R.C.S. LUXEMBOURG B 90 412

DJE INVESTMENT S.A.

# FMM-FONDS
# HALBJAHRESBERICHT ZUM 30. JUNI 2022

AUSGABE FÜR DEN ÖFFENTLICHEN VERTRIEB IN DER SCHWEIZ

# INHALTSVERZEICHNIS


| | |
|---|---|
| Besonderer Hinweis für die Anleger | 3 |
| Verwaltung, Vertrieb und Beratung | 4 |
| Vermögensübersicht | 5 |
| Vermögensaufstellung | 7 |
| Während des Berichtszeitraums abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen | 13 |
| Anhang | 17 |




Der Verkaufsprospekt mit integriertem Verwaltungsreglement, die wesentlichen Anlegerinformationen sowie der Jahres- und Halbjahresbericht des Fonds sind am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, der Verwahrstelle, bei den Zahlstellen und der Vertriebsstelle der jeweiligen Vertriebsländer sowie bei dem Vertreter in der Schweiz kostenlos per Post, per Telefax oder per E-Mail erhältlich. Weitere Informationen sind jederzeit während der üblichen Geschäftszeiten bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

Anteilzeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Basis der neuesten Ausgabe des Verkaufsprospektes (einschließlich seiner Anhänge) in Verbindung mit dem letzten erhältlichen Jahresbericht und dem eventuell danach veröffentlichten Halbjahresbericht vorgenommen werden.

# BESONDERER HINWEIS FÜR DIE ANLEGER
(Angaben zu wesentlichen Änderungen gem. § 101 Abs. 3 Nr. 3 KAGB)

## WICHTIGE MITTEILUNG FÜR DIE ANLEGER

ÜBERTRAGUNG DES VERWALTUNGS- UND VERFÜGUNGSRECHTS AUF DIE DJE INVESTMENT S.A.

Mit Genehmigung der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) vom 13. April 2021 hat die ODDO BHF Asset Management GmbH, Düsseldorf, ihr Verwaltungs- und Verfügungsrecht an dem OGAW-Sondervermögen gemäß § 100b KAGB bzw. § 22 Absatz 1 der Allgemeinen Anlagebedingungen mit Wirkung zum 1. Januar 2022 auf die DJE Investment S.A., Strassen, Luxemburg, übertragen.

Ein Wechsel der Verwahrstelle findet nicht statt und die Funktion der Verwahrstelle wird weiterhin von der DZ PRIVAT-BANK S.A. Niederlassung Frankfurt am Main für das oben genannte OGAW-Sondervermögen wahrgenommen.

Vor diesem Hintergrund wurden, mit Genehmigung der BaFin vom 11. August 2021, die Allgemeinen und Besonderen Anlagebedingungen für das oben genannte OGAW-Sondervermögen zum 1. Januar 2022 geändert. Den vollständigen Wortlaut der zukünftigen Allgemeinen Anlagebedingungen finden Sie im Bundesanzeiger sowie auf der Webseite der Gesellschaft unter ,,dje.de".

Luxemburg, im August 2022

DJE Investment S.A.
Der Verwaltungsrat

# VERWALTUNG, VERTRIEB UND BERATUNG

## VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

DJE Investment S.A.
R.C.S. Luxembourg B 90 412
4, rue Thomas Edison
L-1445 Strassen, Luxemburg

## VERWALTUNGSRAT DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT (LEITUNGSORGAN)

(Stand: 30. Juni 2022)

## VORSITZENDER DES VERWALTUNGSRATES

Dr. Jens Ehrhardt
Vorstandsvorsitzender der DJE Kapital AG
Pullach

## GESCHÄFTSFÜHRENDER STELLVERTRETENDER VERWALTUNGSRATSVORSITZENDER

Dr. Ulrich Kaffarnik
Vorstand der DJE Kapital AG
Pullach

## VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER

Dr. Jan Ehrhardt
Stellvertretender Vorstandsvorsitzender
der DJE Kapital AG
Pullach

Peter Schmitz
Vorstand der DJE Kapital AG
Pullach

Thorsten Schrieber
Vorstand der DJE Kapital AG
Pullach

Bernhard Singer
Luxemburg

## GESCHÄFTSFÜHRER DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

Mirko Bono
Stefan-David Grün
Dr. Ulrich Kaffarnik
Dirk Vollkommer

## ZAHLSTELLE, ZENTRALVERWALTUNG SOWIE REGISTER- UND TRANSFERSTELLE

DZ PRIVATBANK S.A.
4, rue Thomas Edison
L-1445 Strassen, Luxemburg

## VERWAHRSTELLE

DZ PRIVATBANK S.A.
Niederlassung Frankfurt am Main
Platz der Republik 6
D-60325 Frankfurt am Main

## ZAHL- UND INFORMATIONSSTELLE BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND

DZ BANK AG
Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank
Platz der Republik
D-60265 Frankfurt am Main

## VERTRIEBS- UND INFORMATIONSSTELLE BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND

DJE Kapital AG
Pullacher Straße 24
D-82049 Pullach

## FONDSMANAGER

DJE Kapital AG
Pullacher Straße 24
D-82049 Pullach

## ABSCHLUSSPRÜFER DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

Deloitte Audit
*Société à responsabilité limitée*
*Cabinet de Révision Agréé*
20, Boulevard de Kockelscheuer
L-1821 Luxemburg

## ABSCHLUSSPRÜFER DES FONDS

Deloitte GmbH
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft
Rosenheimer Platz 4
D-81669 München

## ZUSÄTZLICHE ANGABEN FÜR ÖSTERREICH

*Kontakt- und Informationsstelle*
*gemäß den Bestimmungen nach*
*EU-Richtlinie 2019/1160 Art. 92*

Erste Bank der oesterreichischen
Sparkassen AG
Am Belvedere 1
A-1100 Wien

*Inländischer steuerlicher Vertreter*
*im Sinne des § 186 Abs. 2 Z 2 InvFG 2011*

Erste Bank der oesterreichischen
Sparkassen AG
Am Belvedere 1
A-1100 Wien

## ZUSÄTZLICHE ANGABEN FÜR DIE SCHWEIZ

## ZAHLSTELLE IN DER SCHWEIZ

(seit dem 1. Januar 2022)

Neue Privat Bank AG
Limmatquai 1/am Bellevue
Postfach
CH-8024 Zürich

## VERTRETER IN DER SCHWEIZ

(seit dem 1. Januar 2022)

Neue Privat Bank AG
Limmatquai 1/am Bellevue
Postfach
CH-8024 Zürich

## STAMMDATEN DES FONDS

| | FMM-Fonds |
|---|---|
| WP-Kenn-Nr.: | 847811 |
| ISIN-Code: | DE0008478116 |
| Auflegungsdatum | 17. August 1987 |
| Fondswährung | EUR |
| Ertragsverwendung | thesaurierend |
| Anzahl der Anteile | 768.697,97 |
| Anteilwert (in Fondswährung) | 594,83 |
| Anleger | private Anleger |
| Aktueller Ausgabeaufschlag | bis zu 5 %, derzeit 5 % |
| Rücknahmeabschlag | entfällt |
| Mindestanlagesumme | entfällt |
| Verwaltungsvergütung | bis zu 1,6 % p. a., derzeit 1,55 % |

