilklasse B zusätzlich Ausgabeaufschlag

Vermögensaufstellung zum Halbjahresbericht

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Vermögensübersicht

	Bestand in TEUR	%-Anteil am Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände		
1. Aktien (Branchen):		
Industrien	40 348	4,06
Gesundheitswesen	38 860	3,91
Informationstechnologie	24 190	2,43
Finanzsektor	23 790	2,39
Hauptverbrauchsgüter	22 305	2,24
Grundstoffe	15 038	1,51
Energie	10 465	1,05
Versorger	9 278	0,93
Dauerhafte Konsumgüter	8 233	0,83
Sonstige	7 755	0,78
Telekommunikationsdienste	6 707	0,67
Summe Aktien:	206 969	20,80
2. Anleihen (Emittenten):		
Institute	277 202	27,86
Sonst. Finanzierungsinstitutionen	190 883	19,19
Zentralregierungen	76 543	7,69
Unternehmen	64 852	6,52
Sonstige öffentliche Stellen	3 054	0,31
Summe Anleihen:	612 534	61,57
3. Zertifikate	18 077	1,82
4. Investmentanteile	101 299	10,18
5. Derivate	-1 371	-0,13
6. Bankguthaben	54 863	5,51
7. Sonstige Vermögensgegenstände	3 290	0,33
II. Verbindlichkeiten		
1. Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme	-11	0,00
2. Sonstige Verbindlichkeiten	-747	-0,08
III. Fondsvermögen	994 903	100,00

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

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Vermögensaufstellung zum 30.06.2018

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						822 630 882,31	82,69
Aktien							
Geberit Reg. Disp. (CH0030170408) (N)	Stück	17 000			CHF 426,3000	6 265 052,95	0,63
Swisscom Reg. (CH0008742519) (N) ³⁾	Stück	17 500	3 000		CHF 443,3000	6 706 505,30	0,67
Coloplast B (DK0060448595) (N)	Stück	55 100		38 900	DKK 639,8000	4 730 768,87	0,48
Novo-Nordisk B (DK0060534915) (N)	Stück	230 000			DKK 296,3500	9 146 789,05	0,92
alstria office REIT (DE000A0LD2U1) (N)	Stück	604 428	180 000		EUR 12,8300	7 754 811,24	0,78
Aurubis (DE0006766504) (N)	Stück	54 500	8 000		EUR 65,7000	3 580 650,00	0,36
Banco Santander Reg. (ES0113900J37) (N)	Stück	1 310 000	430 000		EUR 4,6405	6 079 055,00	0,61
BNP Paribas (FR0000131104) (N)	Stück	100 500			EUR 53,3700	5 363 685,00	0,54
Compagnie de Saint-Gobain (C.R.) (FR0000125007) (N)	Stück	170 000	82 000		EUR 38,7150	6 581 550,00	0,66
CRH (IE0001827041) (N)	Stück	200 000			EUR 30,3600	6 072 000,00	0,61
Daldrup & Söhne (DE0007830572) (N)	Stück	105 567	105 567		EUR 9,3000	981 773,10	0,10
Deutsche Pfandbriefbank (DE0008019001) (N)	Stück	575 000	75 000	86 983	EUR 11,9000	6 842 500,00	0,69
Deutsche Post Reg. (DE0005552004) (N)	Stück	200 000	200 000		EUR 28,0400	5 608 000,00	0,56
ENCAVIS (DE0006095003) (N)	Stück	476 654	95 601		EUR 6,2100	2 960 021,34	0,30
Henkel Ord. (DE0006048408) (N)	Stück	65 000	15 000		EUR 95,7500	6 223 750,00	0,63
INDUS Holding (DE0006200108) (N)	Stück	115 565			EUR 53,5000	6 182 727,50	0,62
Infineon Technologies Reg. (DE0006231004) (N)	Stück	260 000			EUR 21,7500	5 655 000,00	0,57
innogy (DE000A2AADD2) (N)	Stück	172 048			EUR 36,7200	6 317 602,56	0,63
L'Oreal (FR0000120321) (N)	Stück	43 000	8 000		EUR 210,4000	9 047 200,00	0,91
Merck (DE0006599905) (N)	Stück	101 300	33 300		EUR 83,7800	8 486 914,00	0,85
OSRAM Licht (DE000LED4000) (N)	Stück	141 000		20 000	EUR 35,5100	5 006 910,00	0,50
Schneider Electric (FR0000121972) (N)	Stück	85 000			EUR 71,5400	6 080 900,00	0,61
Siemens Healthineers (DE000SHL1006) (N)	Stück	168 024	168 024		EUR 36,0500	6 057 265,20	0,61
Snam (IT0003153415) (N)	Stück	1 413 000	250 000		EUR 3,5780	5 055 714,00	0,51
Total (FR0000120271) (N)	Stück	84 500	20 000		EUR 52,4000	4 427 800,00	0,45
Valéo (FR0013176526) (N) ³⁾	Stück	73 500	11 000		EUR 47,0100	3 455 235,00	0,35
Legal & General Group (GB0005603997) (N)	Stück	1 835 000			GBP 2,6550	5 504 378,04	0,55
Alcoa Corp. (US0138721065) (N)	Stück	135 000			USD 46,4700	5 384 935,62	0,54
Cigna (US1255091092) (N)	Stück	28 000	28 000		USD 169,7600	4 080 068,67	0,41
Cisco Systems (US17275R1023) (N)	Stück	115 000	115 000		USD 42,9400	4 238 712,45	0,43
Cummins (US2310211063) (N)	Stück	33 300			USD 133,2400	3 808 490,99	0,38
General Electric (US3696041033) (N)	Stück	68 700	68 700		USD 13,8300	815 554,51	0,08
Gildan Activewear (Sub. Vtg.) (CA3759161035) (N)	Stück	200 000			USD 27,8300	4 777 682,40	0,48
Intel Corp. (US4581401001) (N)	Stück	126 500		43 500	USD 49,2500	5 347 746,78	0,54
Microsoft Corp. (US5949181045) (N)	Stück	105 700	21 300		USD 98,6300	8 948 661,80	0,90
The Procter & Gamble (US7427181091) (N)	Stück	105 000	40 000		USD 78,0500	7 034 549,36	0,71
Verzinsliche Wertpapiere							
1,8750 % 3M 13/15.11.21 (XS0982713686) (N)	EUR	5 000	3 000		% 106,2020	5 310 100,00	0,53
0,9500 % 3M 15/15.05.23 MTN (XS1234370127) (N)	EUR	5 000			% 103,2210	5 161 050,00	0,52
0,7500 % ABN AMRO Bank 15/09.06.20 MTN (XS1244060486) (N) ³⁾	EUR	10 000			% 101,5550	10 155 500,00	1,02
0,1250 % African Development Bank 16/07.10.26 MTN (XS1501560848) (N)	EUR	10 000			% 95,9440	9 594 400,00	0,96
0,5000 % Berlin Hyp 16/26.09.23 IHS (DE000BHYOGU5) (N)	EUR	7 000			% 99,9090	6 993 630,00	0,70
0,1250 % Berlin Hyp 17/23.10.23 S.201 PF (DE000BHYOGH2) (N) ³⁾	EUR	6 305			% 99,7540	6 289 489,70	0,63
0,8750 % BMW Finance 15/17.11.20 MTN (XS1321956333) (N)	EUR	9 000			% 102,0130	9 181 170,00	0,92
1,0000 % BMW Finance 16/15.02.22 MTN (XS1363560977) (N)	EUR	6 150			% 102,8930	6 327 919,50	0,64
0,7500 % BNP Paribas 16/11.11.22 MTN (XS1394103789) (N)	EUR	5 000			% 101,2800	5 064 000,00	0,51
1,1250 % BNP Paribas 17/10.10.23 MTN (XS1547407830) (N) ³⁾	EUR	6 000			% 99,9280	5 995 680,00	0,60
1,3750 % Caisse Amortism. Dette Soc. 14/25.11.24 MTN (FR0012159812) (N)	EUR	4 000			% 107,4830	4 299 320,00	0,43
0,6250 % CaixaBank 15/12.11.20 PF (ES040609305) (N) ³⁾	EUR	6 600			% 101,6760	6 710 616,00	0,67
1,0000 % CaixaBank 16/08.02.23 PF (ES040609313) (N)	EUR	2 000			% 103,1890	2 063 780,00	0,21
0,1250 % Council of Europe Development Bank 17/10.04.24 MTN (XS1594302868) (N)	EUR	2 000			% 99,9220	1 998 440,00	0,20
2,3750 % Credit Agricole (London Br.) 14/20.05.24 MTN (XS1069521083) (N)	EUR	2 000			% 109,1600	2 183 200,00	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
0,7500 % Credit Agricole (London Br.) 16/01.12.22 MTN (XS1425199848) (N)	EUR	7 000			% 101,3010	7 091 070,00	0,71
7,8750 % Crédit Agricole 09/und. (FR0010814434) (N) ³⁾	EUR	400			% 109,3690	437 476,00	0,04
1,1250 % CW Bank of Australia 18/18.01.28 MTN (XS1750349190) ³⁾ (N)	EUR	5 000	5 000		% 98,6160	4 930 800,00	0,50
0,6250 % Daimler 15/05.03.20 MTN (DE000A168650) (N)	EUR	6 020			% 101,1190	6 087 363,80	0,61
0,6250 % Deutsche Kreditbank 16/08.06.21 (DE000GRN0008) (N)	EUR	9 000	2 000		% 100,9820	9 088 380,00	0,91
0,7500 % Deutsche Kreditbank 17/26.09.24 (DE000GRN0016) (N) ³⁾	EUR	4 500			% 99,5100	4 477 950,00	0,45
0,6250 % DNB Boligkredit 18/19.06.25 MTN PF (XS1839888754) (N)	EUR	8 050	8 050		% 100,5130	8 091 296,50	0,81
0,8000 % GE Capital European Funding 15/21.01.22 MTN (XS1169353254) (N)	EUR	6 000			% 101,4950	6 089 700,00	0,61
0,6880 % Geberit International 15/30.03.21 (XS1117297942) (N)	EUR	5 000			% 101,6310	5 081 550,00	0,51
0,1000 % Germany 12/15.04.23 INFL (DE0001030542) (N) ³⁾	EUR	5 000			% 108,2760	5 767 808,38	0,58
0,1000 % Germany 15/15.04.26 INFL (DE0001030567) (N) ³⁾	EUR	15 000			% 111,3870	17 325 245,37	1,74
0,5000 % Iceland 17/20.12.22 MTN (XS1738511978) (N)	EUR	5 000			% 100,7485	5 037 425,00	0,51
8,3750 % Intesa Sanpaolo 09/und. (XS0456541506) (N)	EUR	8 000			% 106,4980	8 519 840,00	0,86
0,6250 % Intesa Sanpaolo 16/23.03.23 MTN PF (IT0005174492) (N)	EUR	5 000	2 000		% 100,1640	5 008 200,00	0,50
2,6250 % Latvia 14/21.01.21 MTN Reg S (XS1017763100) (N)	EUR	4 000			% 107,1450	4 285 800,00	0,43
0,5000 % Latvia 15/15.12.20 MTN (XS1333704713) (N) ³⁾	EUR	4 000			% 101,4050	4 056 200,00	0,41
0,5000 % LB Baden-Württemberg 17/07.06.22 S.783 IHS MTN (DE000LB1DVL8) (N)	EUR	5 400			% 100,3670	5 419 818,00	0,54
0,2000 % LB Baden-Württemberg 17/13.12.21 S.790 MTN (DE000LB1M214) (N)	EUR	8 000			% 99,9770	7 998 160,00	0,80
1,2500 % Lithuania 15/22.10.25 MTN (XS1310032187) (N) ³⁾	EUR	3 000			% 103,7780	3 113 340,00	0,31
1,3750 % Merck Financial Services 15/01.09.22 MTN (XS1284570626) (N)	EUR	5 000			% 104,5620	5 228 100,00	0,53
1,8750 % National Australia Bank 12/13.01.23 MTN PF (XS0864360358) (N)	EUR	5 000		3 000	% 107,4570	5 372 850,00	0,54
0,1250 % Nederlandse Financierings-Maat 17/01.06.23 MTN (XS1622394143) (N)	EUR	6 600			% 100,4210	6 627 786,00	0,67
0,2500 % Nederlandse Waterschapsbank 17/07.06.24 MTN (XS1626191107) (N)	EUR	9 310			% 100,2020	9 328 806,20	0,94
0,1250 % Nordic Investment Bank 16/10.06.24 MTN (XS1431730388) (N) ³⁾	EUR	6 000			% 99,9550	5 997 300,00	0,60
0,0000 % Sanofi 16/13.09.22 MTN (FR0013201621) (N)	EUR	10 000			% 99,1110	9 911 100,00	1,00
0,5000 % Santander Consumer Finance 17/04.10.21 MTN (XS1690133811)	EUR	2 100			% 100,2030	2 104 263,00	0,21
2,3750 % SBAB Bank 13/04.09.20 MTN (XS0968885623) (N)	EUR	10 000			% 105,1730	10 517 300,00	1,06
0,5000 % SBAB Bank 16/11.05.21 MTN (XS1392159825) (N) ³⁾	EUR	5 000			% 101,0560	5 052 800,00	0,51
0,2500 % SBAB Bank 17/07.09.22 MTN (XS1678974525) (N)	EUR	3 000	3 000		% 99,5340	2 986 020,00	0,30
1,9500 % Spain 16/30.04.26 (ES0000012729) (N)	EUR	4 000			% 106,9170	4 276 680,00	0,43
1,1250 % Statkraft 17/20.03.25 MTN (XS1582205040) (N)	EUR	5 000	2 500		% 101,3590	5 067 950,00	0,51
0,3750 % Swedish Covered Bond 17/16.02.24 MTN PF (XS1550143421) ³⁾	EUR	8 000	3 000		% 100,2850	8 022 800,00	0,81
2,6250 % Telefonica Europe 17/und (XS1731823255) (N)	EUR	7 000		1 200	% 93,7160	6 560 120,00	0,66
0,8750 % TenneT Holding 15/04.06.21 MTN (XS1241581179) (N)	EUR	5 500			% 102,2450	5 623 475,00	0,57
1,0000 % TenneT Holding 16/13.06.26 MTN (XS1432384664) (N) ³⁾	EUR	7 000			% 100,2140	7 014 980,00	0,71
0,7500 % TenneT Holding 17/26.06.25 MTN (XS1632897762) (N)	EUR	6 280			% 99,4350	6 244 518,00	0,63
0,5000 % Toronto-Dominion Bank 17/03.04.24 MTN PF (XS1588284056) (N)	EUR	8 000			% 100,5780	8 046 240,00	0,81
0,6250 % UNEDIC 16/03.03.26 MTN (FR0013128584) (N)	EUR	3 000			% 101,8040	3 054 120,00	0,31
1,3750 % Westpac Banking 13/17.04.20 MTN PF (XS0918557124) (N)	EUR	5 000			% 102,9040	5 145 200,00	0,52