## VERMÖGENSÜBERSICHT

| | Kurswert in EUR | % des Fondsvermögens [1] |
|---|---|---|
| **I. VERMÖGENSGEGENSTÄNDE** | | |
| **1. Aktien – Gliederung nach Branche** | | |
| Telekommunikationsdienste | 62.556.774,05 | 13,68 |
| Gesundheitswesen | 41.211.149,99 | 9,01 |
| Versorgungsbetriebe | 40.042.904,44 | 8,76 |
| Roh-, Hilfs- u. Betriebsstoffe | 39.889.240,31 | 8,72 |
| Energie | 36.302.960,80 | 7,94 |
| Industrie | 34.435.672,29 | 7,53 |
| Finanzwesen | 28.056.184,09 | 6,14 |
| Basiskonsumgüter | 10.102.329,28 | 2,21 |
| Immobilien | 7.097.493,47 | 1,55 |
| IT | 5.541.665,91 | 1,21 |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 4.945.038,43 | 1,08 |
| **Summe** | **310.181.413,06** | **67,83** |
| **2. Verzinsliche Wertpapiere – Gliederung nach Land/Region** | | |
| Deutschland | 68.078.880,00 | 14,89 |
| Italien | 24.290.257,00 | 5,31 |
| **Summe** | **92.369.137,00** | **20,20** |
| **3. Derivate** | **-4.175.022,59** | **-0,91** |
| **4. Bankguthaben** | **51.176.797,20** | **11,19** |
| **5. Sonstige Vermögensgegenstände** | **19.496.919,59** | **4,26** |
| **Summe** | **469.049.244,26** | **102,57** |
| **II. VERBINDLICHKEITEN** | **-11.801.371,83** | **-2,57** |
| **III. FONDSVERMÖGEN** | **457.247.872,43** | **100,00** |

1 | Aufgrund von Rundungen können sich bei der Addition von Einzelpositionen der nachfolgenden Vermögensaufstellung abweichende Werte zu den oben aufgeführten Prozentangaben ergeben.

## ENTWICKLUNG DES SONDERVERMÖGENS

| | EUR | EUR |
|---|---|---|
| I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres | | 481.034.077,83 |
| 1. Mittelzufluss (netto) | | 2.153.390,07 |
| a) Mittelzuflüsse aus Anteilscheinverkäufen | 48.272.245,89 | -7.673,60 |
| b) Mittelabflüsse aus Anteilscheinrücknahmen | -46.118.855,82 | 9.930.072,45 |
| 2. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich | | -366.355,61 |
| 3. Ergebnis des Geschäftsjahres | | -25.573.239,86 |
| Davon nicht realisierte Gewinne | -37.631.624,49 | -4.063.627,80 |
| Davon nicht realisierte Verluste | -26.007.540,57 | -4.547.388,07 |
| **II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres** | | **457.247.872,43** |

## ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG

(inkl. Ertragsausgleich) für den Zeitraum vom 1. Januar 2022 bis 30. Juni 2022

| | EUR |
|---|---|
| **I. Erträge** | |
| 1. Dividenden inländischer Aussteller | 4.419.817,49 |
| 2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer) | 3.818.131,40 |
| 3. Zinsen aus ausländischen Wertpapieren (vor Quellensteuer) | 504.175,31 |
| 4. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland | -320.660,08 |
| 5. Abzug inländischer Körperschaftsteuer | -433.114,50 |
| 6. Abzug ausländischer Quellensteuer | -479.496,19 |
| 7. Sonstige Erträge | 525,65 |
| **Summe der Erträge** | **7.509.379,08** |
| **II. Aufwendungen** | |
| 1. Zinsen aus Kreditaufnahmen | 1.031,05 |
| 2. Verwaltungsvergütung | 3.683.292,76 |
| 3. Verwahrstellenvergütung | 74.306,79 |
| 4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten | 7.589,91 |
| 5. Sonstige Aufwendungen | 69.677,27 |
| **Summe der Aufwendungen** | **3.835.897,78** |
| **III. Ordentlicher Nettoertrag** | **3.673.481,30** |
| **IV. Veräußerungsgeschäfte** | |
| 1. Realisierte Gewinne | 92.761.839,75 |
| 2. Realisierte Verluste | -58.369.395,85 |
| **Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften** | **34.392.443,90** |
| **III. Ordentlicher Nettoertrag** | **3.673.481,30** |
| **IV. Veräußerungsgeschäfte** | |
| 1. Realisierte Gewinne | 92.761.839,75 |
| 2. Realisierte Verluste | -58.369.395,85 |
| **Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften** | **34.392.443,90** |
| **V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres** | **38.065.925,20** |
| 1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne | -37.631.624,49 |
| 2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste | -26.007.540,57 |
| **VI. Nicht Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres** | **-63.639.165,06** |
| **VII. Ergebnis des Geschäftsjahres** | **-25.573.239,86** |