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
1,5000 % Westpac Banking 14/24.03.21 MTN PF (XS1047122665) (N)	EUR	6 000			% 104,3130	6 258 780,00	0,63
0,2500 % Westpac Banking 16/17.01.22 MTN (XS1506396974) (N)	EUR	7 000			% 99,6190	6 973 330,00	0,70
0,6250 % Westpac Banking 17/22.11.24 MTN (XS1722859532) (N)	EUR	6 160		2 500	% 98,3340	6 057 374,40	0,61
1,5060 % AEGON 95/und. (NL0000120004) (N)	NLG	16 500	5 500		% 80,7500	6 046 054,15	0,61
4,2600 % AEGON 96/und. (NL0000120889) (N)	NLG	10 000			% 95,3000	4 324 525,46	0,43
5,1850 % AEGON 96/und. (NL0000121416) (N)	NLG	28 000			% 81,2500	10 323 499,92	1,04
8,3750 % Crédit Agricole 09/und. Reg S (USF22797FK97) (N)	USD	1 000			% 104,5000	896 995,71	0,09
7,6250 % LB Baden-Württemberg 93/01.02.23 (US514886AC47) (N)	USD	3 700			% 118,0910	3 750 530,28	0,38
Verbriefte Geldmarktinstrumente							
0,6765 % AEGON 04/und. (NL0000116150) (N) ³⁾	EUR	13 000			% 74,8220	9 726 860,00	0,98
0,0000 % Akzo Nobel 17/08.11.19 MTN (XS1715353105) (N)	EUR	2 600			% 100,2800	2 607 280,00	0,26
1,3800 % AXA 03/und. MTN (XS0179060974) (N) ³⁾	EUR	5 000	1 000		% 85,5000	4 275 000,00	0,43
1,1530 % AXA 03/und. MTN (XS0181369454) (N) ³⁾	EUR	12 000	1 000		% 80,0000	9 600 000,00	0,96
1,0880 % AXA 04/und. MTN (XS0203470157) (N)	EUR	16 000	4 000		% 80,2350	12 837 600,00	1,29
1,1380 % BA-CA Finance (Cayman) 04/und. (DE000A0DD4K8)	EUR	9 000			% 88,5800	7 972 200,00	0,80
1,1780 % Ba-Ca Finance 2 05/Und. (DE000A0DYW70)	EUR	5 000			% 88,5000	4 425 000,00	0,44
1,1630 % Banco Santander 04/und. (DE000A0DEJU3) (N)	EUR	2 300	1 000		% 83,2500	1 914 750,00	0,19
1,0090 % Banco Santander 04/Und. (XS0202197694) (N)	EUR	9 084	4 300		% 83,1060	7 549 349,04	0,76
1,2790 % Banco Santander 04/und. (XS0206920141) (N)	EUR	1 100			% 93,6640	1 030 304,00	0,10
4,6250 % Caixabank 07/04.06.19 PF (ES0414970402) (N) ³⁾	EUR	8 000			% 104,5000	8 360 000,00	0,84
1,1120 % Crédit Agricole 05/und (FR0010161026) (N)	EUR	15 000	3 000		% 85,8150	12 872 250,00	1,29
0,1640 % Deutsche Hypothekenbank 13/13.11.20 IHS MTN (DE000DHY4176) (N)	EUR	1 000			% 99,3770	993 770,00	0,10
0,9780 % Deutsche Postbank Funding Trust I 04/und. pref. (DE000A0DEN75) (N)	EUR	16 000	5 000		% 81,4200	13 027 200,00	1,31
1,0670 % Deutsche Postbank Funding Trust III 05/und. pref. (DE000A0D24Z1) (N)	EUR	7 500	3 000		% 81,5000	6 112 500,00	0,61
1,1790 % DZ Bank Capital Fdg. III 05/und. Tr.Pref. (DE000A0DZTE1) (N)	EUR	10 500			% 99,5000	10 447 500,00	1,05
2,1720 % DZ BANK Capital Funding Trust I 03/und. (DE0009078337) (N)	EUR	5 000			% 100,3025	5 015 125,00	0,50
1,2740 % DZ Bank Capital Funding Trust II 04/und. (DE000A0DCXA0) (N)	EUR	8 387	1 045		% 99,7500	8 366 032,50	0,84
0,4740 % DZ BANK Perp. Issuer Funding Jersey 06/und. MTN (DE000A0GMRS6) (N)	EUR	500	500		% 88,5000	442 500,00	0,04
0,4790 % DZ BANK Perp. Issuer Funding Jersey 06/und. MTN (DE000A0GWWW7) (N)	EUR	500	500		% 87,5000	437 500,00	0,04
0,3750 % LB Baden-Württemberg 16/29.01.19 S.757 IHS MTN (XS1353555003) (N)	EUR	2 000		2 000	% 100,3540	2 007 080,00	0,20
0,0000 % LB Baden-Württemberg 17/27.03.20 IHS (DE000LB1DTE7) (N)	EUR	8 000			% 100,0670	8 005 360,00	0,80
1,0590 % NIBC Bank 06/Und. (XS0249580357) (N)	EUR	9 000	9 000		% 83,6250	7 526 250,00	0,76
1,0900 % RZB Finance (Jersey) III 04/und. (XS0193631040) ³⁾	EUR	9 000			% 92,9530	8 365 770,00	0,84
4,5000 % Norway 08/22.05.19 (NO0010429913) (N)	NOK	300 000			% 103,3270	32 680 663,99	3,28
2,9530 % AEGON 04/und. (NL0000116168) (N)	USD	5 500			% 78,4980	3 705 914,16	0,37
2,9210 % AXA 04/und. MTN (XS0185672291) (N)	USD	4 000			% 81,4080	2 795 124,46	0,28
2,5280 % BNP Paribas 86/und (FR0008131403) (N)	USD	8 000			% 71,7780	4 928 961,37	0,50
2,5842 % CW Bank of Australia 86/und. (GB0008424284) (N)	USD	3 000			% 83,3470	2 146 274,68	0,22
2,3261 % DNB Bank 86/und. (GB0040940875) (N)	USD	9 000		1 000	% 71,7020	5 539 210,30	0,56
2,3750 % DNB Bank 86/und. (GB0042636166) (N)	USD	3 000			% 71,7320	1 847 175,97	0,19
3,5000 % KBC Ifima 05/07.02.25 MTN (XS0210976329) (N)	USD	2 500			% 99,4720	2 134 592,27	0,21
2,6812 % National Australia Bank 86/und. (GB0006241326) (N)	USD	4 000			% 89,5040	3 073 098,71	0,31
2,6875 % Nordea Bank (Norge Branch) 86/Und. (GB0001961928) (N) ³⁾	USD	9 900	1 000		% 84,5740	7 186 975,11	0,72
2,6187 % Westpac Banking 86/und (GB0009573998) (N)	USD	8 500			% 76,4770	5 579 866,95	0,56

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Wertpapierbezeichnung	Stück bzw. Whg. in 1000	Bestand	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	%-Anteil am Fondsvermögen
Zertifikate							
Soc. Generale/Equity Basket 07.09.18 Express Cert. (DE000ST0AS13)	Stück	18 000			EUR 1 004,3000	18 077 400,00	1,82
Sonstige Beteiligungswertpapiere							
Roche Holding Profitsch. (CH0012032048) (N)	Stück	33 500			CHF 219,5500	6 358 266,70	0,64
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						14 949 700,43	1,50
Verzinsliche Wertpapiere							
9,0000 % HVB Funding Trust III 99/22.10.31 144a (US404399AA50)	USD	5 940			% 131,5000	6 704 806,87	0,67
Verbriefte Geldmarktinstrumente							
3,5397 % Crédit Agricole 07/und. Reg S (USF22797FJ25) (N)	USD	3 810	1 100		% 91,1600	2 981 284,12	0,30
3,2577 % HSB Group 97/15.07.27 (US40428NAC39) ..	USD	7 000			% 87,6015	5 263 609,44	0,53
Investmentanteile						101 299 270,00	10,18
Gruppenfremde Investmentanteile							
Summe Wertpapiervermögen						938 879 852,74	94,37
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen							
Derivate auf einzelne Wertpapiere						-605 081,03	-0,06
Wertpapier-Optionsrechte (Forderungen / Verbindlichkeiten)							
Optionsrechte auf Aktien							
Put Siemens Reg. 12/2018 Strike 110,00 (EURX)	Stück	-27 200			EUR 5,0500	-137 360,00	-0,01
Put General Electric 09/2018 Strike 18,00 (USS)	Stück	-131 300			USD 4,1500	-467 721,03	-0,05
Zins-Derivate (Forderungen / Verbindlichkeiten)						-527 641,24	-0,05
Zinsterminkontrakte							
EURO-BOBL SEP 18 (EURX)	EUR	-20 000				-128 000,00	-0,01
EURO-BUND SEP 18 (EURX)	EUR	-20 000				-320 000,00	-0,03
US 10YR NOTE SEP 18 (CBT)	USD	-12 000				-79 641,24	-0,01
Devisen-Derivate						-238 485,63	-0,02
Devisentermingeschäfte							
EUR/USD FUTURE (CME) SEP 18	USD	18 750				-238 485,63	-0,02