## VERMÖGENSAUFSTELLUNG

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück | Bestand 30.06.2022 | Käufe Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Fonds-vermögen |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE** | | | | | | | | |
| **Aktien** | | | | | | | | |
| **Bermudas** | | | | | | | | |
| BMG169621056 | Bunge Ltd. | STK | 41.250,00 | 164.500,00 | 123.250,00 | 91,4800 | 3.614.165,31 | 0,79 |
| BMG9456A1009 | Golar LNG Ltd. | STK | 157.300,00 | 157.300,00 | 0,00 | 23,1700 | 3.490.701,08 | 0,76 |
| BMG4069C1486 | Great Eagle Holdings Ltd. | STK | 2.868.000,00 | 0,00 | 0,00 | 17,6000 | 6.162.771,96 | 1,35 |
| BMG5256W1029 | Kingmaker Footwear Holdings Ltd. | STK | 23.092.000,00 | 1.057.000,00 | 0,00 | 0,8600 | 2.424.623,35 | 0,53 |
| | | | | | | | **15.692.261,70** | **3,43** |
| **Cayman Inseln** | | | | | | | | |
| KYG017191142 | Alibaba Group Holding Ltd. | STK | 99.000,00 | 99.000,00 | 0,00 | 111,9000 | 1.352.538,28 | 0,30 |
| KYG525621408 | Kingboard Holdings Ltd. | STK | 283.000,00 | 0,00 | 0,00 | 29,7000 | 1.026.188,56 | 0,22 |
| KYG7082H1276 | Pico Far East Holdings Ltd. | STK | 13.752.000,00 | 0,00 | 0,00 | 1,1200 | 1.880.477,62 | 0,41 |
| | | | | | | | **4.259.204,46** | **0,93** |
| **Dänemark** | | | | | | | | |
| DK0060534915 | Novo-Nordisk AS | STK | 47.840,00 | 26.515,00 | 106.175,00 | 778,7000 | 5.009.009,84 | 1,10 |
| | | | | | | | **5.009.009,84** | **1,10** |
| **Deutschland** | | | | | | | | |
| DE0008404005 | Allianz SE | STK | 25.500,00 | 124.960,00 | 115.870,00 | 181,3600 | 4.624.680,00 | 1,01 |
| DE000BASF111 | BASF SE | STK | 301.140,00 | 373.290,00 | 72.150,00 | 40,4850 | 12.191.652,90 | 2,67 |
| DE0005557508 | Dte. Telekom AG | STK | 2.394.000,00 | 2.766.200,00 | 372.200,00 | 18,8620 | 45.155.628,00 | 9,88 |
| DE0005785604 | Fresenius SE & Co. KGaA | STK | 135.500,00 | 135.500,00 | 0,00 | 28,8300 | 3.906.465,00 | 0,85 |
| DE0008402215 | Hannover Rück SE | STK | 13.067,00 | 16.885,00 | 31.998,00 | 136,8500 | 1.788.218,95 | 0,39 |
| DE000HLAG475 | Hapag-Lloyd AG | STK | 5.058,00 | 0,00 | 0,00 | 248,0000 | 1.254.384,00 | 0,27 |
| DE0008430026 | Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München | STK | 36.500,00 | 73.000,00 | 44.648,00 | 222,1000 | 8.106.650,00 | 1,77 |
| DE000PAH0038 | Porsche Automobil Holding SE -VZ- | STK | 18.740,00 | 18.740,00 | 0,00 | 62,3200 | 1.167.876,80 | 0,26 |
| DE0007037129 | RWE AG | STK | 424.660,00 | 609.730,00 | 882.370,00 | 36,1700 | 15.359.952,20 | 3,36 |
| DE0007274136 | STO SE & Co. KGaA -VZ- | STK | 25.230,00 | 0,00 | 0,00 | 141,2000 | 3.562.476,00 | 0,78 |
| | | | | | | | **97.117.983,85** | **21,24** |
| **Finnland** | | | | | | | | |
| FI0009007132 | Fortum Oyj | STK | 656.800,00 | 1.028.800,00 | 372.000,00 | 14,4550 | 9.494.044,00 | 2,08 |
| FI4000297767 | Nordea Bank Abp | STK | 342.268,00 | 683.268,00 | 2.499.940,00 | 8,4820 | 2.903.117,18 | 0,63 |
| | | | | | | | **12.397.161,18** | **2,71** |
| **Frankreich** | | | | | | | | |
| FR0000125007 | Compagnie de Saint-Gobain S.A. | STK | 94.771,00 | 145.831,00 | 101.060,00 | 40,2300 | 3.812.637,33 | 0,83 |
| FR0000133308 | Orange S.A. | STK | 122.063,00 | 122.063,00 | 0,00 | 11,1920 | 1.366.129,10 | 0,30 |
| FR0000120271 | TotalEnergies SE | STK | 193.861,00 | 496.271,00 | 471.980,00 | 50,5300 | 9.795.796,33 | 2,14 |
| FR0000125486 | VINCI S.A. | STK | 55.719,00 | 55.719,00 | 0,00 | 84,5500 | 4.711.041,45 | 1,03 |
| | | | | | | | **19.685.604,21** | **4,30** |



Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringe Differenzen entstanden sein.

Fortsetzung – Vermögensaufstellung

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück | Bestand 30.06.2022 | Käufe Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Fonds-vermögen |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **Großbritannien** | | | | | | | | |
| GB0009895292 | AstraZeneca Plc. | STK | 11.200,00 | 62.080,00 | 50.880,00 | 108,9400 | 1.420.735,91 | 0,31 |
| | | | | | | | **1.420.735,91** | **0,31** |
| **Hongkong** | | | | | | | | |
| HK0160011786 | Hon Kwok Land Investment Co. Ltd. | STK | 2.911.000,00 | 63.000,00 | 0,00 | 2,6300 | 934.721,51 | 0,20 |
| | | | | | | | **934.721,51** | **0,20** |
| **Irland** | | | | | | | | |
| IE00BZ12WP82 | Linde Plc. | STK | 25.215,00 | 0,00 | 0,00 | 272,9000 | 6.881.173,50 | 1,50 |
| | | | | | | | **6.881.173,50** | **1,50** |
| **Japan** | | | | | | | | |
| JP3942400007 | Astellas Pharma Inc. | STK | 117.000,00 | 234.000,00 | 117.000,00 | 2.115,0000 | 1.739.822,82 | 0,38 |
| JP3197600004 | Ono Pharmaceutical Co. Ltd. | STK | 36.800,00 | 36.800,00 | 0,00 | 3.482,0000 | 900.918,23 | 0,20 |
| JP3463000004 | Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. | STK | 212.500,00 | 593.800,00 | 381.300,00 | 3.818,0000 | 5.704.316,95 | 1,25 |
| | | | | | | | **8.345.058,00** | **1,83** |
| **Jersey** | | | | | | | | |
| JE00B4T3BW64 | Glencore Plc. | STK | 527.820,00 | 1.797.070,00 | 1.269.250,00 | 4,5160 | 2.775.541,59 | 0,61 |
| | | | | | | | **2.775.541,59** | **0,61** |
| **Kanada** | | | | | | | | |
| CA45823T1066 | Intact Financial Corporation | STK | 44.700,00 | 44.700,00 | 0,00 | 180,4800 | 5.987.424,67 | 1,31 |
| CA67077M1086 | Nutrien Ltd. | STK | 81.410,00 | 153.100,00 | 251.490,00 | 82,2600 | 6.413.932,19 | 1,40 |
| | | | | | | | **12.401.356,86** | **2,71** |
| **Niederlande** | | | | | | | | |
| NL0000009082 | Koninklijke KPN NV | STK | 704.000,00 | 704.000,00 | 0,00 | 3,4110 | 2.401.344,00 | 0,53 |
| | | | | | | | **2.401.344,00** | **0,53** |
| **Norwegen** | | | | | | | | |
| NO0010096985 | Equinor ASA | STK | 190.740,00 | 571.940,00 | 583.100,00 | 349,6000 | 6.443.582,67 | 1,41 |
| | | | | | | | **6.443.582,67** | **1,41** |
| **Österreich** | | | | | | | | |
| AT0000741053 | EVN AG | STK | 118.000,00 | 118.000,00 | 70.500,00 | 20,3500 | 2.401.300,00 | 0,53 |
| AT000000STR1 | Strabag SE | STK | 158.739,00 | 42.439,00 | 0,00 | 39,6500 | 6.294.001,35 | 1,38 |
| | | | | | | | **8.695.301,35** | **1,91** |
| **Spanien** | | | | | | | | |
| ES0143416115 | Siemens Gamesa Renewable Energy S.A. | STK | 135.000,00 | 135.000,00 | 0,00 | 17,8650 | 2.411.775,00 | 0,53 |
| | | | | | | | **2.411.775,00** | **0,53** |
| **Südafrika** | | | | | | | | |
| US38059T1060 | Gold Fields Ltd. ADR | STK | 486.100,00 | 961.600,00 | 639.700,00 | 9,3800 | 4.367.031,89 | 0,96 |
| | | | | | | | **4.367.031,89** | **0,96** |
| **Vereinigte Staaten von Amerika** | | | | | | | | |
| US00507V1098 | Activision Blizzard Inc. | STK | 39.360,00 | 39.360,00 | 0,00 | 77,9600 | 2.938.900,11 | 0,64 |
| US02079K1079 | Alphabet Inc. | STK | 2.076,00 | 4.291,00 | 9.275,00 | 2.245,1300 | 4.464.026,32 | 0,98 |
| US0394831020 | Archer Daniels Midland Company | STK | 31.500,00 | 63.000,00 | 31.500,00 | 77,2400 | 2.330.294,03 | 0,51 |

Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringe Differenzen entstanden sein.

Fortsetzung – Vermögensaufstellung

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück/ WHG | Bestand 30.06.2022 | Käufe Zugänge im Berichtszeitraum | Verkäufe Abgänge im Berichtszeitraum | Kurs | Kurswert in EUR | %-Anteil am Fonds-vermögen |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **Vereinigte Staaten von Amerika** | | | | | | | | |
| US09247X1019 | Blackrock Inc. | STK | 7.850,00 | 15.700,00 | 18.480,00 | 617,9600 | 4.646.093,29 | 1,02 |
| US16411R2085 | Cheniere Energy Inc. | STK | 11.100,00 | 11.100,00 | 0,00 | 134,6200 | 1.431.167,51 | 0,31 |
| US1667641005 | Chevron Corporation | STK | 107.562,00 | 174.288,00 | 66.726,00 | 146,9800 | 15.141.713,21 | 3,31 |
| US2091151041 | Consolidated Edison Inc. | STK | 140.958,00 | 377.970,00 | 237.012,00 | 94,7200 | 12.787.608,24 | 2,80 |
| US22052L1044 | Corteva Inc. | STK | 35.100,00 | 105.100,00 | 70.000,00 | 54,5300 | 1.833.160,62 | 0,40 |
| US5324571083 | Eli Lilly and Company | STK | 69.675,00 | 69.675,00 | 5.800,00 | 323,0000 | 21.554.472,75 | 4,71 |
| US3703341046 | General Mills Inc. | STK | 58.100,00 | 116.100,00 | 58.000,00 | 74,7200 | 4.157.869,94 | 0,91 |
| US3755581036 | Gilead Sciences Inc. | STK | 16.300,00 | 109.600,00 | 93.300,00 | 62,4800 | 975.408,49 | 0,21 |
| US5949181045 | Microsoft Corporation | STK | 18.115,00 | 81.615,00 | 76.700,00 | 260,2600 | 4.515.477,35 | 0,99 |
| US64110L1061 | Netflix Inc. | STK | 25.466,00 | 25.466,00 | 0,00 | 178,3600 | 4.350.268,90 | 0,95 |
| US6516391066 | Newmont Corporation | STK | 31.400,00 | 77.500,00 | 94.100,00 | 61,9900 | 1.864.271,62 | 0,41 |
| US74762E1029 | Quanta Services Inc. | STK | 139.084,00 | 136.884,00 | 132.831,00 | 119,7500 | 15.951.833,16 | 3,49 |
| | | | | | | | **98.942.565,54** | **21,64** |
| **Summe Aktien** | | | | | | | **310.181.413,06** | **67,85** |
| **VERZINSLICHE WERTPAPIERE** | | | | | | | | |
| **EUR** | | | | | | | | |
| DE0001141760 | 0,000 % Bundesrepublik Deutschland Reg.S. v.17(2022) | EUR | 68.000.000,00 | 68.000.000,00 | 0,00 | 100,1160 | 68.078.880,00 | 14,89 |
| IT0005413171 | 1,650 % Italien Reg.S. v.20(2030) | EUR | 25.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 88,9860 | 22.246.500,00 | 4,87 |
| IT0001174611 | 6,500 % Italien Reg.S. v.97(2027) | EUR | 1.700.000,00 | 0,00 | 0,00 | 120,2210 | 2.043.757,00 | 0,45 |
| | | | | | | | **92.369.137,00** | **20,21** |
| **Summe verzinsliche Wertpapiere** | | | | | | | **92.369.137,00** | **20,21** |
| **Summe börsengehandelte Wertpapiere** | | | | | | | **402.550.550,06** | **88,06** |
| **Summe Wertpapiervermögen** | | | | | | | **402.550.550,06** | **88,06** |

**DERIVATE**

Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen

| Derivate | | WHG | Bestand 30.06.2022 | Kurswert in EUR | %-Anteil am Fonds-vermögen |
|---|---|---|---|---|---|
| **AKTIENINDEX-DERIVATE** | | | | | |
| **Forderungen/Verbindlichkeiten** | | | | | |
| **Aktienindex-Terminkontrakte** | | | | | |
| Nasdaq 100 Index Future September 2022 | CME | EUR | Anzahl 63 | -21.291,06 | 0,00 |
| **Summe der Aktienindex-Derivate** | | | | **-21.291,06** | **0,00** |
| **ZINS-DERIVATE** | | | | | |
| **Forderungen/Verbindlichkeiten** | | | | | |
| **Zins-Terminkontrakte** | | | | | |
| EUX 10YR Euro-BTP Future September 2022 | EUX | EUR | -9.900.000 | -591.405,21 | -0,13 |
| **Summe der Zins-Derivate** | | | | **-591.405,21** | **-0,13** |

Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringe Differenzen entstanden sein.