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
Bankguthaben und nicht verbriefte Geldmarktinstrumente						54 863 476,59	5,51
Bankguthaben						54 863 476,59	5,51
Verwahrstelle (täglich fällig)							
EUR - Guthaben	EUR	1 884 561,14			% 100	1 884 561,14	0,19
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR	2 284,60			% 100	2 284,60	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen							
Australische Dollar	AUD	154,16			% 100	97,82	0,00
Kanadische Dollar	CAD	148,65			% 100	96,53	0,00
Schweizer Franken	CHF	1 260,43			% 100	1 089,63	0,00
Japanische Yen	JPY	34 810,00			% 100	269,83	0,00
Mexikanische Peso	MXN	1 767,55			% 100	77,04	0,00
Termingeld							
EUR - Guthaben (Bayerische Landesbank, München)	EUR	52 975 000,00			% 100	52 975 000,00	5,32
Sonstige Vermögensgegenstände						3 290 133,48	0,33
Zinsansprüche	EUR	3 246 884,67			% 100	3 246 884,67	0,33
Dividendenansprüche	EUR	72,10			% 100	72,10	0,00
Quellensteueransprüche	EUR	20 328,00			% 100	20 328,00	0,00
Sonstige Ansprüche	EUR	22 848,71			% 100	22 848,71	0,00
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme						-11 468,48	0,00
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen							
US Dollar	USD	-13 360,78			% 100	-11 468,48	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten						-747 354,59	-0,08
Verbindlichkeiten aus Kostenpositionen	EUR	-718 715,11			% 100	-718 715,11	-0,07
Andere sonstige Verbindlichkeiten	EUR	-28 639,48			% 100	-28 639,48	0,00
Fondsvermögen						994 903 431,84	100,00