Fortsetzung – Vermögensaufstellung

| Derivate | WHG | Bestand 30.06.2022 | Kurswert in EUR | %-Anteil am Fonds-vermögen |
|---|---|---|---|---|
| **DEVISEN-DERIVATE** | | | | |
| **Forderungen/Verbindlichkeiten** | | | | |
| **Devisenterminkontrakte (Verkauf)** | | | | |
| **Offene Positionen (OTC)** [1] | | | | |
| HKD | | -244.000.000,00 | -743.143,39 | -0,16 |
| USD | | -322.300.000,00 | -9.395.423,98 | -2,05 |
| **Devisenterminkontrakte (Kauf)** | | | | |
| **Offene Positionen (OTC)** [1] | | | | |
| HKD | | 244.000.000,00 | 428.865,09 | 0,09 |
| USD | | 322.300.000,00 | 6.147.375,96 | 1,34 |
| **Summe der Devisen-Derivate** | | | **-3.562.326,32** | **-0,78** |
| **BANKGUTHABEN, NICHT VERBRIEFTE GELDMARKTINSTRUMENTE UND GELDMARKTFONDS** | | | | |
| **Bankguthaben** | | | | |
| DZ PRIVATBANK S.A., Niederlassung Frankfurt | EUR | 29.564.786,51 | 29.564.786,51 | 6,47 |
| Bankguthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen | EUR | 4.299.864,55 | 4.299.864,55 | 0,94 |
| Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | AUD | 76.842,97 | 50.326,13 | 0,01 |
| Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | CAD | 1.114.845,91 | 824.224,39 | 0,18 |
| Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | CHF | 4.847.977,62 | 4.827.701,27 | 1,06 |
| Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | GBP | 4.995.269,96 | 5.793.632,52 | 1,27 |
| Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | HKD | 17.340.205,95 | 2.101.639,35 | 0,46 |
| Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | ILS | 25.517,87 | 7.044,66 | 0,00 |
| Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | JPY | 521.410.385,30 | 3.642.914,73 | 0,80 |
| Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | MYR | 15.358,89 | 3.319,98 | 0,00 |
| Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | SGD | 7.891,53 | 5.406,64 | 0,00 |
| Bankguthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | ZAR | 947.720,42 | 55.936,47 | 0,01 |
| **Summe der Bankguthaben** | | | **51.176.797,20** | **11,20** |
| **Summe der Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds** | | | **51.176.797,20** | **11,20** |
| **SONSTIGE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE** | | | | |
| Sonstige Forderungen | EUR | 3.443.207,44 | 3.443.207,44 | 0,75 |
| Zinsansprüche | EUR | 47.446,03 | 47.446,03 | 0,01 |
| Dividendenansprüche | EUR | 238.453,07 | 238.453,07 | 0,05 |
| Einschüsse (Initial Margins) | EUR | 13.208.541,79 | 13.208.541,79 | 2,89 |
| Steuerrückerstattungsansprüche | EUR | 764.985,07 | 764.985,07 | 0,17 |
| Forderungen aus Anteilumsatz | EUR | 1.794.286,19 | 1.794.286,19 | 0,39 |
| **Summe sonstige Vermögensgegenstände** | | | **19.496.919,59** | **4,26** |

1 | Gemäß der Verordnung „European Market Infrastructure Regulation" (EMIR) müssen die OTC-Derivate-Positionen besichert werden. Je nach Marktsituation erhält das Sondervermögen Sicherheiten vom Kontrahenten oder muss Sicherheiten an den Kontrahenten liefern. Eine Sicherheitenstellung erfolgt unter Berücksichtigung von Mindesttransferbeträgen.

Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringe Differenzen entstanden sein.

Fortsetzung – Vermögensaufstellung

| Derivate | WHG | Bestand 30.06.2022 | Kurswert in EUR | %-Anteil am Fonds-vermögen |
|---|---|---|---|---|
| **VERBINDLICHKEITEN AUS KREDITAUFNAHME** | | | | |
| Bankverbindlichkeiten in Nicht-EU/ EWR-Währungen | USD | -1.457.686,62 | -1.386.424,41 | -0,30 |
| **Summe Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme** | | | **-1.386.424,41** | **-0,30** |
| **SONSTIGE VERBINDLICHKEITEN** | | | | |
| Verbindlichkeiten WP-Geschäfte | EUR | -4.657.505,99 | -4.657.505,99 | -1,02 |
| Verbindlichkeiten aus Anteilumsatz | EUR | -110.922,25 | -110.922,25 | -0,02 |
| Sonstige Verbindlichkeiten [1] | EUR | -5.646.519,18 | -5.646.519,18 | -1,23 |
| **Summe sonstige Verbindlichkeiten** | | | **-10.414.947,42** | **-2,27** |
| **Fondsvermögen** | | | **457.247.872,43** | **100,00** |

| | | |
|---|---|---|
| Anteilwert | EUR | 594,83 |
| Umlaufende Anteile | STK | 768.697,967 |
| Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen | (in %) | 88,06 |
| Bestand der Derivate am Fondsvermögen | (in %) | -0,91 |



1 | Diese Position setzt sich im wesentlichen zusammen aus Wechselgeschäften, Future-Transaktionsgebühren und abgegrenzten Verwaltungsgebühren.

Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringe Differenzen entstanden sein.

Fortsetzung – Vermögensaufstellung

## WERTPAPIER-, DEVISENKURSE, MARKTSÄTZE

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf Grundlage der nachstehenden Kurse/Marktsätze bewertet:

| | |
|---|---|
| Wertpapierkurse | Kurse per 29.06.2022 oder letztbekannte |
| Alle anderen Vermögensgegenstände | Kurse per 29.06.2022 |
| Devisenkurse | Kurse per 29.06.2022 |

### DEVISENKURSE

| Devisenkurse (in Mengennotiz) | WHG | Kurse |
|---|---|---|
| Australischer Dollar | AUD | 1,526900 = 1 Euro (EUR) |
| Britisches Pfund | GBP | 0,862200 = 1 Euro (EUR) |
| Dänische Krone | DKK | 7,437800 = 1 Euro (EUR) |
| Hongkong Dollar | HKD | 8,250800 = 1 Euro (EUR) |
| Israelischer Schekel | ILS | 3,622300 = 1 Euro (EUR) |
| Japanischer Yen | JPY | 143,130000 = 1 Euro (EUR) |
| Kanadischer Dollar | CAD | 1,352600 = 1 Euro (EUR) |
| Malaysischer Ringit | MYR | 4,626200 = 1 Euro (EUR) |
| Norwegische Krone | NOK | 10,303300 = 1 Euro (EUR) |
| Schwedische Krone | SEK | 10,674100 = 1 Euro (EUR) |
| Schweizer Franken | CHF | 1,004200 = 1 Euro (EUR) |
| Singapur Dollar | SGD | 1,459600 = 1 Euro (EUR) |
| Südafrikanischer Rand | ZAR | 16,942800 = 1 Euro (EUR) |
| US Amerikanischer Dollar | USD | 1,051400 = 1 Euro (EUR) |

### MARKTSCHLÜSSEL

| | |
|---|---|
| **A) Wertpapierhandel** | |
| A | Amtlicher Börsenhandel |
| **B) Terminbörse** | |
| CME | Chicago Mercantile Exchange |
| EUX | EUREX, Frankfurt |
| **C) OTC** | |
| OTC | Over the counter |

## WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMES ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE, SOWEIT SIE NICHT MEHR IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG ERSCHEINEN

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

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück | Käufe bzw. Zugänge | Verkäufe bzw. Abgänge |
|---|---|---|---|---|
| **BÖRSENGEHANDELTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Bermudas** | | | | |
| BMG9078F1077 | Triton International Ltd. | STK | 24.400,00 | 24.400,00 |
| **Cayman Inseln** | | | | |
| KYG217651051 | CK Hutchison Holdings Ltd. | STK | 500.000,00 | 500.000,00 |
| **China** | | | | |
| CNE1000003X6 | Ping An Insurance [Group] Co. of China Ltd. | STK | 190.000,00 | 190.000,00 |
| **Dänemark** | | | | |
| DK0010244508 | A.P.Moeller-Maersk A/S | STK | 838,00 | 3.740,00 |
| DK0061539921 | Vestas Wind Systems AS | STK | 126.600,00 | 126.600,00 |
| **Deutschland** | | | | |
| DE0006766504 | Aurubis AG | STK | 0,00 | 37.724,00 |
| US09075V1026 | BioNTech SE ADR | STK | 43.375,00 | 66.902,00 |
| DE0005810055 | Dte. Börse AG | STK | 8.800,00 | 8.800,00 |
| DE0005552004 | Dte. Post AG | STK | 0,00 | 184.271,00 |
| DE000DWS1007 | DWS Group GmbH & Co. KGaA | STK | 79.500,00 | 98.600,00 |
| DE000ENAG999 | E.ON SE | STK | 465.000,00 | 3.363.600,00 |
| DE000EVNK013 | Evonik Industries AG | STK | 0,00 | 34.760,00 |
| DE000A0LD6E6 | Gerresheimer AG | STK | 48.000,00 | 48.000,00 |
| DE000A1PHFF7 | HUGO BOSS AG | STK | 72.000,00 | 72.000,00 |
| DE0007100000 | Mercedes-Benz Group AG | STK | 0,00 | 47.100,00 |
| DE000UNSE018 | Uniper SE | STK | 0,00 | 207.400,00 |
| DE000WCH8881 | Wacker Chemie AG | STK | 10.500,00 | 10.500,00 |
| **Frankreich** | | | | |
| FR0000121014 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | STK | 1.280,00 | 1.280,00 |
| FR0000120578 | Sanofi S.A. | STK | 14.500,00 | 14.500,00 |
| **Großbritannien** | | | | |
| GB00B1XZS820 | Anglo American Plc. | STK | 270.730,00 | 353.120,00 |
| GB0002374006 | Diageo Plc. | STK | 0,00 | 30.200,00 |
| GB0005405286 | HSBC Holdings Plc. | STK | 214.500,00 | 214.500,00 |
| JE00B6T5S470 | Polymetal International Plc. | STK | 97.040,00 | 97.040,00 |
| GB00B24CGK77 | Reckitt Benckiser Group Plc. | STK | 0,00 | 19.700,00 |
| GB00BH4HKS39 | Vodafone Group Plc. | STK | 1.659.500,00 | 2.680.500,00 |
| **Indien** | | | | |
| US40415F1012 | HDFC Bank Ltd. ADR | STK | 62.500,00 | 62.500,00 |
| **Italien** | | | | |
| IT0005239360 | UniCredit S.p.A. | STK | 96.800,00 | 96.800,00 |

Fortsetzung – Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück | Käufe bzw. Zugänge | Verkäufe bzw. Abgänge |
|---|---|---|---|---|
| **Japan** | | | | |
| JP3116000005 | Asahi Group Holdings Ltd. | STK | 35.500,00 | 35.500,00 |
| JP3166000004 | Ebara Corporation | STK | 0,00 | 87.200,00 |
| JP3266400005 | Kubota Corporation | STK | 55.000,00 | 125.300,00 |
| JP3500610005 | Resona Holdings Inc. | STK | 290.000,00 | 290.000,00 |
| JP3435000009 | Sony Group Corporation | STK | 8.400,00 | 8.400,00 |
| JP3402600005 | Sumitomo Metal Mining Co. Ltd. | STK | 172.300,00 | 172.300,00 |
| JP3545240008 | TechnoPro Holdings Inc. | STK | 53.100,00 | 53.100,00 |
| **Kanada** | | | | |
| CA1366351098 | Canadian Solar Inc. | STK | 48.500,00 | 48.500,00 |
| CA8239011031 | Sherritt International Corporation | STK | 45.000,00 | 45.000,00 |
| **Norwegen** | | | | |
| NO0003054108 | Mowi ASA | STK | 38.082,00 | 38.082,00 |
| NO0005052605 | Norsk Hydro ASA | STK | 531.530,00 | 531.530,00 |
| NO0011202772 | VAR Energi ASA | STK | 1.510.000,00 | 1.510.000,00 |
| **Russland** | | | | |
| US3682872078 | Gazprom PJSC ADR | STK | 194.940,00 | 194.940,00 |
| US69343P1057 | Lukoil PJSC ADR | STK | 12.150,00 | 12.150,00 |
| RU000A1025V3 | United Company Rusal IPJSC | STK | 2.931.000,00 | 2.931.000,00 |
| **Schweden** | | | | |
| SE0015811559 | Boliden AB | STK | 92.850,00 | 92.850,00 |
| SE0000825820 | Lundin Energy AB | STK | 0,00 | 39.600,00 |
| SE0016844831 | Volvo Car AB | STK | 159.260,00 | 159.260,00 |
| **Schweiz** | | | | |
| CH0023405456 | Dufry AG | STK | 29.130,00 | 29.130,00 |
| CH0038863350 | Nestlé S.A. | STK | 0,00 | 83.900,00 |
| CH0244767585 | UBS Group AG | STK | 162.190,00 | 162.190,00 |
| **Singapur** | | | | |
| SG1L01001701 | DBS Group Holdings Ltd. | STK | 153.500,00 | 153.500,00 |
| **Spanien** | | | | |
| ES0144580Y14 | Iberdrola S.A. | STK | 324.700,00 | 324.700,00 |
| ES0173516115 | Repsol S.A. | STK | 270.000,00 | 270.000,00 |
| **Südafrika** | | | | |
| ZAE000013181 | Anglo American Platinum Ltd. | STK | 9.437,00 | 9.437,00 |
| ZAE000259701 | Sibanye Stillwater Ltd. | STK | 976.400,00 | 976.400,00 |
| US82575P1075 | Sibanye Stillwater Ltd. ADR | STK | 297.200,00 | 297.200,00 |
| **Taiwan** | | | | |
| US8740391003 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. ADR | STK | 23.960,00 | 23.960,00 |
| **Vereinigte Staaten von Amerika** | | | | |
| US0231351067 | Amazon.com Inc. | STK | 1.775,00 | 1.775,00 |
| US0378331005 | Apple Inc. | STK | 23.471,00 | 133.111,00 |
| US0605051046 | Bank of America Corporation | STK | 198.600,00 | 198.600,00 |
| US1266501006 | CVS Health Corporation | STK | 49.700,00 | 68.300,00 |
| US5128071082 | Lam Research Corporation | STK | 2.240,00 | 2.240,00 |