Anteilwert bzw. umlaufende Anteile	Stück bzw. Whg.	Anteilwert in der jeweiligen Whg.
Anteilwert		
Klasse A	EUR	114,65
Klasse B	EUR	114,83
Umlaufende Anteile		
Klasse A	Stück	8 205 604,775
Klasse B	Stück	471 443,000

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

Marktschlüssel

Terminbörsen

EURX	=	Eurex (Eurex Frankfurt/Eurex Zürich)
USS	=	American Stock Options Exchange
CBT	=	Chicago Board of Trade (CBOT)
CME	=	Chicago Mercantile Exchange (CME) - Index and Options Market Division (IOM)

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Devisenkurse (in Mengennotiz)

per 29.06.2018

Australische Dollar	AUD	1,575950	= EUR	1
Kanadische Dollar	CAD	1,539900	= EUR	1
Schweizer Franken	CHF	1,156750	= EUR	1
Dänische Kronen	DKK	7,451850	= EUR	1
Britische Pfund	GBP	0,885100	= EUR	1
Japanische Yen	JPY	129,005000	= EUR	1
Mexikanische Peso	MXN	22,943600	= EUR	1
Niederländische Gulden	NLG	2,203710	= EUR	1
Norwegische Kronen	NOK	9,485150	= EUR	1
US Dollar	USD	1,165000	= EUR	1

Fußnoten

3) Diese Wertpapiere sind ganz oder teilweise als Wertpapier-Darlehen verliehen. Der Gegenwert der verliehenen Wertpapiere beläuft sich auf EUR 76 727 630,18.

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			
Swiss Re Reg. (CH0126881561)	Stück	25 000	85 000
CECONOMY (DE0007257503)	Stück	80 000	253 795
Daimler Reg. (DE0007100000)	Stück	47 000	47 000
MAN Pref. (DE0005937031)	Stück	845	5 845
Société Générale (FR0000130809)	Stück		140 000
Verzinsliche Wertpapiere			
1,0000 % Ireland 16/15.05.26 (IE00BV8C9418)	EUR		5 000
Verbriefte Geldmarktinstrumente			
1,9790 % Capital Funding 02/Und. (DE0007070088)	EUR		3 500
8,2000 % Crédit Agricole 08/und (FR0010603159)	EUR		2 000
0,2470 % ING Groep 03/und. (NL0000113587)	EUR		4 500
0,5800 % ING Groep 04/und. (NL0000116127)	EUR		2 500
8,0470 % Intesa Sanpaolo 08/und (XS0371711663)	EUR		8 000
0,8910 % Nordea Bank 04/und. (XS0200688256)	EUR		15 000

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

	Volumen in 1000
Terminkontrakte	
Zinsterminkontrakte	
Verkaufte Kontrakte: (Basiswerte: EURO-BOBL JUN 18, EURO-BUND JUN 18, US 10YR NOTE JUNE 18)	EUR 69 231
Devisentermingeschäfte	
Gekaufte Kontrakte: (Basiswerte: EUR/USD FUTURE (CME) JUN 18)	EUR 19 049
Optionsrechte	
Wertpapier-Optionsrechte	
Optionsrechte auf Aktien	
Verkaufte Kaufoptionen (Call): (Basiswerte: Société Générale)	EUR 3 542
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: Compagnie de Saint-Gobain (C.R.), Daimler Reg., Intel Corp.)	EUR 8 979
Optionsrechte auf Aktienindex-Derivate	
Optionsrechte auf Aktienindices	
Gekaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: DAX (Performanceindex))	EUR 68 750
Verkaufte Verkaufsoptionen (Put): (Basiswerte: DAX (Performanceindex))	EUR 66 000