Fortsetzung – Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

| ISIN | Gattungsbezeichnung | Stück/ WHG/ Anteile | Käufe bzw. Zugänge | Verkäufe bzw. Abgänge |
|---|---|---|---|---|
| **Vereinigte Staaten von Amerika** | | | | |
| US61945C1036 | Mosaic Co., The | STK | 24.500,00 | 24.500,00 |
| US6974351057 | Palo Alto Networks Inc. | STK | 2.624,00 | 5.142,00 |
| US7170811035 | Pfizer Inc. | STK | 77.640,00 | 510.320,00 |
| US88033G4073 | Tenet Healthcare Corporation | STK | 68.700,00 | 68.700,00 |
| US3825501014 | The Goodyear Tire & Rubber Co. | STK | 0,00 | 353.800,00 |
| **VERZINSLICHE WERTPAPIERE** | | | | |
| **USD** | | | | |
| XS1982118264 | 2,750 % Saudi Arabian Oil Co. Reg.S. v.19(2022) | USD | 0,00 | 500.000,00 |
| US912810TD00 | 2,250 % Vereinigte Staaten von Amerika v.22(2052) | USD | 60.000.000,00 | 60.000.000,00 |
| **ZERTIFIKATE** | | | | |
| **Großbritannien** | | | | |
| DE000A0N62E5 | Wisdom Tree Metal Securities Ltd./Palladium Zert. v.07(2199) | STK | 90.568,00 | 90.568,00 |
| **SONSTIGE BETEILIGUNGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Schweiz** | | | | |
| CH0012032048 | Roche Holding AG Genussscheine | STK | 30.777,00 | 48.632,00 |
| **INVESTMENTANTEILE** | | | | |
| **Gruppenfremde Investmentanteile** | | | | |
| LU0488317701 | ComStage SICAV – NYSE Arca Gold BUGS UCITS ETF (0,00 %) | ANT | 477.508,00 | 783.598,00 |

**DERIVATE**

In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe

| Derivate | WHG | Volumen in 1.000 |
|---|---|---|
| **Terminkontrakte** | | |
| **TERMINKONTRAKTE AUF WÄHRUNG** | | |
| **Gekaufte Kontrakte** | | |
| Basiswert(e) USD/EUR Devisenkurs | USD | 356.663 |
| **Verkaufte Kontrakte** | | |
| Basiswert(e) USD/EUR Devisenkurs | USD | 26.878 |

Fortsetzung – Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen

| Derivate | WHG | Volumen in 1.000 |
|---|---|---|
| **AKTIENINDEX-TERMINKONTRAKTE** | | |
| **Gekaufte Kontrakte** | | |
| Basiswert(e) DAX Index | EUR | 725.528 |
| Basiswert(e) E-Mini S&P 500 Index | USD | 212.196 |
| Basiswert(e) EURO STOXX Insurance Index | EUR | 4.630 |
| Basiswert(e) Euro Stoxx 50 Price Index | EUR | 93.481 |
| Basiswert(e) Hang Seng Index | HKD | 82.808 |
| Basiswert(e) Nasdaq 100 Index | USD | 456.225 |
| Basiswert(e) Nikkei 225 Stock Average Index | USD | 19.766 |
| Basiswert(e) STOXX Insurance Index | EUR | 38.035 |
| Basiswert(e) STOXX 600 Automobiles & Parts Index | EUR | 37.973 |
| Basiswert(e) Stoxx 600 Banks Index | EUR | 75.388 |
| Basiswert(e) STOXX 600 Chemicals Index | EUR | 19.078 |
| Basiswert(e) STOXX 600 Oil & Gas Index | EUR | 43.199 |
| **Verkaufte Kontrakte** | | |
| Basiswert(e) DAX Index | EUR | 778.690 |
| Basiswert(e) E-Mini S&P 500 Index | USD | 186.596 |
| Basiswert(e) Euro Stoxx 50 Price Index | EUR | 42.217 |
| Basiswert(e) Hang Seng Index | HKD | 159.994 |
| Basiswert(e) Nasdaq 100 Index | USD | 277.942 |
| Basiswert(e) Nikkei 225 Stock Average Index | USD | 20.636 |
| Basiswert(e) STOXX 600 Automobiles & Parts Index | EUR | 33.101 |
| Basiswert(e) Stoxx 600 Banks Index | EUR | 9.651 |
| Basiswert(e) STOXX 600 Oil & Gas Index | EUR | 18.916 |
| **ZINS-TERMINKONTRAKTE** | | |
| **Verkaufte Kontrakte** | | |
| Basiswert(e) Italien BTP 10Yr 6% Synth. Anleihe | EUR | 98.444 |
| Basiswert(e) US T-Bond 10Yr 6% Synth. Anleihe | USD | 17.597 |
| Basiswert(e) US T-Bond 30Yr 6% Synth. Anleihe | USD | 76.304 |
| **DEVISENTERMINKONTRAKTE (VERKAUF)** | | |
| **Verkauf von Devisen auf Termin** | | |
| HKD | EUR | 31.995 |
| USD | EUR | 45.866 |
| **DEVISENTERMINKONTRAKTE (KAUF)** | | |
| **Kauf von Devisen auf Termin** | | |
| HKD | EUR | 32.358 |
| USD | EUR | 45.269 |

# ANHANG
# ANGABEN GEM. § 7 NR. 9 KARBV

## SONSTIGE ANGABEN

| | | |
|---|---|---|
| **Anteilwert** | **EUR** | **594,83** |
| **Umlaufende Anteile** | **STK** | **768.697,967** |

## ANGABE ZU DEN VERFAHREN ZUR BEWERTUNG DER VERMÖGENSGEGENSTÄNDE

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgt gemäß §§ 168 und 169 KAGB und der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und -Bewertungsverordnung („KARBV").

## ALLGEMEINE REGELN FÜR DIE VERMÖGENSBEWERTUNG

### An einer Börse zugelassene/an einem organisierten Markt gehandelte Vermögensgegenstände

Vermögensgegenstände, die zum Handel an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind sowie Bezugsrechte für das OGAW-Sondervermögen werden zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet, sofern im nachfolgenden Abschnitt „Besondere Regeln für die Bewertung einzelner Vermögensgegenstände" nicht anders angegeben.

### Nicht an Börsen notierte oder an organisierten Märkten gehandelte Vermögensgegenstände oder Vermögensgegenstände ohne handelbaren Kurs

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist, sofern im nachfolgenden Abschnitt „Besondere Regeln für die Bewertung einzelner Vermögensgegenstände" nicht anders angegeben.

## BESONDERE REGELN FÜR DIE BEWERTUNG EINZELNER VERMÖGENSGEGENSTÄNDE

### Nichtnotierte Schuldverschreibungen und Schulscheindarlehen

Für die Bewertung von Schuldverschreibungen, die nicht zum Handel an einer Börse zugelassen oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind (z. B. nicht notierte Anleihen, Commercial Papers und Einlagenzertifikate), und für die Bewertung von Schuldscheindarlehen werden die für vergleichbare Schuldverschreibungen und Schuldscheindarlehen vereinbarten Preise und gegebenenfalls die Kurswerte von Anleihen vergleichbarer Emittenten mit entsprechender Laufzeit und Verzinsung herangezogen, erforderlichenfalls mit einem Abschlag zum Ausgleich der geringeren Veräußerbarkeit.

## OPTIONSRECHTE UND TERMINKONTRAKTE

Die zu dem OGAW-Sondervermögen gehörenden Optionsrechte und Verbindlichkeiten aus einem Dritten eingeräumten Optionsrechten, die zum Handel an einer Börse zugelassen oder an einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind, werden zu dem jeweils letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet, bewertet.

Das gleiche gilt für Forderungen und Verbindlichkeiten aus für Rechnung des OGAW-Sondervermögens verkauften Terminkontrakten. Die zu Lasten des OGAW-Sondervermögens geleisteten Einschüsse werden unter Einbeziehung der am Börsentag festgestellten Bewertungsgewinne und Bewertungsverluste zum Wert des OGAW-Sondervermögens hinzugerechnet.

## BANKGUTHABEN UND FESTGELDER, ANTEILE AN INVESTMENTVERMÖGEN

Bankguthaben werden grundsätzlich zu ihrem Nennwert zuzüglich zugeflossener Zinsen bewertet.

Festgelder werden zum Verkehrswert bewertet, sofern das Festgeld jederzeit kündbar ist und die Rückzahlung bei der Kündigung nicht zum Nennwert zuzüglich Zinsen erfolgt.

Anteile an Investmentvermögen werden grundsätzlich mit ihrem letzten festgestellten Rücknahmepreis angesetzt oder zum letzten verfügbaren handelbaren Kurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleitstet, Stehen diese Werte nicht zur Verfügung, werden Anteile an Investmentvermögen zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Berwertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

## AUF AUSLÄNDISCHE WÄHRUNG LAUTENDE VERMÖGENSGEGENSTÄNDE

Der Marktwert von auf ausländische Währung lautenden Vermögensgegenständen, wird zum letzten Devisenmittelkurs

in die entsprechende Fondswährung umgerechnet. Gewinne und Verluste aus Devisentransaktionen, werden jeweils hinzugerechnet oder abgesetzt.

## ZUSÄTZLICHE ANHANGSANGABEN GEMÄSS DER VERORDNUNG (EU) 2015/2365 ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Die DJE Investment S.A., als EU-OGAW-Verwaltungsgesellschaft von Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) sowie als Verwalter alternativer Investmentfonds („AIFM"), fällt per Definition in den Anwendungsbereich der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 („SFTR").

Im Berichtszeitraum des OGAW-Sondervermögens kamen keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps im Sinne dieser Verordnung zum Einsatz. Somit sind im vorliegenden Bericht keine Angaben im Sinne von Artikel 13 der genannten Verordnung an die Anleger aufzuführen.

Details zur Anlagestrategie und den eingesetzten Finanzinstrumenten des OGAW-Sondervermögens können jeweils aus dem aktuellen Verkaufsprospekt sowie kostenlos auf der Internetseite der EU-OGAW-Verwaltungsgesellschaft unter „www.dje.de" entnommen werden.

## INFORMATIONEN FÜR SCHWEIZER ANLEGER

### ALLGEMEINES

Die konstituierenden Dokumente, die Prospekte, die wesentlichen Anlegerinformationen (KIID), die letzten verfügbaren Jahres- und Halbjahresberichte, die aktuellen Anteilspreise sowie weitere Informationen sind kostenlos in deutscher Sprache bei dem Vertreter in der Schweiz als auch auf folgender Webseite erhältlich: https://www.djefinanz.ch/CH_de/home. In der Schweiz können diese bei „www.fundinfo.com" kostenlos bezogen werden.

### VALORENNUMMER

| Fondsname | Valorennummer |
|---|---|
| FMM-Fonds | 332250 |

### TOTAL EXPENSE RATIO (TER)

Die bei der Verwaltung der kollektiven Kapitalanlage angefallenen Kommissionen und Kosten sind in der international unter dem Begriff „Total Expense Ratio (TER)" bekannten Kennziffer offen zu legen. Diese Kennziffer drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Vermögen der Kollektivanlage belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem Prozentsatz des Netto-Teilfondsvermögens aus und ist grundsätzlich nach folgender Formel zu berechnen:

$$\text{TER}\,\% = \frac{\text{Total Betriebsaufwand in RE}^{1}}{\text{Durchschnittliches Nettovermögen in RE}^{1}} \times 100$$

Nach Richtlinie der Asset Management Association Switzerland (AMAS) vom 16. Mai 2008 (Fassung vom 5. August 2021) wurde für den Zeitraum vom 1. Juli 2021 bis 30. Juni 2022 folgende TER in Prozent ermittelt:

| Fondsname | Schweizer TER ohne Performance Fee |
|---|---|
| FMM-Fonds | 1,61 |

Eine Performance Fee ist im Berichtszeitraum vom 1. Juli 2021 bis 30. Juni 2022 nicht angefallen.

### HINWEISE FÜR DIE ANLEGER

Aus der Fondsmanagementvergütung können Vergütungen für den Vertrieb des Anlagefonds (Bestandspflegekommissionen) an Vertriebsträger und Vermögensverwalter ausgerichtet werden. Aus der Verwaltungskommission können institutionellen Anlegern, welche die Fondsanteile wirtschaftlich für Dritte halten, Rückvergütungen gewährt werden.

### PROSPEKTÄNDERUNGEN IM BERICHTSZEITRAUM

Publikationen zu Prospektänderungen im Berichtszeitraum werden auf www.fundinfo.com zum Abruf zur Verfügung gestellt.

Luxemburg, 9. August 2022

DJE Investment S.A.
Der Verwaltungsrat

1 | RE = Einheiten in der Rechnungswährung der kollektiven Kapitalanlage

## STANDORTE

### MÜNCHEN

DJE Kapital AG
Pullacher Straße 24
82049 Pullach
Deutschland

**T** +49 89 790453-0
**F** +49 89 790453-185
**E** info@dje.de

### FRANKFURT AM MAIN

DJE Kapital AG
Metzlerstraße 39
60594 Frankfurt am Main
Deutschland

**T** +49 69 66059369-0
**F** +49 69 66059369-815
**E** frankfurt@dje.de

### KÖLN

DJE Kapital AG
Spichernstraße 44
50672 Köln
Deutschland

**T** +49 221 9140927-0
**F** +49 221 9140927-825
**E** koeln@dje.de

### ZÜRICH

DJE Finanz AG
Talstrasse 37 (Paradeplatz)
8001 Zürich
Schweiz

**T** +41 43 34462-80
**F** +41 43 34462-89
**E** info@djefinanz.ch

### LUXEMBURG

DJE Investment S.A.
4, rue Thomas Edison
1445 Luxemburg
Luxemburg

**T** +352 26 9252-20
**F** +352 26 9252-52
**E** info@dje.lu