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

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

unbefristet

Volumen in 1000
EUR 184 182

Gattung: iShs II-Global Water UCITS ETF USD (Dist.)
(IE00B1TXK627), 1,8750 % 3M 13/15.11.21
(XS0982713686), 0,9500 % 3M 15/15.05.23 MTN
(XS1234370127), 0,0000 % Akzo Nobel 17/08.11.19
MTN (XS1715353105), 1,3800 % AXA 03/und. MTN
(XS0179060974), 1,1530 % AXA 03/und. MTN
(XS0181369454), 1,0880 % AXA 04/und. MTN
(XS0203470157), 1,2790 % Banco Santander 04/und.
(XS0206920141), 1,0000 % BMW Finance 16/15.02.22
MTN (XS1363560977), 0,7500 % BNP Paribas
16/11.11.22 MTN (XS1394103789), 1,1250 % BNP
Paribas 17/10.10.23 MTN (XS1547407830), 1,3750 %
Caisse Amortism. Dette Soc. 14/25.11.24 MTN
(FR0012159812), 4,6250 % Caixabank 07/04.06.19 PF
(ES0414970402), 0,6250 % CaixaBank 15/12.11.20 PF
(ES0440609305), 0,1250 % Council of Europe
Development Bank 17/10.04.24 MTN (XS1594302868),
0,7500 % Credit Agricole (London Br.) 16/01.12.22 MTN
(XS1425199848), 1,1120 % Crédit Agricole 05/und
(FR0010161026), 8,2000 % Crédit Agricole 08/und
(FR0010603159), 1,1250 % CVW Bank of Australia
18/18.01.28 MTN (XS1750349190), 0,7500 % Deutsche
Kreditbank 17/26.09.24 (DE000GRN0016), 1,0670 %
Deutsche Postbank Funding Trust III 05/und. pref.
(DE000A0D24Z1), 1,1790 % DZ Bank Capital Fdg.
III 05/und. Tr.Pref. (DE000A0DZTE1), 0,6880 % Geberit
International 15/30.03.21 (XS1117297942), 8,0470 %
Intesa Sanpaolo 08/und (XS0371711663), 8,3750 %
Intesa Sanpaolo 09/und. (XS0456541506), 0,6250 %
Intesa Sanpaolo 16/23.03.23 MTN PF (IT0005174492),
0,5000 % Latvia 15/15.12.20 MTN (XS1333704713),
0,2000 % LB Baden-Württemberg 17/13.12.21 S.790
MTN (DE000LB1M214), 1,2500 % Lithuania 15/22.10.25
MTN (XS1310032187), 0,2500 % Nederlandse
Waterschapsbank 17/07.06.24 MTN (XS1626191107),
0,0000 % Sanofi 16/13.09.22 MTN (FR0013201621),
0,5000 % SBAB Bank 16/11.05.21 MTN (XS1392159825),
0,2500 % SBAB Bank 17/07.09.22 MTN (XS1678974525),
2,6250 % Telefonica Europe 17/und (XS1731823255),
0,8750 % TenneT Holding 15/04.06.21 MTN (XS1241581179),
1,0000 % TenneT Holding 16/13.06.26 MTN (XS1432384664),
0,7500 % TenneT Holding 17/26.06.25 MTN (XS1632897762),
0,5000 % Toronto-Dominion Bank 17/03.04.24 MTN PF
(XS1588284056), 1,3750 % Westpac Banking 13/17.04.20
MTN PF (XS0918557124), 0,2500 % Westpac Banking
16/17.01.22 MTN (XS1506396974), BNP Paribas
(FR0000131104), Intel Corp. (US4581401001),
Schneider Electric (FR0000121972), Snam
(IT0003153415), Swiss Re Reg. (CH0126881561),
Swisscom Reg. (CH0008742519), Valéo
(FR0013176526), 2,9530 % AEGON 04/und.
(NL0000116168), 8,3750 % Crédit Agricole 09/und.
Reg S (USF22797FK97), 7,6250 % LB
Baden-Württemberg 93/01.02.23 (US514886AC47),
2,6875 % Nordea Bank (Norge Branch) 86/Und.
(GB0001961928), 2,6187 % Westpac Banking
86/und (GB0009573998)

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

Anhang gemäß § 7 Nr. 9 KARBV

Sonstige Angaben

Anteilwert Klasse A: EUR 114,65
Anteilwert Klasse B: EUR 114,83

Umlaufende Anteile Klasse A: 8 205 604,775
Umlaufende Anteile Klasse B: 471 443,000

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 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.

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.

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

	Wertpapierleihe	Pensionsgeschäfte	Total Return Swaps
Angaben in Fondswährung			
1. Verwendete Vermögensgegenstände			
absolut	76 727 630,18	-	-
in % des Fondsvermögens	7,71	-	-
2. Die 10 größten Gegenparteien			
1. Name	Commerzbank AG, Frankfurt		
Bruttovolumen offene Geschäfte	15 234 121,50		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
2. Name	Barclays Bank PLC, London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	12 576 163,58		
Sitzstaat	Großbritannien		
3. Name	Deutsche Bank AG, Frankfurt		
Bruttovolumen offene Geschäfte	11 420 770,00		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
4. Name	UniCredit Bank AG		
Bruttovolumen offene Geschäfte	10 781 185,24		
Sitzstaat	Bundesrepublik Deutschland		
5. Name	Merrill Lynch International Ltd.		
Bruttovolumen offene Geschäfte	9 466 795,36		
Sitzstaat	Großbritannien		
6. Name	Citigroup Global Markets Ltd., London		
Bruttovolumen offene Geschäfte	6 985 201,50		
Sitzstaat	Großbritannien		
7. Name	BNP Paribas S.A. Arbitrage, Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	5 775 081,79		
Sitzstaat	Frankreich		
8. Name	BNP Paribas S.A., Paris		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1 521 075,00		
Sitzstaat	Frankreich		
9. Name	J.P. Morgan Securities PLC		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1 381 220,21		
Sitzstaat	Großbritannien		

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

10. Name	Crédit Suisse Securities (Europe) Ltd.		
Bruttovolumen offene Geschäfte	1 026 000,00		
Sitzstaat	Großbritannien		

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	76 727 630,18	-	-

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

Art(en):			
Bankguthaben	-	-	-
Schuldverschreibungen	39 035 258,08	-	-
Aktien	40 558 367,72	-	-
Sonstige	1 755 979,73	-	-

Qualität(en):

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

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

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

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

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

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

Die Verwaltungsgesellschaft behält sich vor, die Zulässigkeit der oben genannten Sicherheiten einzuschränken.

Des Weiteren behält sich die Verwaltungsgesellschaft vor, in Ausnahmefällen von den oben genannten Kriterien abzuweichen.

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

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

6. Wahrung(en) der erhaltenen Sicherheiten			
Wahrung(en):	GBP; EUR; CAD; USD; JPY; CHF; MXN	-	-
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	81 349 605,53	-	-
8. Ertrags- und Kostenanteile (vor Ertragsausgleich)			
Ertragsanteil des Fonds			
absolut	69 844,97	-	-
in % der Bruttoertrage	60,00	-	-
Kostenanteil des Fonds	-	-	-
Ertragsanteil der Verwaltungsgesellschaft			
absolut	46 562,82	-	-
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. Verleiene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermogensgegenstande des Fonds			
Summe	76 727 630,18		
Anteil	8,17		
11. Die 10 groten Emittenten, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps			
1. Name	European Financial Stability Facility (EFSF)		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	7 126 618,31		
2. Name	Niedersachsen, Land		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	6 275 119,43		

FOS Rendite und Nachhaltigkeit

3. Name	Finnvera PLC		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	5 320 298,78		
4. Name	Credit Suisse Group AG		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	4 401 498,14		
5. Name	The Swatch Group AG		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3 850 762,02		
6. Name	Kreditanstalt für Wiederaufbau		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	3 115 846,36		
7. Name	European Union		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2 609 340,46		
8. Name	Danone S.A.		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	2 158 435,00		
9. Name	Baden-Württemberg, Land		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1 909 234,00		
10. Name	French Republic		
Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)	1 705 898,94		
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	2	-	-
1. Name	State Street Bank		
verwahrter Betrag absolut	51 630 115,39		
2. Name	Bank of New York		
verwahrter Betrag absolut	29 719 490,14		

Kapitalverwaltungsgesellschaft

Deutsche Asset Management
Investment GmbH
60612 Frankfurt
Haftendes Eigenkapital am 31.12.2017:
183,2 Mio. Euro
Gezeichnetes und eingezahltes Kapital am
31.12.2017: 115 Mio. Euro

Aufsichtsrat

Nicolas Moreau
Vorsitzender
Deutsche Bank AG,
Frankfurt am Main
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

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 (bis zum 21.3.2018)
Evonik Industries AG,
Essen

Claire Peel (seit dem 1.7.2018)
DWS Group GmbH & Co. KGaA,
Frankfurt am Main

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

Mitglied der Geschäftsführung der
DWS Holding & Service GmbH,
Frankfurt am Main
Vorsitzender des Aufsichtsrates der
Deutsche Asset Management 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
Vorsitzender des Verwaltungsrates der
Deutsche Asset Management Schweiz AG,
Zürich

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

Dr. Matthias Liermann

Mitglied der Geschäftsführung der
DWS Holding & Service GmbH,
Frankfurt am Main
Mitglied des Aufsichtsrates der
Deutsche Asset Management S.A.,
Luxemburg
Mitglied des Aufsichtsrates der
Deutsche Treuinvest Stiftung,
Frankfurt am Main

Thorsten Michalik

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

Petra Pflaum

Mitglied der Geschäftsführung 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